

# 东吴内需增长混合型证券投资基金 2013 年 年度报告

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一四年三月二十九日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 21 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。

本报告期自 2013 年 1 月 30 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
8.11 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
11.2 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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4 基金投资策略的改变 .....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 其他重大事件 .....	51
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
13.1 备查文件目录 .....	55
13.2 存放地点 .....	55
13.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴内需增长混合型证券投资基金
基金简称	东吴内需增长混合
基金主代码	580009
交易代码	580009
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	2013 年 1 月 30 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,867,929.59 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在充分控制基金资产风险的前提下，主要投资于受益于国家内需增长政策导向且具有竞争优势的上市公司，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。在严格控制风险的基础之上，精选受益于国家内需增长政策导向且具有竞争优势的上市公司，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益。此外，本基金还可通过新股申购策略、债券投资策略、权证及其他金融工具投资策略等辅助投资策略，控制基金组合的投资风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种。

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	裴学敏
	联系电话	021-50509888-8308	95559
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95559
传真		021-50509888-8211	021-62701216
注册地址		上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200135	200120
法定代表人		任少华	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天衡会计师事务所(特殊普通合伙)	中国南京市正洪街 18 号东宇大厦 8 楼
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2013 年 1 月 30 日 (基金合同生效 日)-2013 年 12 月 31 日	2012 年	2011 年
本期已实现收益	6,825,962.50	-	-
本期利润	11,924,567.74	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0891	-	-
本期加权平均净值利润率	8.64%	-	-

本期基金份额净值增长率	12.80%	-	-
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2013 年末</b>	<b>2012 年末</b>	<b>2011 年末</b>
期末可供分配利润	5,779,606.76	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0950	-	-
期末基金资产净值	68,687,247.88	-	-
期末基金份额净值	1.128	-	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2013 年末</b>	<b>2012 年末</b>	<b>2011 年末</b>
基金份额累计净值增长率	12.80%	-	-

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。

4、本基金于 2013 年 1 月 30 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

## 3.2 基金净值表现

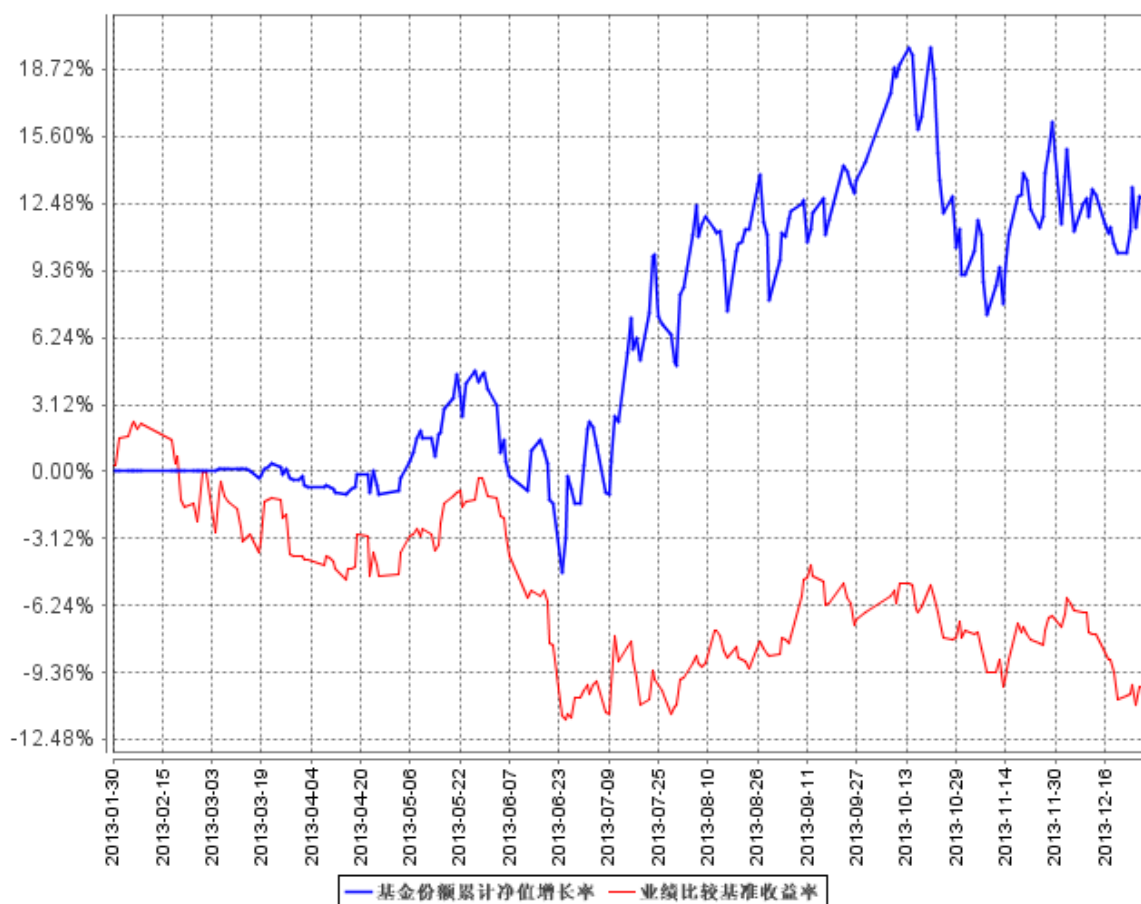
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.40%	1.39%	-3.04%	0.68%	1.64%	0.71%
过去六个月	14.52%	1.37%	1.71%	0.78%	12.81%	0.59%
自基金合同生效起至今	12.80%	1.14%	-9.41%	0.84%	22.21%	0.30%

