

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券 投资基金 2013 年半年度报告摘要

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一三年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴进取策略混合
基金主代码	580005
交易代码	580005
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 5 月 6 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	621,362,718.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。
业绩比较基准	65%*沪深 300 指数+35%*中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	李芳菲
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	67,813,872.85
本期利润	94,049,945.80
加权平均基金份额本期利润	0.1434
本期基金份额净值增长率	17.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1419
期末基金资产净值	607,742,504.09
期末基金份额净值	0.9781

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

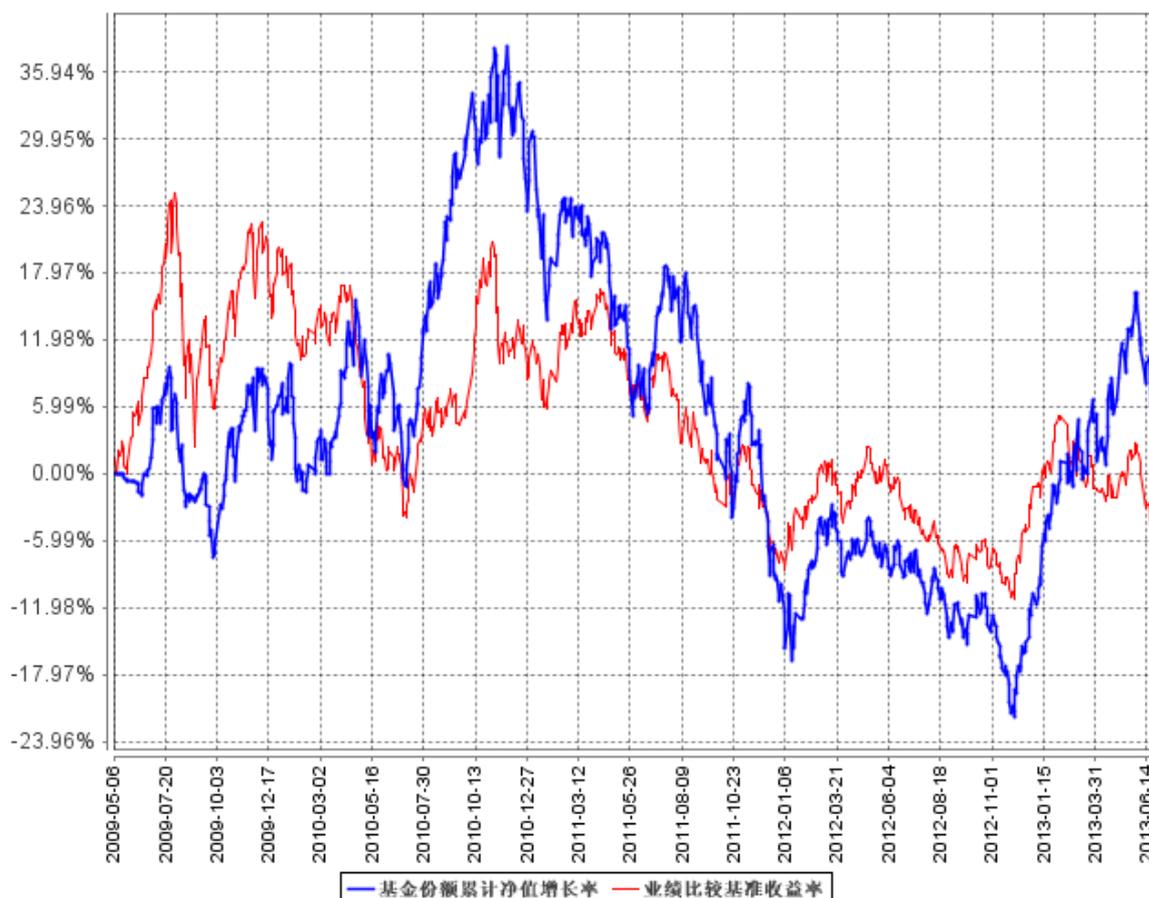
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-9.09%	1.63%	-10.22%	1.23%	1.13%	0.40%
过去三个月	-0.11%	1.40%	-7.33%	0.95%	7.22%	0.45%
过去六个月	17.11%	1.35%	-7.39%	0.98%	24.50%	0.37%
过去一年	13.52%	1.14%	-5.57%	0.89%	19.09%	0.25%

过去三年	4.17%	1.20%	-5.77%	0.90%	9.94%	0.30%
自基金合同生效起至今	4.62%	1.20%	-7.90%	0.99%	12.52%	0.21%

