

东吴行业轮动股票型证券投资基金

2011年度 报告摘要

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年三月二十七日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、基金管理人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。
东吴基金管理有限公司(以下简称“华夏银行”)根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》,于2012年3月26日编制了本报告中的财务数据、净值和业绩情况,并经会计师事务所审计,会计师事务所出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意投资风险,基金的投资风险可能高于普通股票型基金,基金过往业绩并不预示其未来表现,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更新。

2.1 基金基本情况
基金名称:东吴行业轮动股票
基金代码:580003
交易代码:580003
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年4月23日
基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
截至报告期末基金资产净值:3,446,840,965.51份
基金合同存续期:不定期

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金为股票型基金,通过行业轮动策略的把握,重点投资于预期收益较高的行业,并重点投资于具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略:本基金采取自上而下策略,根据宏观经济、政策和证券市场趋势的综合分析,确定基金资产在股票、债券、货币和现金之间的配置比例,采取行业轮动策略,在行业轮动中,根据行业景气度、估值、盈利能力和成长性等因素,对行业进行配置,减少预期收益和风险的行业配置,对于预期收益高、重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票,追求超越业绩比较基准。

2.3 基金管理人、基金托管人
名称:东吴基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
姓名:董建平
基金托管人:董建平
联系电话:021-50509888-8219
基金托管人:010-85218667
电子信箱:huangzhibin@fund.com.cn
基金托管人:zhangyong@hhb.com.cn
客户服务电话:021-50509888-8211
基金托管人:010-85218680

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
本期比上年同期增减
本期比上年同期增减
本期比上年同期增减

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的对比
3.2.2 基金净值表现
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对比

3.3 基金业绩比较基准
东吴行业轮动股票型证券投资基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+沪深300指数收益率*25%+中信标普全债指数收益率*75%+沪深300指数收益率*25%+中信标普全债指数收益率*75%

3.4 基金管理人及基金托管人
3.4.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
3.4.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况
3.4.3 基金管理人及基金托管人的内部控制制度

3.5 基金投资策略
3.5.1 资产配置策略
3.5.2 行业配置策略
3.5.3 个股选择策略

3.6 基金业绩
3.6.1 基金业绩
3.6.2 基金业绩
3.6.3 基金业绩

3.7 基金费用
3.7.1 基金费用
3.7.2 基金费用
3.7.3 基金费用

3.8 基金风险
3.8.1 基金风险
3.8.2 基金风险
3.8.3 基金风险

3.9 基金管理人
3.9.1 基金管理人
3.9.2 基金管理人
3.9.3 基金管理人

3.10 基金托管人
3.10.1 基金托管人
3.10.2 基金托管人
3.10.3 基金托管人

3.11 基金销售
3.11.1 基金销售
3.11.2 基金销售
3.11.3 基金销售

3.12 基金投资
3.12.1 基金投资
3.12.2 基金投资
3.12.3 基金投资

3.13 基金业绩
3.13.1 基金业绩
3.13.2 基金业绩
3.13.3 基金业绩

3.14 基金费用
3.14.1 基金费用
3.14.2 基金费用
3.14.3 基金费用

3.15 基金风险
3.15.1 基金风险
3.15.2 基金风险
3.15.3 基金风险

3.16 基金管理人
3.16.1 基金管理人
3.16.2 基金管理人
3.16.3 基金管理人

3.17 基金托管人
3.17.1 基金托管人
3.17.2 基金托管人
3.17.3 基金托管人

3.18 基金销售
3.18.1 基金销售
3.18.2 基金销售
3.18.3 基金销售

3.19 基金投资
3.19.1 基金投资
3.19.2 基金投资
3.19.3 基金投资

3.20 基金业绩
3.20.1 基金业绩
3.20.2 基金业绩
3.20.3 基金业绩

3.21 基金费用
3.21.1 基金费用
3.21.2 基金费用
3.21.3 基金费用

2011年12月31日
债券投资 63,100,000.00
资产支持证券投资 239,136,413.30
衍生金融资产 0.00
买入返售金融资产 18,357,673.82
应收货币摊款 1,456,461.97
3,428,334.29
应收利息 1,177,649.98
18,849,984.46
其他资产 2,546,251.0365
3,019,746,521.59

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
7.4.5.2 会计估计变更的说明
7.4.5.3 差错更正的说明
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,由原来的0.1%调整为0.1%。经国务院批准,财政部、国家税务总局公告,自2008年1月1日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原来的0.1%调整为0.1%。经国务院批准,财政部、国家税务总局公告,自2008年1月1日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原来的0.1%调整为0.1%。

7.4.6 关联方关系
关联方名称:东吴基金管理有限公司
关联方名称:华夏银行股份有限公司
关联方名称:东吴证券股份有限公司
关联方名称:东吴基金管理有限公司
关联方名称:东吴证券股份有限公司
关联方名称:东吴基金管理有限公司

7.4.7 关联方交易
7.4.7.1 关联方交易
7.4.7.2 关联方交易
7.4.7.3 关联方交易
7.4.7.4 关联方交易
7.4.7.5 关联方交易