注：比较基准=60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。

### 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



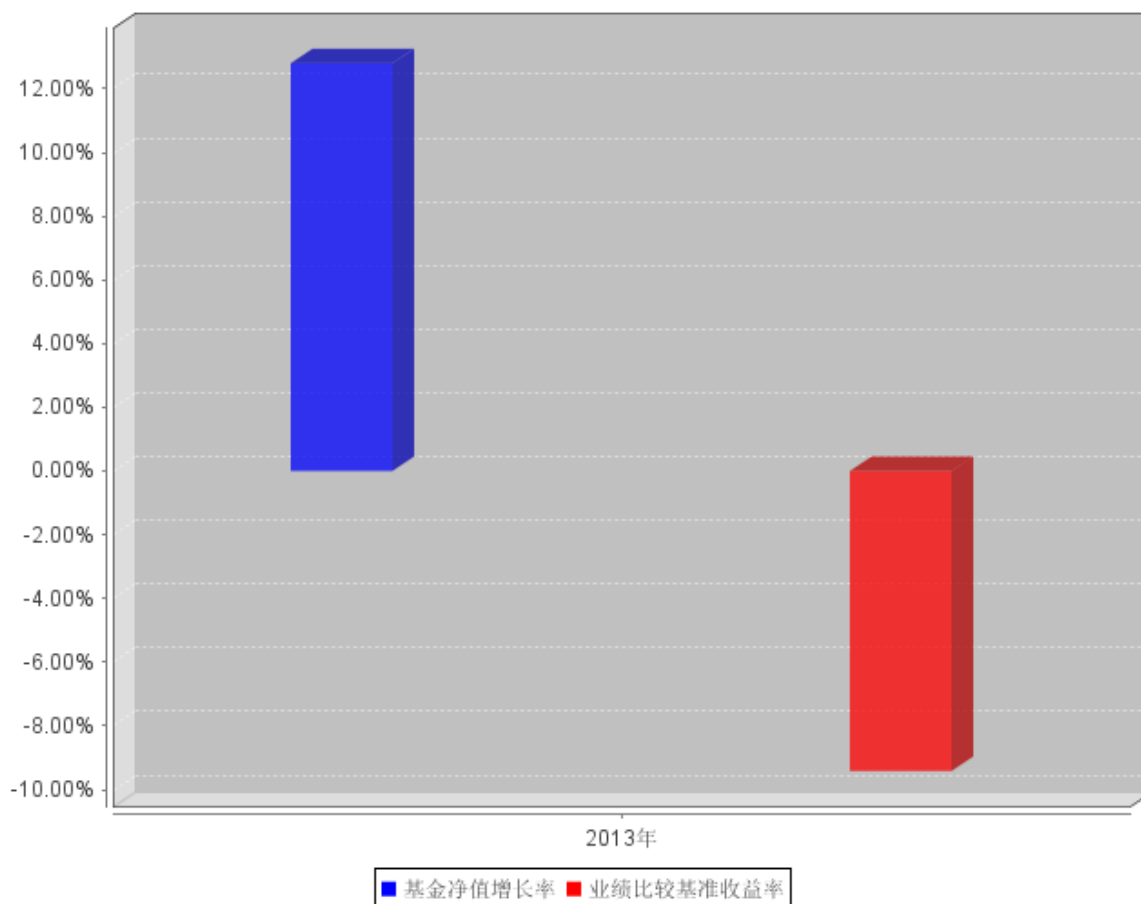
注：1、东吴内需增长混合基金于 2013 年 1 月 30 日成立，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

2、比较基准=60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2013 年 1 月 30 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

## § 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、和而有铮、

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 12 月 31 日，本基金管理人旗下共管理基金 15 只，其中混合型基金 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；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；指数型基金 2 只，为东吴中证新兴产业指数证券投资基金、东吴深证 100 指数增强型（LOF）证券投资基金；债券型基金 3 只，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；货币型基金 1 只，为东吴货币市场证券投资基金。