注：比较基准=65%*沪深 300 指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、东吴进取策略基金于 2009 年 5 月 6 日成立。

2、比较基准=65%*沪深 300 指数+35%*中信标普全债指数。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字【2003】82 号批准设立的证券投资基金管理公司，于 2004 年 9 月正式成立，注册资本人民币 1 亿元，由东吴证券股份有限公司、上海兰生（集团）有限公司、江阴澄星实业集团有限公司共同发起设立。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有争、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”的远大理想，创造性地树立公司独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 15 只，其中股票型基金 5 只，分别为东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、东吴新经济股票型证券投资基金、东吴新创业股票型证券投资基金、东吴新产业精选股票型证券投资基金；债券型基金 3 只，分别为东吴优信稳健债券型证券投资基金、东吴增利债券型证券投资基金、东吴鼎利分级债券型证券投资基金；混合型基金 4 只，分别为东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、东吴内需增长混合型证券投资基金；货币型基金 1 只，为东吴货币市场证券投资基金；指数型基金 1 只，为东吴中证新兴产业指数证券投资基金；LOF 基金 1 只，为东吴深证 100 指数增强型股票投资基金。

2013 年上半年，上证综指持续下跌，基金行业仍旧面临较大的经营压力，在此背景下，公司依托品牌特色和投资业绩，全面推进公司各项业务发展，取得了一系列经营成果和经营管理经验。今年上半年以来，东吴旗下多只基金业绩稳居同类前列，其中东吴进取策略混合型证券投资基金以 23.01% 的净值增长率位列同类 71 只基金第 6 位，东吴中证新兴产业股票型投资基金以 11.11% 的净值增长率位列同类 119 只基金第 10 名，东吴新产业精选股票型证券投资基金也以 17.70% 的净值增长率位列同类型基金排名前四分之一的序列。同时，公司抓住新一轮监管政策带来的改革红利和转型红利，及时申报设立了特定资产管理业务子公司。在严控风险的基础上，大力开展专项资产管理业务，全心全意打造财富管理平台。下一步，公司将秉承“三满意一放心”的经营理念，继续以市场为导向、以客户为中心，强化服务意识，拓展发展空间，全面提高公司的核心竞争力，推进东吴基金向现代财富管理公司转型。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐祝益	本基金基金经理、公司权益类投资总	2012 年 4 月 6 日	-	13.5 年	经济学硕士，南京大学毕业，曾任上海证券综合研究有限公司证

	监兼投资管理部总经理			券分析师、华鑫证券投资经理、海通证券投资经理等职；2009 年 8 月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司投资管理部总经理助理、投资管理部副总经理、公司投资副总监、东吴嘉禾优势精选混合基金基金经理，现担任公司权益类投资总监兼投资管理部总经理、东吴进取策略混合基金基金经理、东吴双动力股票基金基金经理。
--	------------	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之

间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2013 年上半年，本基金保持了较高且稳定的股票资产配置水平。在行业及个股配置上，本基金自下而上精选了部分医药个股作为重点配置；基于对中国经济增长动力转型、消费者购买力提升、行业竞争格局变好的判断，大量配置了日常消费类品种，增加了以汽车为主的部分周期性消费个股；鉴于环保要求越来越高，寻找供给端受压缩的农药类个股进行了适当的战术性配置；根据金融环境的变化，减少了银行、保险的配置比例，增加了证券股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.9781 元，累计净值 1.0481 元；本报告期份额净值增长率 17.11%，同期业绩比较基准收益率为-7.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，市场投资者已经清醒认识到了，在政府及企业去杠杆的背景下，中国经济步入调整期，经济增长速度会显著下台阶，在这个过程中，产业结构会显著调整，与固定资产投资相关的行业会出现激烈的去产能的过程，与长期经济增长方向吻合的行业会得到更快的发展。股票市场把这种预期反映的淋漓尽致，传统产业相关行业的估值水平维持在低位，而与新兴产业相关板块的估值水平仿佛没有天花板。