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.8.1.1 股票交易
7.4.8.1.2 债券交易
7.4.8.1.3 债券买卖
7.4.8.1.4 债券回购

7.4.8.2 关联方交易
7.4.8.2.1 关联方交易
7.4.8.2.2 关联方交易
7.4.8.2.3 关联方交易
7.4.8.2.4 关联方交易

7.4.8.3 关联方交易
7.4.8.3.1 关联方交易
7.4.8.3.2 关联方交易
7.4.8.3.3 关联方交易
7.4.8.3.4 关联方交易

7.4.8.4 关联方交易
7.4.8.4.1 关联方交易
7.4.8.4.2 关联方交易
7.4.8.4.3 关联方交易
7.4.8.4.4 关联方交易

7.4.8.5 关联方交易
7.4.8.5.1 关联方交易
7.4.8.5.2 关联方交易
7.4.8.5.3 关联方交易
7.4.8.5.4 关联方交易

7.4.8.6 关联方交易
7.4.8.6.1 关联方交易
7.4.8.6.2 关联方交易
7.4.8.6.3 关联方交易
7.4.8.6.4 关联方交易

7.4.8.7 关联方交易
7.4.8.7.1 关联方交易
7.4.8.7.2 关联方交易
7.4.8.7.3 关联方交易
7.4.8.7.4 关联方交易

7.4.8.8 关联方交易
7.4.8.8.1 关联方交易
7.4.8.8.2 关联方交易
7.4.8.8.3 关联方交易
7.4.8.8.4 关联方交易

7.4.8.9 关联方交易
7.4.8.9.1 关联方交易
7.4.8.9.2 关联方交易
7.4.8.9.3 关联方交易
7.4.8.9.4 关联方交易

7.4.8.10 关联方交易
7.4.8.10.1 关联方交易
7.4.8.10.2 关联方交易
7.4.8.10.3 关联方交易
7.4.8.10.4 关联方交易

7.4.8.11 关联方交易
7.4.8.11.1 关联方交易
7.4.8.11.2 关联方交易
7.4.8.11.3 关联方交易
7.4.8.11.4 关联方交易

7.4.8.12 关联方交易
7.4.8.12.1 关联方交易
7.4.8.12.2 关联方交易
7.4.8.12.3 关联方交易
7.4.8.12.4 关联方交易

7.4.8.13 关联方交易
7.4.8.13.1 关联方交易
7.4.8.13.2 关联方交易
7.4.8.13.3 关联方交易
7.4.8.13.4 关联方交易

7.4.8.14 关联方交易
7.4.8.14.1 关联方交易
7.4.8.14.2 关联方交易
7.4.8.14.3 关联方交易
7.4.8.14.4 关联方交易

7.4.8.15 关联方交易
7.4.8.15.1 关联方交易
7.4.8.15.2 关联方交易
7.4.8.15.3 关联方交易
7.4.8.15.4 关联方交易

7.4.8.16 关联方交易
7.4.8.16.1 关联方交易
7.4.8.16.2 关联方交易
7.4.8.16.3 关联方交易
7.4.8.16.4 关联方交易

7.4.8.17 关联方交易
7.4.8.17.1 关联方交易
7.4.8.17.2 关联方交易
7.4.8.17.3 关联方交易
7.4.8.17.4 关联方交易

7.4.8.18 关联方交易
7.4.8.18.1 关联方交易
7.4.8.18.2 关联方交易
7.4.8.18.3 关联方交易
7.4.8.18.4 关联方交易

7.4.8.19 关联方交易
7.4.8.19.1 关联方交易
7.4.8.19.2 关联方交易
7.4.8.19.3 关联方交易
7.4.8.19.4 关联方交易

7.4.8.20 关联方交易
7.4.8.20.1 关联方交易
7.4.8.20.2 关联方交易
7.4.8.20.3 关联方交易
7.4.8.20.4 关联方交易

7.4.8.21 关联方交易
7.4.8.21.1 关联方交易
7.4.8.21.2 关联方交易
7.4.8.21.3 关联方交易
7.4.8.21.4 关联方交易

7.4.8.22 关联方交易
7.4.8.22.1 关联方交易
7.4.8.22.2 关联方交易
7.4.8.22.3 关联方交易
7.4.8.22.4 关联方交易

7.4.8.23 关联方交易
7.4.8.23.1 关联方交易
7.4.8.23.2 关联方交易
7.4.8.23.3 关联方交易
7.4.8.23.4 关联方交易

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
7.4.5.2 会计估计变更的说明
7.4.5.3 差错更正的说明

7.4.6 关联方关系
关联方名称:东吴基金管理有限公司
关联方名称:华夏银行股份有限公司
关联方名称:东吴证券股份有限公司
关联方名称:东吴基金管理有限公司
关联方名称:东吴证券股份有限公司
关联方名称:东吴基金管理有限公司

