

东吴新经济股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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:中国建设银行股份有限公司

重要提示:基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

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,也不保证基金份额持有人的资产不受损失...

Table 2.1 基金基本情况: 基金名称: 东吴新经济股票; 基金代码: 580006; 交易代码: 580006; 基金运作方式: 契约型开放式...

投资策略: 本基金为股票型基金,通过投资于中国经济发展未来方向的新兴行业的上市公司,享受中国经济发展带来的高成长和高风险...

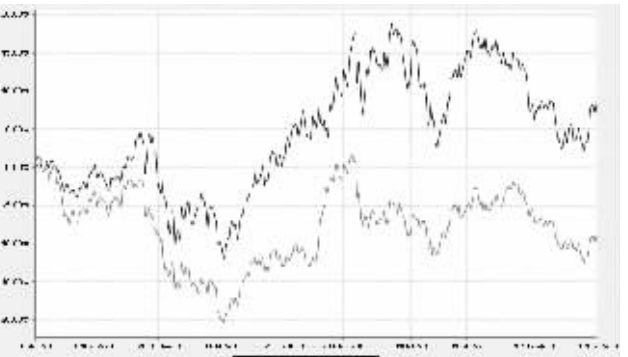
风险收益特征: 75%*沪深300指数+25%*中债综合全价指数; 本基金是一只进行主动投资的股票型基金...

Table 2.2 基金管理人及基金托管人: 基金管理人: 东吴基金管理有限公司; 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司...

Table 2.3 主要会计数据和财务指标: 报告期(2011年1月1日至2011年6月30日); 本期已实现收益: 25,973,487.95...

Table 2.4 基金投资组合报告: 截至2011年6月30日,本基金持有的股票市值为人民币446,884,473.99元,持仓集中度: 前十大重仓股市值占基金资产净值的比例为38.48%

Table 2.5 业绩比较基准: 东吴新经济股票型证券投资基金业绩比较基准: 75%*沪深300指数+25%*中债综合全价指数...



注:本基金自2009年12月30日成立,自基金合同生效后起6个月内为建仓期,建仓期结束后基金投资组合比例符合基金合同的相关规定...

Table 2.6 基金管理人及基金托管人: 基金管理人: 东吴基金管理有限公司; 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司...

4.1 基金管理人及基金托管人: 基金管理人: 东吴基金管理有限公司; 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司...

Table 2.7 基金投资组合报告: 截至2011年6月30日,本基金持有的股票市值为人民币446,884,473.99元,持仓集中度: 前十大重仓股市值占基金资产净值的比例为38.48%

注: 1.任姓先生为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金合同生效日,其它任职日期和离职日期均指公司作出决定之日...

4.3 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明: 本报告期,本基金管理人严格按照法律法规及公平交易的相关制度,严格执行公司公平交易管理制度...

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析: 2011年上半年,居民消费价格指数CPI的走势略超出市场预期,而且宏观经济增长速度的放缓,央行果断采取了提高准备金率加力的紧缩政策...

4.6 管理人对于报告期内基金份额持有人权益保护的专项说明: 本报告期,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法规...

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明: 本报告期,本基金管理人严格按照法律法规及基金合同的规定,严格执行公司公平交易管理制度...

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守法律法规情况: 本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定...

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: 本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核...

Table 6.1 资产负债表: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 资产总计: 392,202,015.35; 负债总计: 11,695,084.78; 所有者权益合计: 380,506,930.57...

Table 6.2 利润表: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 营业收入: 457,925.78; 营业费用: 211,383.78; 利润总额: 246,542.00; 净利润: 182,523.81...

Table 6.3 所有者权益变动表: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 实收基金: 350,619,999.63; 未分配利润: 29,886,930.94; 所有者权益合计: 380,506,930.57...

Table 6.4 现金流量表: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 经营活动产生的现金流量净额: 29,678,560.29; 投资活动产生的现金流量净额: 2,146,128.04; 筹资活动产生的现金流量净额: -10,999,023.06...

Table 6.5 所有者权益变动表: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 实收基金: 350,619,999.63; 未分配利润: 29,886,930.94; 所有者权益合计: 380,506,930.57...

Table 6.6 费用明细: 项目: 1.销售费用 495,396.16; 2.管理费用 558,389.35; 3.托管费用 160,308.49; 4.其他费用 207,910.61...

Table 6.7 基金份额持有人户数及持有基金份额情况: 报告期末: 2011年6月30日; 基金总份额: 380,506,930.57份; 基金份额持有人户数: 11,123户; 持有基金份额: 400,696,463.46份...

Table 6.8 基金管理人及基金托管人: 基金管理人: 东吴基金管理有限公司; 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司...

注: 1.如本报告期间发生转换入、红利再投资、则总申购份额中包含该业务份额; 2.如本报告期间发生转出业务,则总赎回份额中包含该业务份额。

在其派发股息、红利收入和利息收入时扣代扣代缴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;

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系方发生变化的情况: 本报告期基金关联方未发生变化...

Table 6.4.7.1 关联方关系: 关联方名称: 东吴证券股份有限公司; 基金管理人: 东吴证券股份有限公司; 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司...