2013 年，A 股市场呈现出明显的阶段性行情，上证指数呈现出震荡走低的态势。在此背景下，基金公司以创新作为行业发展突破口，为近几年停滞发展的基金带来新的契机。公司按照年初制定的工作思路，紧跟行业创新步伐，以设立专项资产管理子公司为抓手，开展了系列业务创新、产品创新、营销创新工作。各项主营业务及经营情况呈现出良好的局面。

#### 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		
刘元海	本基金基金经理、投资管理部副总经理	2013 年 1 月 30 日	-	9.5 年	博士，同济大学毕业。2004 年 2 月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理等职务；现担任投资管理部副总经理、东吴新产业精选股票基金经理、东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理。
程涛	本基金基金经理、公司总经理助理兼首席投资	2013 年 8 月 1 日	-	10 年	硕士，英国雷丁大学毕业。曾任联合证券有限责任公司投资银行部高级经理，泰信基金

	官				管理有限公司研究员、基金经理助理，农银汇理基金管理有限公司基金经理、投资部总经理；2013年3月加入东吴基金管理有限公司，现任公司总经理助理兼首席投资官、东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理、东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。
薛和斌	本基金基金经理	2013年12月24日	-	7年	硕士，上海交通大学农业经济管理学院专业毕业。2007年1月至2009年5月就职于东方证券股份有限公司，从事证券投资分析，任行业研究员。自2009年5月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、专户投资经理助理、基金经理助理，现担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、刘元海为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理的设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2013 年，全球主要股市步入牛途，美股和日股不仅收复金融危机前的高点，还相继创出历史新高。但是受国内经济增长速度下降，流动性紧张，去杠杆去产能化趋势和 IPO 重启等因素影响，国内 A 股市场反复筑底，上证指数全年下跌 6.75%，连续第四年跑输全球主要股市。全年来看，A 股市场震荡回落，结构极度分化，主题投资盛行。创业板指数大涨 82.73%，中小板指数上涨 17.54%，分行业看传媒大涨 102.56%、计算机大涨 75.72%、通信大涨 45.25%、电子大涨 42.41%、军工大涨

38.9%，成为结构性牛市中闪耀的明星，煤炭、有色、钢铁、房地产等成为了股市的重灾区。

在 2013 年，本基金正确的分析了宏观经济形势和市场的运行节奏，我们判断 A 股市场在 2013 年是以结构性行情为主。自本基金成立以来，坚持成长性投资，在行业配置上重点配置了电子，信息设备，信息服务，化工，食品，医药等行业。因此，本基金取得了较好的投资业绩，基金净值持续获得正增长并跑赢比较基准。

#### 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 1.128 元，累计净值 1.128 元；本报告期份额净值增长率 12.80%，同期业绩比较基准收益率为-9.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断 2014 年上半年经济运行较为平稳，但 2 季度后经济将可能会重新面临衰退；房价和通胀在上半年仍然面临较大压力。流动性方面，去杠杆的过程仍将继续，央行会保持相对较紧的货币政策。IPO 重启后，我们认为股票市场的机会将主要集中在上半年，机会以低估值景气提升的行业和估值合理的成长股为主，A 股市场仍将维持结构性行情的特点。

从投资主线看，我们主要集中于符合转型创新或受益改革的行业，重点关注以下几条主线：

(1) 节能环保行业，看好 LED、光伏和环保行业。(2) 信息消费主题，包括电子、通信设备和移动互联网行业。(3) 国产替代主题，受益去 IOE 的软硬件行业和受益关键零部件国产化的公司以及自主品牌替代进口的公司。(4) 大物流主题，包括冷链和为物流提供信息化服务的公司。(5) 稳定增长型的大健康和大消费类行业，看好医药、食品饮料。(6) 智能化主题，包括智能家居，机器人相关的公司。

本基金将努力为投资者带来好的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在完善公司治理结构、内部控制制度和流程体系的同时，从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益出发，着力增强公司关键业务的风险识别和控制能力，完善内幕交易防控机制；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期与不定期检查、专项稽核等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察重点开展的工作包括：

(1) 加强重点专项稽核深度。随着业务的不断发展，本基金管理人持续梳理业务模式、主要

监管规则、潜在风险点等，全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核，内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(2) 完善内幕交易防控。从制度层面建立完善公司内幕交易防控机制，明确了内幕信息、知情人的识别标准，建立了内幕信息识别和报告工作流程，对知情人登记和保密、相关人员绩效考核和责任追究、投资研究活动记录和档案管理提出相关要求，形成内幕交易防控体系。