我们相信这其中存在了很多情绪性的东西，既有被低估的也有被高估的。从中国经济的未来发展方向看，消费拉动以及消费升级无疑是一个重要内容，在商业格局巨变的情况下，有品牌的公司依旧能够获得比较好的竞争优势，我们将在食品、服装、家电等领域寻找性价比更好的公司进行投资。从老龄化的角度来看，医药以及保健的长期潜力是巨大的，但是这些股票显然面对估值的困扰，这要求我们密切跟踪公司的成长指标，寻求估值与成长性相匹配。电子信息以及信息服务无疑是上半年超额收益最大的板块，但是，这些公司从事的更多是与周期性消费品相关的生产与服务，我们很难认可整个板块的高估值，更愿意从个体公司的竞争力出发，寻找优质品种进

行投资。金融板块整体处于低估值的状态，这其中蕴含了投资者对中国经济前景以及利率市场化的担忧，但是资金融通是一个必然存在的经济手段，这种低估值为我们认真思考并挑选优质公司提供了好的机会，我们认为证券行业的赢利手段开始多元化，并且开始脱离股票市场行情的制约，成为利率市场化的最大赢家，在 A 股市场低迷的情况下，恰恰是投资的良机。

风格转换一直是投资者关心的问题，从结构转型的宏观背景看，在接下来的一段时间不应该是核心问题，但是股票市场依然存在结构性机遇，我们将从基本面出发，秉承成长与消费两大主题，仔细甄别，去伪存真，以寻求更稳定、更持久的收益水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总裁、投资总监、运营总监、基金会计、金融工程人员、监察稽核人员组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营总监、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、监察稽核业务相关人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金合同》、《东吴基金管理有限公司托管协议》的约定，对东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金管理人—东吴基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	66,176,771.47	36,093,391.32
结算备付金	1,020,130.51	374,790.91
存出保证金	333,015.25	-
交易性金融资产	542,373,592.94	576,195,872.28

其中：股票投资	470,804,189.39	485,962,052.38
基金投资	-	-
债券投资	71,569,403.55	90,233,819.90
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	12,273,159.21
应收利息	476,962.30	452,907.19
应收股利	-	-
应收申购款	519,654.78	75,804.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	610,900,127.25	625,465,925.16
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2013年6月30日	2012年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	938,629.67	438,506.98
应付管理人报酬	784,905.07	742,004.93
应付托管费	130,817.53	123,667.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,105,924.89	875,930.38
应交税费	1,600.00	1,600.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	195,746.00	390,358.07
负债合计	3,157,623.16	2,572,067.82
所有者权益：		
实收基金	621,362,718.55	745,782,289.92
未分配利润	-13,620,214.46	-122,888,432.58
所有者权益合计	607,742,504.09	622,893,857.34
负债和所有者权益总计	610,900,127.25	625,465,925.16

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9781 元，基金份额总额 621362718.55 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	102,031,354.84	43,860,592.49
1.利息收入	627,850.73	1,565,950.18
其中：存款利息收入	213,865.81	787,460.10
债券利息收入	412,125.88	588,621.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,859.04	189,868.22
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	75,000,723.28	-115,077,105.45
其中：股票投资收益	68,483,775.27	-121,766,107.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,225,104.64	-285,671.81
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,291,843.37	6,974,673.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	26,236,072.95	157,244,895.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	166,707.88	126,852.74
减：二、费用	7,981,409.04	13,364,016.39
1.管理人报酬	4,726,467.85	8,476,910.99
2.托管费	787,744.69	1,412,818.39
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,263,504.31	3,268,817.08
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	203,692.19	205,469.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	94,049,945.80	30,496,576.10
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	94,049,945.80	30,496,576.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	745,782,289.92	-122,888,432.58	622,893,857.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	94,049,945.80	94,049,945.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-124,419,571.37	15,218,272.32	-109,201,299.05
其中：1.基金申购款	244,802,831.50	-12,790,132.40	232,012,699.10
2.基金赎回款	-369,222,402.87	28,008,404.72	-341,213,998.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	621,362,718.55	-13,620,214.46	607,742,504.09
	上年度可比期间		
	2012年1月1日至2012年6月30日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,411,915,386.89	-221,722,377.64	1,190,193,009.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,496,576.10	30,496,576.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-168,704,705.73	19,104,795.77	-149,599,909.96
其中：1.基金申购款	28,441,925.71	-4,107,147.93	24,334,777.78
2.基金赎回款	-197,146,631.44	23,211,943.70	-173,934,687.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,243,210,681.16	-172,121,005.77	1,071,089,675.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>任少华</u>	<u>吕晖</u>	<u>袁渊</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]140 号文核准向社会公开发行募集,基金合同于 2009 年 5 月 6 日正式生效。首次设立募集规模为 1,048,618,365.29 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为东吴基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资组合中股票类投资比例为基金资产的 30%-80%,固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%,现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于权证以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。本基金的业绩比较基准=65%*沪深 300 指数+35%*中信标普全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴进取策略混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局批准，自 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税率，对出让方按 0.1% 的税率征收，对受让方不再征税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，基金向个人投资者分配股息、红利、利息时，不再代扣个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
江阴澄星实业集团有限公司	基金管理人的股东