Table 6.4.8.1 关联交易: 6.4.8.1.1 股票交易: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 关联方名称: 东吴证券股份有限公司; 成交金额: 120,867,852.28; 占当期股票成交总额的比例: 34.42%

Table 6.4.8.1.2 债券回购交易: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 关联方名称: 东吴证券股份有限公司; 成交金额: 370,409.95; 占当期债券回购成交总额的比例: 36.55%

Table 6.4.8.1.3 支付关联方的佣金: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 关联方名称: 东吴证券股份有限公司; 佣金金额: 99,366.78; 占当期佣金总额的比例: 34.18%

注: 上述数据按市场佣金计算,扣除券商需承担的费用,包括但不限于交易经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买/卖“证券管理”等,管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券研究报告和信息服务。

Table 6.4.8.2 基金管理人: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 项目: 当期发生的基础费用: 495,396.16; 当期发生的其他费用: 29,886,930.94...

Table 6.4.8.2.1 基金管理人: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 项目: 当期发生的基础费用: 495,396.16; 当期发生的其他费用: 29,886,930.94...

Table 6.4.8.2.2 基金托管人: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 项目: 当期发生的基础费用: 160,308.49; 当期发生的其他费用: 207,910.61...

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以外的其他关联方投资本基金的情况: 本报告期末未持有本基金份额...

Table 6.4.8.5 由关联方管理的银行存款余额及当期产生的利息收入: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 关联方名称: 中国建设银行股份有限公司; 期末存款余额: 117,734,833.35; 当期利息收入: 596,064.04...

Table 6.4.9.1 债券回购: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 项目: 报告期末持有的债券回购余额: 117,734,833.35; 占当期债券回购余额的比例: 10.1%

Table 7 投资组合报告: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 股票代码: 000030; 股票名称: 铜陵有色; 数量(股): 808,000; 公允价值: 36,295,360.00...

Table 7.1 期末基金资产组合情况: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 项目: 权益投资; 金额: 361,300,627.09; 占基金资产净值的比例(%) : 92.12%

Table 7.2 期末按行业分类的股票投资组合: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 代码: A; 行业名称: 农林牧渔; 金额: --; 占基金资产净值的比例(%) : --

Table 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: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 股票代码: 000258; 股票名称: 天立科技; 数量(股): 808,000; 公允价值: 36,295,360.00...

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应登陆载于www.sfdm.com.cn的半年度报告正文。

Table 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: 序号: 1; 股票代码: 000030; 股票名称: 铜陵有色; 本期累计买入金额: 21,037,474.20; 占期初基金资产净值的比例(%) : 4.65%

Table 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: 序号: 1; 股票代码: 600000; 股票名称: 浦发银行; 本期累计卖出金额: 15,942,021.69; 占期初基金资产净值的比例(%) : 3.52%

注:本项的“买入金额”按买入成交金额/成交均价乘以成交数量/买入数量计算,不考虑相关交易费用。

Table 7.5 期末股票组合: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 股票代码: 002081; 股票名称: 金耀辉; 数量(股): 21,777,813.80; 公允价值: 170,989,978.26...

注:本项的“卖出金额”按卖出成交金额/成交均价乘以成交数量/卖出数量计算,不考虑相关交易费用。

Table 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 债券代码: 1100170; 债券名称: 10国债07; 数量(张): 100,000; 公允价值: 9,726,000.00...

注:本项的“买入股票”按买入成交金额/成交均价乘以成交数量/买入数量计算,不考虑相关交易费用。

Table 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 资产支持证券代码: 1001010; 资产支持证券名称: 10国债07; 数量(张): 100,000; 公允价值: 9,726,000.00...

Table 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 权证代码: 1101016; 权证名称: 11国债16; 数量(张): 100,000; 公允价值: 9,640,000.00...

Table 7.9 投资组合报告附注: 7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形...

Table 7.9.3 期末其他各项资产构成: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 资产名称: 1.存保证金; 金额: --; 占基金资产净值的比例(%) : --

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细: 本报告期末未持有处于转股期的可转换债券; 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明: 本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况...

Table 8 基金份额持有人信息: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 持有基金份额的基金份额持有人户数: 11,123户; 持有基金份额: 400,696,463.46份...

Table 9 开放式基金份额变动: 报告期末: 2009年12月30日; 单位:人民币元; 项目: 基金合同生效日; 基金份额: 800,855,129.16; 本报告期间基金总申购: 392,786,221.20; 本报告期间基金总赎回: 140,104,120.56...

注: 1.如本报告期间发生转换入、红利再投资,则总申购份额中包含该业务份额; 2.如本报告期间发生转出业务,则总赎回份额中包含该业务份额。

Table 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; 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: 本报告期,基金管理人、基金托管人未发生重大人事变动...

Table 10.3 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 案由: 合同纠纷; 金额: --; 占基金资产净值的比例(%) : --

Table 10.7 基金租用证券公司交易单元的情况: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 券商名称: 东吴证券; 交易单元数量: 2; 成交金额: 120,867,852.28; 占当期股票成交总额的比例: 34.42%

Table 11 影响投资决策的其他重要信息: 报告期末: 2011年6月30日; 单位:人民币元; 序号: 1; 事项: 无; 影响程度: 无