(3) 促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强了内部合规培训力度，深化基金从业人员风合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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、运营总监、基金会计、金融工程人员、监察稽核人员等组成，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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

### § 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

2013 年，基金托管人在东吴内需增长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2013 年，东吴基金管理有限公司在东吴内需增长混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013 年，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关东吴内需增长混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天衡审字（2014）00377 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴内需增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的东吴内需增长混合型证券投资基金（以下简称“内需基金”）财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是内需基金的基金管理人东吴基金管

	理有限公司的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,内需基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制,公允反映了内需基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和所有者权益(基金净值)变动分配情况。
注册会计师的姓名	陆德忠 魏娜
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·南京
审计报告日期	2014 年 3 月 18 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:东吴内需增长混合型证券投资基金

报告截止日:2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	15,470,268.17	-
结算备付金		78,045.81	-
存出保证金		70,534.54	-
交易性金融资产	7.4.7.2	53,569,665.00	-



其中：股票投资		47,593,665.00	-
基金投资		-	-
债券投资		5,976,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资			
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	16,888.53	-
应收股利		-	-
应收申购款		52,596.24	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		69,257,998.29	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		167,781.06	-
应付管理人报酬		87,595.72	-
应付托管费		14,599.29	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	20,142.02	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	280,632.32	-
负债合计		570,750.41	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	60,867,929.59	-
未分配利润	7.4.7.10	7,819,318.29	-
所有者权益合计		68,687,247.88	-
负债和所有者权益总计		69,257,998.29	-

注：1. 报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.128 元，基金份额总额 60,867,929.59 份。

2. 本基金于 2013 年 1 月 30 日成立。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴内需增长混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 30 日(基 金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		15,376,648.80	-
1. 利息收入		1,775,010.26	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	639,899.01	-
债券利息收入		212,168.77	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		922,942.48	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,966,065.78	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,523,032.53	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	57,124.38	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	385,908.87	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,098,605.24	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	536,967.52	-
<b>减：二、费用</b>		3,452,081.06	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,950,758.46	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	325,126.47	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	884,406.13	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	291,790.00	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,924,567.74	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,924,567.74	-

注：本基金于 2013 年 1 月 30 日成立。

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴内需增长混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 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）	464,106,738.16	-	464,106,738.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,924,567.74	11,924,567.74
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）	-403,238,808.57	-4,105,249.45	-407,344,058.02
其中：1. 基金申购款	21,255,891.86	970,776.63	22,226,668.49
2. 基金赎回款	-424,494,700.43	-5,076,026.08	-429,570,726.51
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）	60,867,929.59	7,819,318.29	68,687,247.88
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金于 2013 年 1 月 30 日成立。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴内需增长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1035 号《关于核准东吴内需增长混合型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于 2013 年 1 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 464,085,752.61 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金投资组合中股票类投资比例为基金资产的 30%-80%，债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20%-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= 60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。

### 7.4.2 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》、《东吴内需增长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。

### 7.4.3 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况及 2013 年度经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期自 2013 年 1 月 30 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报

酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 收益分配时所发生的银行转账或其它手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
- (3) 本基金收益每年最多分配 8 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；
- (4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- (5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
- (7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

##### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。



### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### 1、印花税

2007 年 5 月 30 日前按照 0.1%的税率缴纳印花税。

经国务院批准，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 0.1%调整为 0.3%。

经国务院批准，财政部、国家税务总局批准，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 0.3%调整为 0.1%。

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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	15,470,268.17	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	15,470,268.17	-

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	42,299,525.84	47,593,665.00	5,294,139.16	
贵金属投资-金交所黄金合约				
债券	交易所市场	6,171,533.92	5,976,000.00	-195,533.92
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,171,533.92	5,976,000.00	-195,533.92
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	48,471,059.76	53,569,665.00	5,098,605.24	

项目	上年度末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,854.71	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	35.20	-
应收债券利息	9,966.90	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.02	-
应收黄金合约拆借孳息		
其他	31.70	-
合计	16,888.53	-

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	20,142.02	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	20,142.02	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	632.32	-
预提审计费	80,000.00	-
预提信息披露费	200,000.00	-
合计	280,632.32	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	464,106,738.16	464,106,738.16
本期申购	21,255,891.86	21,255,891.86
本期赎回(以“-”号填列)	-424,494,700.43	-424,494,700.43
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	60,867,929.59	60,867,929.59

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,825,962.50	5,098,605.24	11,924,567.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,046,355.74	-3,058,893.71	-4,105,249.45
其中：基金申购款	296,128.63	674,648.00	970,776.63
基金赎回款	-1,342,484.37	-3,733,541.71	-5,076,026.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,779,606.76	2,039,711.53	7,819,318.29

