东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:二〇一三年三月二十六日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月22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。

本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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31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	745,782,289.92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

§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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-232,997,655.67	-157,606,733.22	63,933,038.75
本期利润	-9,666,869.39	-434,091,544.65	99,819,821.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0083	-0.3785	0.2031
本期基金份额净值增长率	-0.93%	-30.45%	21.24%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2476	-0.1570	0.1653
期末基金资产净值	622,893,857.34	1,190,193,009.25	1,234,276,221.80
期末基金份额净值	0.8352	0.8430	1.2965

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。

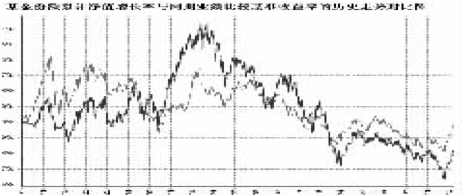
3.2 基金净值表现

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	2.35%	0.95%	6.87%	0.83%	-4.52%	0.12%
过去六个月	-3.06%	0.92%	2.01%	0.81%	-5.07%	0.11%
过去一年	-0.93%	1.04%	6.32%	0.83%	-7.25%	0.21%
过去三年	-21.90%	1.19%	-15.59%	0.91%	-6.31%	0.28%
自基金合同生效起至今	-10.67%	1.18%	-1.22%	0.99%	-9.45%	0.19%

注:比较基准=65%*沪深300指数+35%*中信标普全债指数。

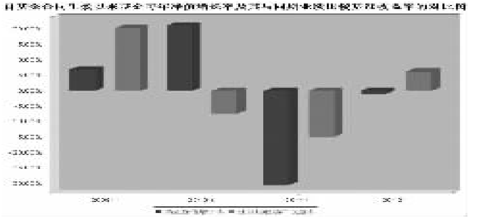
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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。

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



注:东吴进取策略基金于2009年5月6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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	–	–	–	–	
2011	0.7000	70,915,071.60	11,422,339.86	82,337,411.46	
2010	–	–	–	–	
合计	0.7000	70,915,071.60	11,422,339.86	82,337,411.46	

§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2012年12月31日,本基金管理人旗下共管理基金13只,其中混合型基金3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;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2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;货币型基金1只,为东吴货币市场证券投资基金。

2012年,市场的持续下跌,行业的激烈竞争,渠道资源日渐枯竭。整个基金行业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,进一步完善并构建特色产品线,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。

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	本基金的基金经理、公司投资副总监兼投资管理部总经理	2012年4月6日	–	13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,曾任东吴嘉禾优势精选混合基金基金经理,现担任公司投资副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、东吴深证100指数增强基金(LOF)基金经理、东吴双动力股票基金基金经理。
朱昆鹏	本基金的基金经理	2009年12月23日	2012年4月6日	11年	中国人民大学毕业,经济学学士,曾担任云南国际信托投资有限公司研究员、资产管理部副总经理,国金证券高级投资经理,云南国际信托有限公司信托经理等职;2008年11月至2012年4月就职于东吴基金管理有限公司,历任基金经理助理、东吴进取策略混合基金经理。

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遵规守信情况的说明

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

2012年A股市场的走势犹如过山车,在一片悲观的情况下,地产银行等板块在年末引领市场走出了反转的态势。从全年来看,沪深300上涨7.55%,上证综指上涨3.17%;从市场风格来看,低估值的蓝筹股表现明显好于高估值的股票;从行业角度来看,房地产行业的涨幅达到31%,金融服务、家用电器、建筑建材等行业指数收益率也超过10%,而信息服务、商业贸易、纺织服装等行业指数的跌幅超过了10%。

在报告期内,出于对经济下行的担忧,本基金采取了较为平衡的资产配置水平,在股票配置上,以医药等稳定类行业以及金融等低估值行业的个股进行防御性投资,但是由于个股表现差异较大、信息设备及信息服务头寸较多,导致组合收益水平差强人意。