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	4,299,469.98	0.30%	-	-

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-

债券回购交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	3,914.22	0.30%	3,914.22	0.35%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,726,467.85	8,476,910.99
其中：支付销售机构的客户维护费	735,725.32	700,897.33

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	787,744.69	1,412,818.39

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30 日
基金合同生效日（2009年5月6日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	29,999,000.00	29,999,000.00

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	29,999,000.00	-
期末持有的基金份额	-	29,999,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.41%

注：本关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	66,176,771.47	198,135.93	159,164,443.51	773,446.03

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000999	华润三九	2013年6月3日	重大资产重组	26.55	2013年8月19日	26.51	335,647	6,763,449.91	8,911,427.85	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	470,804,189.39	77.07
	其中：股票	470,804,189.39	77.07
2	固定收益投资	71,569,403.55	11.72
	其中：债券	71,569,403.55	11.72
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	67,196,901.98	11.00
6	其他各项资产	1,329,632.33	0.22
7	合计	610,900,127.25	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	18,392,760.44	3.03
B	采矿业	1,085,051.24	0.18
C	制造业	379,954,961.39	62.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,266,022.13	1.36

F	批发和零售业	17,824,610.45	2.93
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,541,822.20	0.58
J	金融业	22,586,927.44	3.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,757,295.00	2.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,394,739.10	1.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	470,804,189.39	77.47

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600867	通化东宝	2,519,818	37,520,090.02	6.17
2	600305	恒顺醋业	1,252,656	31,604,510.88	5.20
3	000625	长安汽车	2,926,170	27,184,119.30	4.47
4	601633	长城汽车	759,940	26,917,074.80	4.43
5	600837	海通证券	2,407,988	22,586,927.44	3.72
6	000895	双汇发展	540,092	20,761,136.48	3.42
7	601965	中国汽研	2,039,310	18,863,617.50	3.10
8	000800	一汽轿车	1,504,220	18,501,906.00	3.04
9	002477	雏鹰农牧	1,164,836	18,392,760.44	3.03
10	600703	三安光电	916,531	18,000,668.84	2.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.scfund.com.cn 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	44,789,605.08	7.19
2	600048	保利地产	43,000,054.94	6.90
3	002273	水晶光电	42,206,628.00	6.78
4	000625	长安汽车	40,614,050.00	6.52
5	000731	四川美丰	37,173,758.39	5.97
6	601788	光大证券	33,391,417.87	5.36
7	600867	通化东宝	28,774,091.48	4.62
8	002138	顺络电子	26,809,116.83	4.30
9	601965	中国汽研	20,734,368.92	3.33
10	600596	新安股份	20,283,112.10	3.26
11	600276	恒瑞医药	19,653,039.14	3.16
12	600703	三安光电	17,852,575.83	2.87
13	600352	浙江龙盛	16,928,043.79	2.72
14	000525	红太阳	16,561,286.33	2.66
15	002091	江苏国泰	16,401,278.40	2.63
16	601601	中国太保	16,207,010.60	2.60
17	000800	一汽轿车	15,984,678.41	2.57
18	600872	中炬高新	15,840,511.90	2.54
19	600104	上汽集团	15,402,340.46	2.47
20	600805	悦达投资	14,935,789.76	2.40
21	000002	万科A	12,500,000.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	44,040,029.14	7.07
2	002273	水晶光电	44,003,322.75	7.06
3	000423	东阿阿胶	40,466,182.97	6.50
4	600837	海通证券	32,186,820.17	5.17