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
活期存款利息收入	610,802.88	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	28,276.08	-
其他	820.05	-
合计	639,899.01	-

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
卖出股票成交总额	280,511,680.46	-
减：卖出股票成本总额	272,988,647.93	-
买卖股票差价收入	7,523,032.53	-

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月30日(基金合	2012年1月1日至2012年12月

	同生效日)至2013年12月31日	31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	6,920,794.52	-
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	6,835,194.52	-
减:应收利息总额	28,475.62	-
债券投资收益	57,124.38	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未进行权证投资交易。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未进行其他投资交易。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	385,908.87	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	385,908.87	-

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
1. 交易性金融资产	5,098,605.24	-
——股票投资	5,294,139.16	-
——债券投资	-195,533.92	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	5,098,605.24	-

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
基金赎回费收入	487,536.62	-
其他	0.13	-
转换费	49,430.77	-
合计	536,967.52	-

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
交易所市场交易费用	884,406.13	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	884,406.13	-

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	200,000.00	-
银行汇划费用	390.00	-
其他费用	900.00	-
帐户维护费	10,500.00	-
合计	291,790.00	-

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无需要说明的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无需要说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司	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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	304,344,880.82	51.08%	-	-

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	6,171,533.92	31.01%	-	-

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日



	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东吴证券股份有限公司	700,000,000.00	100.00%	-	-

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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30日(基金合同生效日)至2013年12月31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	270,236.20	50.46%	531.60	2.64%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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

注：1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。  
2、股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金比率是公允，符合证监会有关规定。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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月30日(基金合同生 效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	1,950,758.46
其中：支付销售机构的客 户维护费	140,341.38	-

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	325,126.47	-

注：支付基金托管人交通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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度基金管理人未持有本基金份额。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其它关联方均未持有本基金份额。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	15,470,268.17	610,802.88	-	-

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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/增发而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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
601012	隆基股份	2013 年 12 月 17 日	重大事项停牌	15.41	2014 年 1 月 13 日	14.78	91,500	1,262,268.29	1,410,015.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在充分控制基金资产风险的前提下，主要投资于受益于国家内需增长政策导向且具有竞争优势的上市公司，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益，力争实现基金资产的长期稳定增值。本基金以研究受益于国家内需增长政策导向且具有竞争优势的上市公司为核心，通

过定量和定性相结合的方法构建投资组合。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由监察稽核部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。监察稽核部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。报告期内，本基金持有的金融资产均未发生逾期与减值的情况。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。本基金的银行存款存放于本基金的托管行—交通银行股份有限公司。本基金认为与交通银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 40%。

除卖出回购金融资产款合同约定到期日均为一个月以内计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	15,470,268.17	-	-	-	-	-	15,470,268.17
清算备付金	78,045.81	-	-	-	-	-	78,045.81
存出保证金	70,534.54	-	-	-	-	-	70,534.54

交易性金融资产			-5,976,000.00			-47,593,665.00	53,569,665.00
衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收证券清算款							
应收利息						16,888.53	16,888.53
应收股利							
应收申购款						52,596.24	52,596.24
其他资产							
资产总计	15,618,848.52		-5,976,000.00			-47,663,149.77	69,257,998.29
负债							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款							
应付赎回款						167,781.06	167,781.06
应付管理人报酬						87,595.72	87,595.72
应付托管费						14,599.29	14,599.29
应付销售服务费							
应付交易费用						20,142.02	20,142.02
应交税费							
应付利息							
应付利润							
其他负债						280,632.32	280,632.32
负债总计						570,750.41	570,750.41
利率敏感度缺口	15,618,848.52		-5,976,000.00			-47,092,399.36	68,687,247.88
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
负债							

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。			
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。			
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		<table border="1"> <thead> <tr> <th>本期末（2013 年 12 月 31 日）</th> <th>上年度末（2012 年 12 月 31 日）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	本期末（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
本期末（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）			

	利率下降 25 个基点	13,600.00	-
	利率上升 25 个基点	-13,600.00	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	47,593,665.00	69.29	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,593,665.00	69.29	-	-

注：本基金的投资组合比例为：股票类资产投资比例为基金资产的 30%–80%，其中，投资于受益于内需增长行业中的上市公司股票的比例不低于股票资产的 80%；债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20–70%；其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准	
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2013 年 12 月）      上年度末（2012 年 12 月）

		31 日 )	31 日 )
	1. 业绩基准下跌 1%	-527,700.00	-
	2. 业绩基准下跌 5%	-2,638,300.00	
	3. 业绩基准下跌 10%	-5,276,600.00	