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0.8352元,累计净值0.9052元;本报告期份额净值增长率-0.93%,同期业绩比较基准收益率为6.32%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从各项经济指标来看,2012年四季度中国经济已经走出连续下滑的局面,经济复苏的格局已然形成。本轮经济复苏是在房地产、汽车等终端需求拉动下的自然复苏,复苏的力度与结果完全不同于上轮"4万亿"投资带来的复苏,这种自然复苏带来的经济增长是逐步上升,在国内产能普遍过剩的背景下,这种复苏短期不会带来物价上行的压力。从宏观经济政策来看,2013年在加快推进城镇化的背景下,财政政策可能更偏向积极,货币政策有宽松的取向。综合以上因素,宏观经济的风险可能是下半年物价上升所带来的压力。

就股票市场而言,虽然经过了一轮反弹,A股市场蓝筹股估值低的状况依旧没有根本改观,估值还有继续修复的空间。从上市公司业绩来看,在经济复苏的背景下,市场普遍预期2013年上市公司整体利润(扣除金融股后)增长10%左右,而这个数字在2012年三季度是下滑17%。业绩增长、估值水平低只是市场上涨的必要条件,资金的供应是个变数也是最大的机会,资金一方面来自全球资产再配置,另一方面来自国内资金的再配置,而现在的上涨主要归功于海外资金的流入,在财富效应的吸引下,国内会有更多的资金流入A股市场,一旦这种局面形成,2013年的市场就更值得期待。

在经济复苏以及估值修复的背景下,低估值的蓝筹股、复苏弹性大的周期股都有短期投资机会,在新的行政体制改革背景下,制度变革所带来的投资机会也值得期待。我们在关注这些机会的同时,会继续聚焦有长期机会的行业与个股,我们将牢记中国经济的长期出路是增长动力升级,消费拉动与生产方式变革是必然路径,经济复苏无法改变这种长期归宿,我们将继续在消费升级、生产方式升级、城市化、农业现代化等领域寻找机会,自下而上的寻找成长股。

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

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基金合同》、《东吴进取策略证券灵活配置混合型开放式投资基金托管协议》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2012年1月1日至2012年12月31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 审计报告

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所审计,注册会计师签字出具了天衡审字(2013)00290号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	36,093,391.32	178,172,118.24
结算备付金	374,790.91	2,218,485.26
存出保证金	–	–
交易性金融资产	576,195,872.28	1,007,540,260.48
其中:股票投资	485,962,052.38	900,475,509.40
基金投资	–	–
债券投资	90,233,819.90	107,064,751.08
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	4,675,069.09
应收利息	452,907.19	1,000,944.50
应收股利	–	–
应收申购款	75,804.25	14,813,599.11
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	625,465,925.16	1,208,420,476.68

负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	–	14,571,311.92
应付赎回款	438,506.98	114,625.16
应付管理人报酬	742,004.93	1,525,757.94
应付托管费	123,667.46	254,293.00
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	875,930.38	1,369,578.83
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	390,358.07	390,300.58
负债合计	2,572,067.82	18,227,467.43
所有者权益:		
实收基金	745,782,289.92	1,411,915,386.89
未分配利润	-122,888,432.58	-221,722,377.64
所有者权益合计	622,893,857.34	1,190,193,009.25
负债和所有者权益总计	625,465,925.16	1,208,420,476.68

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.8352元,基金份额总额745782289.92份。

7.2 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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	13,170,804.28	-403,911,969.34
1.利息收入	2,621,955.39	3,479,469.21
其中:存款利息收入	1,312,174.77	1,171,757.00
债券利息收入	1,047,991.85	2,041,173.45
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	261,788.77	266,538.76
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	-213,174,127.68	-131,415,290.26
其中:股票投资收益	-221,575,100.71	-128,273,504.44
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-285,671.81	-4,973,049.32
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	8,686,644.84	1,831,263.50
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	223,330,786.28	-276,484,811.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	392,190.29	508,663.14
减:二、费用	22,837,673.67	30,179,575.31
1. 管理人报酬	14,744,095.21	18,240,456.24
2. 托管费	2,457,349.07	3,040,076.08
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	5,224,287.42	8,416,490.58
5. 利息支出	–	67,861.93
其中:卖出回购金融资产支出	–	67,861.93
6. 其他费用	411,941.97	414,690.48
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-9,666,869.39	-434,091,544.65
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-9,666,869.39	-434,091,544.65