7.4.7 关联方交易
7.4.7.1 关联方交易
7.4.7.2 关联方交易
7.4.7.3 关联方交易
7.4.7.4 关联方交易
7.4.7.5 关联方交易

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.8.1.1 股票交易
7.4.8.1.2 债券交易
7.4.8.1.3 债券买卖
7.4.8.1.4 债券回购

7.4.8.2 关联方交易
7.4.8.2.1 关联方交易
7.4.8.2.2 关联方交易
7.4.8.2.3 关联方交易
7.4.8.2.4 关联方交易

7.4.8.3 关联方交易
7.4.8.3.1 关联方交易
7.4.8.3.2 关联方交易
7.4.8.3.3 关联方交易
7.4.8.3.4 关联方交易

7.4.8.4 关联方交易
7.4.8.4.1 关联方交易
7.4.8.4.2 关联方交易
7.4.8.4.3 关联方交易
7.4.8.4.4 关联方交易

7.4.8.5 关联方交易
7.4.8.5.1 关联方交易
7.4.8.5.2 关联方交易
7.4.8.5.3 关联方交易
7.4.8.5.4 关联方交易

7.4.8.6 关联方交易
7.4.8.6.1 关联方交易
7.4.8.6.2 关联方交易
7.4.8.6.3 关联方交易
7.4.8.6.4 关联方交易

7.4.8.7 关联方交易
7.4.8.7.1 关联方交易
7.4.8.7.2 关联方交易
7.4.8.7.3 关联方交易
7.4.8.7.4 关联方交易

7.4.8.8 关联方交易
7.4.8.8.1 关联方交易
7.4.8.8.2 关联方交易
7.4.8.8.3 关联方交易
7.4.8.8.4 关联方交易

7.4.8.9 关联方交易
7.4.8.9.1 关联方交易
7.4.8.9.2 关联方交易
7.4.8.9.3 关联方交易
7.4.8.9.4 关联方交易

7.4.8.10 关联方交易
7.4.8.10.1 关联方交易
7.4.8.10.2 关联方交易
7.4.8.10.3 关联方交易
7.4.8.10.4 关联方交易

7.4.8.11 关联方交易
7.4.8.11.1 关联方交易
7.4.8.11.2 关联方交易
7.4.8.11.3 关联方交易
7.4.8.11.4 关联方交易

7.4.8.12 关联方交易
7.4.8.12.1 关联方交易
7.4.8.12.2 关联方交易
7.4.8.12.3 关联方交易
7.4.8.12.4 关联方交易

7.4.8.13 关联方交易
7.4.8.13.1 关联方交易
7.4.8.13.2 关联方交易
7.4.8.13.3 关联方交易
7.4.8.13.4 关联方交易

7.4.8.14 关联方交易
7.4.8.14.1 关联方交易
7.4.8.14.2 关联方交易
7.4.8.14.3 关联方交易
7.4.8.14.4 关联方交易

7.4.8.15 关联方交易
7.4.8.15.1 关联方交易
7.4.8.15.2 关联方交易
7.4.8.15.3 关联方交易
7.4.8.15.4 关联方交易

7.4.8.16 关联方交易
7.4.8.16.1 关联方交易
7.4.8.16.2 关联方交易
7.4.8.16.3 关联方交易
7.4.8.16.4 关联方交易

7.4.8.17 关联方交易
7.4.8.17.1 关联方交易
7.4.8.17.2 关联方交易
7.4.8.17.3 关联方交易
7.4.8.17.4 关联方交易

7.4.8.18 关联方交易
7.4.8.18.1 关联方交易
7.4.8.18.2 关联方交易
7.4.8.18.3 关联方交易
7.4.8.18.4 关联方交易

7.4.8.19 关联方交易
7.4.8.19.1 关联方交易
7.4.8.19.2 关联方交易
7.4.8.19.3 关联方交易
7.4.8.19.4 关联方交易

7.4.8.20 关联方交易
7.4.8.20.1 关联方交易
7.4.8.20.2 关联方交易
7.4.8.20.3 关联方交易
7.4.8.20.4 关联方交易

7.4.8.21 关联方交易
7.4.8.21.1 关联方交易
7.4.8.21.2 关联方交易
7.4.8.21.3 关联方交易
7.4.8.21.4 关联方交易

7.4.8.22 关联方交易
7.4.8.22.1 关联方交易
7.4.8.22.2 关联方交易
7.4.8.22.3 关联方交易
7.4.8.22.4 关联方交易

7.4.8.23 关联方交易
7.4.8.23.1 关联方交易
7.4.8.23.2 关联方交易
7.4.8.23.3 关联方交易
7.4.8.23.4 关联方交易

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 金额单位:人民币元. Lists top 10 stock purchases.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 金额单位:人民币元. Lists top 10 stock purchases.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 金额单位:人民币元. Lists top 10 stock purchases.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 金额单位:人民币元. Lists top 10 stock purchases.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 金额单位:人民币元. Lists top 10 stock purchases.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 金额单位:人民币元. Lists top 10 stock purchases.

东吴基金管理有限公司
二〇一二年三月二十八日