注：报告期内，本基金 beta 值为 0.77。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	47,593,665.00	68.72
	其中：股票	47,593,665.00	68.72
2	固定收益投资	5,976,000.00	8.63
	其中：债券	5,976,000.00	8.63
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,548,313.98	22.45
7	其他各项资产	140,019.31	0.20
8	合计	69,257,998.29	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	41,975,640.00	61.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-



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	3,783,975.00	5.51
J	金融业	-	-
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	954,000.00	1.39
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	880,050.00	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,593,665.00	69.29

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600703	三安光电	200,000	4,958,000.00	7.22
2	002415	海康威视	150,000	3,447,000.00	5.02
3	600872	中炬高新	260,000	2,956,200.00	4.30
4	002241	歌尔声学	70,000	2,455,600.00	3.58
5	600867	通化东宝	160,000	2,449,600.00	3.57
6	300128	锦富新材	160,000	2,051,200.00	2.99
7	002063	远光软件	100,000	1,945,000.00	2.83
8	002185	华天科技	160,000	1,761,600.00	2.56
9	000915	山大华特	50,000	1,535,500.00	2.24
10	601012	隆基股份	91,500	1,410,015.00	2.05
11	300115	长盈精密	36,700	1,385,425.00	2.02
12	000525	红太阳	90,000	1,350,000.00	1.97
13	000063	中兴通讯	100,000	1,307,000.00	1.90
14	300303	聚飞光电	60,000	1,200,600.00	1.75
15	002309	中利科技	70,000	1,169,000.00	1.70
16	002064	华峰氨纶	120,000	1,093,200.00	1.59

17	000538	云南白药	10,000	1,019,900.00	1.48
18	300347	泰格医药	15,000	954,000.00	1.39
19	002507	涪陵榨菜	25,000	945,000.00	1.38
20	600498	烽火通信	60,000	924,000.00	1.35
20	000581	威孚高科	30,000	924,000.00	1.35
21	000553	沙隆达 A	80,000	916,000.00	1.33
22	300334	津膜科技	30,000	909,000.00	1.32
23	300244	迪安诊断	15,000	880,050.00	1.28
24	002465	海格通信	40,000	831,200.00	1.21
25	601965	中国汽研	60,000	804,000.00	1.17
26	300155	安居宝	40,000	794,800.00	1.16
27	600887	伊利股份	20,000	781,600.00	1.14
28	002364	中恒电气	60,000	746,400.00	1.09
29	600637	百视通	20,000	739,400.00	1.08
30	300203	聚光科技	40,000	652,400.00	0.95
31	002104	恒宝股份	40,000	606,400.00	0.88
32	002317	众生药业	30,000	591,000.00	0.86
33	300075	数字政通	15,000	562,500.00	0.82
34	300183	东软载波	17,500	537,075.00	0.78

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	19,414,245.83	28.26
2	600030	中信证券	15,039,546.31	21.90
3	600522	中天科技	9,468,555.20	13.79
4	002063	远光软件	8,252,096.48	12.01
5	601788	光大证券	8,161,031.46	11.88
6	601318	中国平安	7,949,781.00	11.57
7	002005	德豪润达	7,258,405.97	10.57
8	600369	西南证券	6,425,075.16	9.35
9	600000	浦发银行	6,079,370.31	8.85
10	600276	恒瑞医药	5,982,305.28	8.71
11	601601	中国太保	5,962,635.22	8.68

12	000063	中兴通讯	5,825,481.33	8.48
13	300088	长信科技	5,616,307.44	8.18
14	600352	浙江龙盛	5,489,052.60	7.99
15	600104	上汽集团	5,417,137.06	7.89
16	300270	中威电子	5,156,322.92	7.51
17	002138	顺络电子	4,863,707.85	7.08
18	600048	保利地产	4,724,430.23	6.88
19	600016	民生银行	4,712,420.00	6.86
20	000625	长安汽车	4,613,574.98	6.72
21	002415	海康威视	4,429,203.17	6.45
22	000917	电广传媒	4,227,987.89	6.16
23	600867	通化东宝	4,190,292.96	6.10
24	300291	华录百纳	3,963,231.82	5.77
25	600585	海螺水泥	3,953,199.84	5.76
26	600872	中炬高新	3,898,049.83	5.68
27	002185	华天科技	3,847,945.89	5.60
28	600703	三安光电	3,828,426.13	5.57
29	000731	四川美丰	3,817,626.47	5.56
30	000725	京东方A	3,798,000.00	5.53
31	002140	东华科技	3,721,523.41	5.42
32	000800	一汽轿车	3,699,342.91	5.39
33	002064	华峰氨纶	3,403,143.76	4.95
34	002106	莱宝高科	3,327,448.29	4.84
35	002450	康得新	3,275,514.50	4.77
36	600261	阳光照明	3,262,125.23	4.75
37	002317	众生药业	3,104,706.70	4.52
38	300303	聚飞光电	2,943,816.60	4.29
39	601377	兴业证券	2,881,250.00	4.19
40	601688	华泰证券	2,803,960.24	4.08
41	002148	北纬通信	2,648,631.31	3.86
42	600498	烽火通信	2,637,125.50	3.84
43	002241	歌尔声学	2,610,483.58	3.80
44	300115	长盈精密	2,497,287.00	3.64
45	000423	东阿阿胶	2,484,411.80	3.62
46	002313	日海通讯	2,476,055.00	3.60
47	002273	水晶光电	2,460,706.40	3.58