7.3 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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	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)	–	-9,666,869.39	-9,666,869.39
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)	-666,133,096.97	108,500,814.45	-557,632,282.52
其中:1.基金申购款	77,031,919.98	-11,905,045.27	65,126,874.71
2.基金赎回款	-743,165,016.95	120,405,859.72	-622,759,157.23
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)	745,782,289.92	-122,888,432.58	622,893,857.34
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	951,982,071.56	282,294,150.24	1,234,276,221.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-434,091,544.65	-434,091,544.65
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)	459,933,315.33	12,412,428.23	472,345,743.56
其中:1.基金申购款	830,381,892.02	73,165,208.48	903,547,100.50
2.基金赎回款	-370,448,576.69	-60,752,780.25	-431,201,356.94
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)	–	-82,337,411.46	-82,337,411.46
五、期末所有者权益(基金净值)	1,411,915,386.89	-221,722,377.64	1,190,193,009.25

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:

任少华 徐军 金婕
基金管理公司负责人 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。

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》、《东吴进取策略灵活配置混合型开放式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。

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。

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)基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;

(3)若基金合同生效不满3个月,可不进行收益分配;

(4)基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

(5)基金当期收益应先弥补上期累计亏损后,才可进行收益分配;

(6)本基金收益每年最多分配八次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的25%;

(7)本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(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2009 年6 月16 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

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。

7.4.7 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
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。

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	41,756,605.24	1.26%	1,015,461,075.31	17.95%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	–	–	6,431,774.66	1.64%

7.4.8.1.3 债券回购交易

无。

7.4.8.1.4 权证交易

无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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
东吴证券股份有限公司	36,950.46	1.30%	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	832,494.56	17.71%	–	–

注: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。佣金的比率是公允的,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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,744,095.21	18,240,456.24
其中:支付销售机构的客户维护费	1,333,707.80	1,973,467.61

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,457,349.07	3,040,076.08

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度可比期间未与关联方进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	–	–
期末持有的基金份额	29,999,000.00	29,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.02%	2.12%

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。

7.4.8.4.2 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

本基金报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

7.4.8.5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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国农业银行股份有限公司	36,093,391.32	1,290,854.04	178,172,118.24	1,074,156.14

7.4.8.5 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。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10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	485,962,052.38	77.70
	其中:股票	485,962,052.38	77.70
2	固定收益投资	90,233,819.90	14.43
	其中:债券	90,233,819.90	14.43
	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	36,468,182.23	5.83
6	其他各项资产	12,801,870.65	2.05
7	合计	625,465,925.16	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	33,323,942.30	5.35
B	采掘业	–	–
C	制造业	297,552,990.65	47.77
C0	食品、饮料	67,478,758.75	10.83
C1	纺织、服装、皮毛	14,560,673.24	2.34
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	80,859,133.65	12.98
C5	电子	207,300.00	0.03
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	58,624,133.07	9.41
C8	医药、生物制品	75,822,991.94	12.17
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	4,785,046.00	0.77
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	4,597,018.80	0.74
H	批发和零售贸易	19,407,171.13	3.12
I	金融、保险业	103,993,072.50	16.70
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	22,302,811.00	3.58
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	485,962,052.38	78.02

8.3 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	000423	东阿阿胶	889,996	35,964,738.36	5.77
2	002477	雏鹰农牧	1,782,029	33,323,942.30	5.35
3	601633	长城汽车	1,274,944	30,216,172.80	4.85
4	600267	海正药业	1,870,392	27,850,136.88	4.47
5	000895	双汇发展	477,000	27,618,300.00	4.43
6	600030	中信证券	2,000,000	26,720,000.00	4.29
7	600587	新华医疗	748,391	23,282,444.01	3.74
8	600305	恒顺醋业	1,133,259	18,415,458.75	2.96
9	601601	中国太保	799,973	17,999,392.50	2.89
10	601166	兴业银行	1,000,000	16,690,000.00	2.68