5	601601	中国太保	30,710,725.88	4.93
6	300347	泰格医药	30,211,351.04	4.85
7	601788	光大证券	27,610,872.25	4.43
8	600389	江山股份	27,311,363.52	4.38
9	600030	中信证券	27,163,793.33	4.36
10	600587	新华医疗	26,929,692.86	4.32
11	002477	雏鹰农牧	23,017,964.33	3.70
12	000731	四川美丰	21,971,026.24	3.53
13	600596	新安股份	19,159,838.68	3.08
14	000525	红太阳	18,734,933.42	3.01
15	601166	兴业银行	18,710,541.66	3.00
16	601318	中国平安	18,418,893.51	2.96
17	600143	金发科技	17,158,020.51	2.75
18	600694	大商股份	16,729,436.68	2.69
19	000625	长安汽车	16,417,830.11	2.64
20	002588	史丹利	15,981,083.42	2.57
21	600104	上汽集团	15,853,822.05	2.55
22	601633	长城汽车	14,845,085.76	2.38
23	600315	上海家化	14,576,443.31	2.34
24	000895	双汇发展	14,076,540.61	2.26
25	600805	悦达投资	13,100,874.54	2.10
26	601628	中国人寿	12,613,676.62	2.03
27	601566	九牧王	12,565,679.18	2.02

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	678,428,974.39
卖出股票收入（成交）总额	787,119,714.28

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	71,569,403.55	11.78
8	其他	-	-
9	合计	71,569,403.55	11.78

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110003	新钢转债	163,500	17,028,525.00	2.80
2	113003	重工转债	100,000	10,932,000.00	1.80
3	113001	中行转债	104,910	10,502,540.10	1.73
4	113002	工行转债	95,520	10,447,977.60	1.72
5	110016	川投转债	73,650	8,896,920.00	1.46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	333,015.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	476,962.30
5	应收申购款	519,654.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,329,632.33

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	17,028,525.00	2.80
2	113003	重工转债	10,932,000.00	1.80
3	113001	中行转债	10,502,540.10	1.73
4	113002	工行转债	10,447,977.60	1.72
5	110016	川投转债	8,896,920.00	1.46
6	110017	中海转债	8,123,493.00	1.34
7	110015	石化转债	3,484,716.20	0.57
8	126729	燕京转债	1,938,189.85	0.32
9	110011	歌华转债	170,975.00	0.03
10	110018	国电转债	44,066.80	0.01

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
30,005	20,708.64	199,483,338.27	32.10%	421,879,380.28	67.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	-	-

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年5月6日）基金份额总额	1,048,618,365.29
本报告期期初基金份额总额	745,782,289.92
本报告期基金总申购份额	244,802,831.50
减：本报告期基金总赎回份额	369,222,402.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	621,362,718.55

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司聘任王炯同志为东吴基金管理有限公司常务副总经理。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第四次临时会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2013 年 3 月 12 日进行了披露。

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司聘任徐军同志为东吴基金管理有限公司督察长。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第六次临时会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2013 年 3 月 29 日进行了披露，自 2013 年 3 月 29 日起，公司总经理任少华同志不再代为履行公司督察长职务。

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司原副总经理胡玉杰同志因个人原因辞去副总经理职务，离任日期 2013 年 4 月 13 日。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第二十次会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2013 年 4 月 13 日进行了披露。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内聘用江苏天衡会计师事务所担任本基金会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	309,366,419.31	21.32%	278,415.73	21.21%	-

国金证券	1	204,841,629.50	14.11%	186,487.33	14.21%	-
中银国际	2	182,400,377.43	12.57%	166,057.39	12.65%	-
中信建投	1	147,161,245.18	10.14%	133,976.03	10.21%	-
高华证券	1	113,788,816.25	7.84%	101,112.98	7.70%	-
齐鲁证券	1	109,912,110.50	7.57%	100,063.47	7.62%	-
中投证券	1	94,327,898.74	6.50%	85,682.46	6.53%	-
金元证券	1	78,620,899.26	5.42%	71,576.30	5.45%	-
中金公司	2	63,163,804.74	4.35%	57,504.07	4.38%	-
浙商证券	1	54,435,701.42	3.75%	48,170.12	3.67%	-
瑞银证券	1	39,212,670.05	2.70%	34,952.93	2.66%	-
申银万国	1	29,586,433.23	2.04%	26,935.81	2.05%	-
东方证券	1	20,176,264.94	1.39%	17,854.04	1.36%	-
东吴证券	2	4,299,466.60	0.30%	3,914.22	0.30%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 2 个交易单元：东北证券、国海股份；退租 3 个交易单元：国信证券、中信证券、申银万国。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	285,442.97	0.28%	-	-	-	-
国金证券	12,090,581.90	11.76%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	8,520,373.40	8.29%	-	-	-	-
高华证券	9,971,873.79	9.70%	-	-	-	-
齐鲁证券	32,890,569.10	32.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	39,020,539.20	37.97%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司
2013 年 8 月 29 日