48	600161	天坛生物	2,457,431.00	3.58
49	002440	闰土股份	2,455,281.68	3.57
50	300241	瑞丰光电	2,326,557.09	3.39
51	000776	广发证券	2,082,000.00	3.03
52	000002	万科A	2,081,434.22	3.03
53	002292	奥飞动漫	2,055,921.95	2.99
54	300310	宜通世纪	1,986,242.55	2.89
55	600571	信雅达	1,910,554.01	2.78
56	002049	同方国芯	1,832,140.46	2.67
57	002104	恒宝股份	1,811,976.34	2.64
58	600570	恒生电子	1,761,443.16	2.56
59	300128	锦富新材	1,718,685.00	2.50
60	002161	远望谷	1,572,711.30	2.29
61	000915	山大华特	1,547,462.80	2.25
62	000525	红太阳	1,543,601.77	2.25
63	601012	隆基股份	1,517,481.00	2.21
64	000970	中科三环	1,479,282.00	2.15
65	000024	招商地产	1,469,728.83	2.14
66	002469	三维工程	1,462,667.00	2.13
67	300155	安居宝	1,395,682.00	2.03
68	000999	华润三九	1,392,598.40	2.03
69	600778	友好集团	1,385,864.47	2.02
70	002146	荣盛发展	1,379,628.87	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	19,190,770.12	27.94
2	600030	中信证券	14,745,675.98	21.47
3	600522	中天科技	10,056,137.14	14.64
4	601788	光大证券	8,023,751.75	11.68
5	002005	德豪润达	7,681,174.09	11.18
6	601318	中国平安	7,474,034.56	10.88

7	002063	远光软件	6,788,663.77	9.88
8	600276	恒瑞医药	6,681,039.71	9.73
9	600369	西南证券	6,613,572.27	9.63
10	600000	浦发银行	6,514,286.88	9.48
11	600352	浙江龙盛	6,271,780.00	9.13
12	601601	中国太保	5,786,364.64	8.42
13	300088	长信科技	5,386,063.52	7.84
14	600104	上汽集团	5,317,465.00	7.74
15	300270	中威电子	5,051,710.30	7.35
16	600016	民生银行	4,752,730.83	6.92
17	002138	顺络电子	4,623,105.38	6.73
18	600048	保利地产	4,557,783.30	6.64
19	000917	电广传媒	4,514,763.05	6.57
20	300291	华录百纳	4,406,013.00	6.41
21	000731	四川美丰	4,285,817.80	6.24
22	000063	中兴通讯	4,218,093.50	6.14
23	000625	长安汽车	4,089,025.74	5.95
24	600585	海螺水泥	3,984,928.55	5.80
25	000725	京东方A	3,554,000.00	5.17
26	002440	闰土股份	3,487,126.83	5.08
27	000800	一汽轿车	3,476,098.86	5.06
28	002140	东华科技	3,462,177.35	5.04
29	600872	中炬高新	3,299,126.76	4.80
30	600261	阳光照明	3,262,147.90	4.75
31	002106	莱宝高科	3,230,289.72	4.70
32	002064	华峰氨纶	3,212,427.51	4.68
33	600867	通化东宝	3,201,604.07	4.66
34	002450	康得新	3,192,663.89	4.65
35	002185	华天科技	2,996,487.00	4.36
36	601688	华泰证券	2,951,547.00	4.30
37	002148	北纬通信	2,728,205.20	3.97
38	002313	日海通讯	2,712,561.64	3.95
39	601377	兴业证券	2,635,960.14	3.84
40	600161	天坛生物	2,535,239.70	3.69
41	002317	众生药业	2,460,977.60	3.58
42	002292	奥飞动漫	2,354,624.86	3.43
43	002273	水晶光电	2,311,288.30	3.36
44	300310	宜通世纪	2,179,940.63	3.17