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

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	601318	中国平安	75,571,717.44	6.35
2	601166	兴业银行	58,436,225.78	4.91
3	601601	中国太保	53,110,392.43	4.46
4	600030	中信证券	51,969,882.50	4.37
5	600036	招商银行	47,966,629.41	4.03
6	601628	中国人寿	41,198,215.88	3.46
7	002477	雏鹰农牧	40,106,252.93	3.37
8	000895	双汇发展	38,789,581.47	3.26
9	600104	上汽集团	35,865,917.53	3.01
10	000423	东阿阿胶	34,675,210.26	2.91
11	601398	工商银行	32,383,101.38	2.72
12	002024	苏宁电器	32,347,400.00	2.72
13	600707	彩虹股份	32,094,495.74	2.70
14	002157	正邦科技	31,625,597.65	2.66
15	600547	山东黄金	31,445,225.35	2.64
16	002106	莱宝高科	31,308,787.29	2.63
17	600031	三一重工	30,539,184.00	2.57
18	000527	美的电器	27,717,892.59	2.33
19	600585	海螺水泥	27,493,701.08	2.31
20	600362	江西铜业	26,208,610.21	2.20
21	000063	中兴通讯	25,725,917.85	2.16
22	000650	仁和药业	25,378,788.33	2.13
23	000001	平安银行	24,387,049.62	2.05

注:本项的"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。

8.4.2 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	000596	古井贡酒	105,969,219.01	8.90
2	002431	棕榈园林	97,491,558.72	8.19
3	601318	中国平安	61,248,788.29	5.15
4	600036	招商银行	41,283,510.93	3.47
5	002241	歌尔声学	41,058,315.25	3.45
6	601166	兴业银行	40,475,860.25	3.40
7	000858	五 粮 液	40,184,879.62	3.38
8	000024	招商地产	38,171,283.87	3.21
9	002371	七星电子	38,096,357.94	3.20
10	600962	国投中鲁	36,733,281.25	3.09
11	000001	平安银行	36,372,471.76	3.06
12	600588	用友软件	35,875,000.23	3.01
13	600104	上汽集团	33,473,765.37	2.81
14	000069	华侨城A	33,393,325.11	2.81
15	601601	中国太保	33,136,393.46	2.78
16	600240	华业地产	32,744,554.75	2.75
17	600030	中信证券	32,128,307.34	2.70
18	002176	江特电机	30,898,807.64	2.60
19	002179	中航光电	30,389,394.70	2.55
20	600547	山东黄金	30,153,472.75	2.53
21	002024	苏宁电器	29,967,614.38	2.52
22	600267	海正药业	29,845,105.93	2.51
23	600010	包钢股份	29,598,795.65	2.49
24	601398	工商银行	28,817,957.61	2.42
25	600031	三一重工	28,639,482.71	2.41
26	601628	中国人寿	28,318,878.52	2.38
27	600516	方大炭素	28,114,891.99	2.36
28	002310	东方园林	27,899,698.71	2.34
29	600015	华夏银行	27,779,129.50	2.33
30	600585	海螺水泥	27,417,733.54	2.30
31	600085	同仁堂	26,224,245.50	2.20
32	002106	莱宝高科	25,596,457.01	2.15
33	002214	大立科技	25,519,577.51	2.14
34	600707	彩虹股份	25,085,519.23	2.11
35	600362	江西铜业	25,047,200.80	2.10
36	000527	美的电器	24,929,731.19	2.09
37	600406	国电南瑞	24,838,712.62	2.09
38	002146	荣盛发展	24,418,901.94	2.05

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	1,448,424,418.05
卖出股票收入(成交)总额	1,862,894,591.90

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	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	90,233,819.90	14.49
8	其他	–	–
9	合计	90,233,819.90	14.49

8.6 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	113001	中行转债	300,000	28,905,000.00	4.64
2	110003	新钢转债	222,480	22,910,990.40	3.68
3	113002	工行转债	130,000	14,245,400.00	2.29
4	110016	川投转债	100,650	10,946,694.00	1.76
5	110017	中海转债	120,000	10,622,400.00	1.71