45	600571	信雅达	2,161,473.44	3.15
46	000423	东阿阿胶	2,146,939.20	3.13
47	300241	瑞丰光电	2,124,762.35	3.09
48	600570	恒生电子	2,109,126.64	3.07
49	300303	聚飞光电	2,101,168.11	3.06
50	000002	万科A	2,051,186.10	2.99
51	000776	广发证券	1,994,307.30	2.90
52	002049	同方国芯	1,872,106.43	2.73
53	002415	海康威视	1,657,600.74	2.41
54	002161	远望谷	1,589,200.00	2.31
55	600498	烽火通信	1,553,264.00	2.26
56	000970	中科三环	1,552,602.86	2.26
57	000024	招商地产	1,434,565.88	2.09
58	002469	三维工程	1,430,517.15	2.08
59	002091	江苏国泰	1,425,291.26	2.08
60	300115	长盈精密	1,420,788.56	2.07
61	600332	白云山	1,407,974.63	2.05
62	600778	友好集团	1,377,146.95	2.00

注：本项的“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。

#### 8.4.3 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	315,288,173.77
卖出股票收入（成交）总额	280,511,680.46

注：本项的“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。

#### 8.5 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	5,976,000.00	8.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-

9	合计	5,976,000.00	8.70
---	----	--------------	------

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	112054	11 鄂能债	60,000	5,976,000.00	8.70

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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	70,534.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,888.53
5	应收申购款	52,596.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,019.31

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601012	隆基股份	1,410,015.00	2.05	重大事项停牌

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
494	123,214.43	40,007,000.00	65.73%	20,860,929.59	34.27%



## 9.2 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	890,211.49	1.4625%

注：高管持有本基金份额为 50 至 100 万份之间，本基金经理本期末未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 1 月 30 日）基金份额总额	464,106,738.16
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	21,255,891.86
减：本报告期基金总赎回份额	424,494,700.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,867,929.59

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为江苏天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2012 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 80000 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
东吴证券	2	304,344,880.82	51.08%	270,236.20	50.46%	-
华鑫证券	1	199,779,264.25	33.53%	181,879.16	33.96%	-
华创证券	1	91,675,709.16	15.39%	83,461.62	15.58%	-

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

本基金本报告期增加 4 个交易单元，分别为东吴证券 2 个，华创证券 1 个，华鑫证券 1 个。

## 11.7.2 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
东吴证券	6,171,533.92	31.01%	700,000,000.00	100.00%	-	-
华鑫证券	13,727,513.42	68.99%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴内需增长混合型证券投资基金增加中国农业银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013年1月8日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴内需增长混合型证券投资基金增加中国银河证券股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013年1月9日
3	东吴内需增长混合基金合同生效公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013年1月31日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年2月22日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年2月23日
6	东吴基金管理有限公司关于设立上海新东吴优胜资产管理有限公司的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年2月26日

7	东吴基金管理有限公司关于东吴内需增长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013年3月5日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴内需增长混合型证券投资基金参加部分代销机构网上交易和定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013年3月5日
9	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年3月12日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴内需增长混合基金在中国农业银行股份有限公司推出定期定额业务及转换业务的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013年3月12日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年3月26日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海天天基金销售有限公司网上申购费率及定投申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年3月26日
13	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013年3月29日
14	东吴基金管理有限公司关于赎回固有资金所投资旗下部分基金的	上海证券报、中国证券报、证券时报、证	2013年3月30日

	公告	券日报、公司网站	
15	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 4 月 13 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 4 月 17 日
17	东吴内需增长混合型证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 4 月 22 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 4 月 25 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 5 月 29 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 6 月 15 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 6 月 26 日
22	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 6 月 27 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 7 月 2 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下	上海证券报、中国证	2013 年 7 月 11 日

	基金参与杭州数米基金销售有限公司和上海天天基金销售有限公司基金转换申购补差费率优惠活动的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站	
25	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 7 月 11 日
26	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在杭州数米基金销售有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 7 月 11 日
27	东吴内需增长混合型证券投资基金 2013 年第 2 季度报告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 7 月 18 日
28	东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 8 月 1 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 8 月 15 日
30	东吴基金关于旗下基金在诺亚正行申购费率及定投申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 8 月 20 日
31	东吴内需增长混合型证券投资基金 2013 年半年度报告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 8 月 29 日
32	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增和讯为代销机构并推出定期定额及转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 9 月 10 日
33	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在和讯申购费率及定投申购	上海证券报、中国证券报、证券时报、证	2013 年 9 月 10 日

	费率优惠的公告	券日报、公司网站	
34	东吴内需增长混合型证券投资基金招募说明书更新及摘要	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 9 月 12 日
35	东吴基金管理有限公司关于苏州分公司成立的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 10 月 22 日
36	东吴内需增长混合型证券投资基金 2013 年第 3 季度报告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 10 月 23 日
37	东吴基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浙江同花顺基金销售有限公司开展的双十一基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2013 年 11 月 7 日
38	东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2013 年 12 月 24 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴内需增长混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴内需增长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴内需增长混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司  
2014年3月29日