8.7 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名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 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	–
2	应收证券清算款	12,273,159.21
3	应收股利	–
4	应收利息	452,907.19
5	应收申购款	75,804.25
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,801,870.65

8.9.4 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	113001	中行转债	28,905,000.00	4.64
2	110003	新钢转债	22,910,990.40	3.68
3	113002	工行转债	14,245,400.00	2.29
4	110016	川投转债	10,946,694.00	1.76
5	110017	中海转债	10,622,400.00	1.71
6	126729	燕京转债	2,603,335.50	0.42

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.9.6 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
33,159	22,491.10	321,307,400.02	43.08%	424,474,889.90	56.92%

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
基金管理公司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开放式基金。

§10 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	1,411,915,386.89
本报告期基金总申购份额	77,031,919.98
减:本报告期基金总赎回份额	743,165,016.95
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	745,782,289.92

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决议。

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原总经理徐建平同志因组织安排和个人工作调动原因辞去总经理职务,离任日期2012年9月17日,公司聘任任少华同志为新任基金管理公司总经理。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第一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2012年9月18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原督察长吴威同志因工作需要调任筹建东吴基金子公司辞去公司督察长职务,离任日期2012年12月29日,由公司总经理任少华同志代行督察长职责。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2012年12月29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

报告期内,基金管理人东吴基金管理有限公司决定改聘江苏天衡会计师事务所有限公司担任公司及旗下基金的会计师事务所。此事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告,并已于2012年12月29日进行了披露。该会计师事务所从2012年提供审计服务,本报告期内支付审计费90000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	
银河证券	1	422,550,556.78	12.78%	354,714.18	12.51%	–
申银万国	2	280,702,768.97	8.49%	234,479.02	8.27%	–
齐鲁证券	1	205,843,610.34	6.23%	174,965.77	6.17%	–
中投证券	1	203,439,297.79	6.15%	166,224.57	5.86%	–
中信证券	2	197,875,886.44	5.99%	167,971.42	5.92%	–
瑞银证券	1	196,303,816.70	5.94%	165,568.22	5.84%	–
金元证券	1	180,709,090.92	5.47%	155,951.91	5.50%	–
华宝证券	1	176,539,075.09	5.34%	157,870.89	5.57%	–
中金公司	2	167,364,505.19	5.06%	143,323.26	5.05%	–
华泰联合	1	156,090,558.11	4.72%	138,142.19	4.87%	–
国金证券	1	152,733,694.19	4.62%	135,259.70	4.77%	–
招商证券	1	151,459,472.30	4.58%	134,026.31	4.73%	–
东方证券	1	147,741,949.65	4.47%	122,746.40	4.33%	–
中信建投	1	114,032,004.59	3.45%	103,815.85	3.66%	–
信达证券	1	103,207,007.66	3.12%	89,471.75	3.16%	–
中银国际	2	99,870,476.62	3.02%	87,088.81	3.07%	–
安信证券	1	79,821,543.84	2.41%	72,669.50	2.56%	–
浙商证券	1	62,965,460.60	1.90%	51,159.65	1.80%	–
国信证券	1	59,392,660.53	1.80%	54,070.80	1.91%	–
爱建证券	1	43,931,001.13	1.33%	37,341.52	1.32%	–
东吴证券	2	41,756,605.24	1.26%	36,950.46	1.30%	–
高华证券	1	37,952,964.48	1.15%	30,836.85	1.09%	–
平安证券	1	23,232,486.90	0.70%	21,150.79	0.75%	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
东海证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
大通证券	1	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–
中航证券	1	–	–	–	–	–

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

本报告期本基金退租交易单元3个,分别为中航证券、东海证券、大通证券交易单元。

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
银河证券	–	–	–	–	–	–
申银万国	4,816,901.90	19.66%	–	–	–	–
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
金元证券	–	–	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
华泰联合	–	–	–	–	–	–
国金证券	6,708,262.80	27.38%	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	2,157,722.40	8.81%	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	2,112,351.67	8.62%	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	8,703,867.10	35.53%	–	–	–	–
爱建证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
东海证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
大通证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
中航证券	–	–	–	–	–	–

东吴基金管理有限公司
2013年3月26日