

东吴行业轮动股票型证券投资基金
2010 年半年度报告
2010 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年八月二十四日

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。

本基金托管人华夏银行股份有限公司（以下简称“华夏银行”）根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 20 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
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.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	38

8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	39
9 开放式基金份额变动.....	39
10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
12 备查文件目录.....	43
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	43
12.3 查阅方式.....	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴行业轮动股票型证券投资基金
基金简称	东吴行业轮动股票
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	1,245,408,590.60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，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并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，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，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，追求超额收益。
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*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股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。

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	华夏银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	黄忠平	郑鹏
	联系电话	021-50509888-8219	010-85238672
	电子邮箱	huangzhp@scfund.com.cn	zhjjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话	021-50509666	95577	
传真	021-50509888-8211	010-85238680	
注册地址	上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
办公地址	上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
邮政编码	200135	100005	
法定代表人	徐建平	吴建	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 (2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,617,480.94
本期利润	-134,148,965.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1353
本期加权平均净值利润率	-12.92%
本期基金份额净值增长率	-9.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2010 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-66,373,920.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0533

期末基金资产净值	1,179,034,669.86
期末基金份额净值	0.9467
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.33%

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	-12.38%	1.71%	-5.66%	1.25%	-6.72%	0.46%
过去三个月	-10.57%	1.94%	-17.24%	1.37%	6.67%	0.57%
过去六个月	-9.29%	1.67%	-20.50%	1.20%	11.21%	0.47%
过去一年	1.10%	1.77%	-13.59%	1.42%	14.69%	0.35%
自基金合同生效起至今	-5.33%	1.68%	-13.96%	1.78%	8.63%	-0.10%

注：比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*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

东吴行业轮动股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年4月23日至2010年6月30日)



注：1、东吴行业轮动基金于 2008 年 4 月 23 日成立。
2、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*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，分别持有 49%、30%、21%的股份。

截至 2010 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 8 只，其中混合型基金 2 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；股票型基金 4 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；债券型基金 1 只，为东吴优信稳健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。

2010 年上半年，公司旗下基金业绩表现位居同业前列，这是继 07、08 年之后，公司基金业绩再次脱颖而出。根据中国银河证券基金研究中心的统计，截至 2010 年 6 月 30 日，在 166 只股票型基金中，东吴双动力今年上半年基金净值增长率排名第 2、东吴行业轮动排名

第 9；在 40 只灵活配置型基金中，东吴进取策略今年上半年基金净值增长率排名第 2；在同期发行的 33 只新基金中，东吴新经济基金排名第 2 名；在 43 只偏股型基金中，东吴嘉禾今年上半年基金净值增长率排名第 14。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任壮	本基金的基金经理、公司研究策划部副总经理	2009-01-19	-	6 年	管理学博士，中国社科院金融所博士后，副研究员。曾任兴业证券研发中心高级研究员；2007 年 9 月加入东吴基金，曾任公司基金经理助理、研究策划部总经理助理等职，现担任研究策划部副总经理，东吴行业轮动、东吴新经济基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

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》的相关规定。

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，在严格控制风险的基础上，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，基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资决策、研究分析、投资授权、交易执行、业绩评估等环节严格把关，不断完善公平交易程序及投资、研究、交易等相关业务流程，确保了公平对待旗下不同投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截至本报告期末，本基金为股票型基金，净值增长率为-9.29%，东吴价值成长双动力股票型证券投资基金为-2.44%。

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，政策调控与经济下降预期导致市场出现调整。一季度为防止经济过热，政策以调控为主，主要是央行控制流动性、房地产政策调控等，二季度后期发生的欧盟债务危机以及固定资产投资预期的下降，导致市场对未来经济增速下降的担心，市场整体呈现单边下跌的走势。

我们认为，今年国内经济将处于“结构转型”期，市场整体将以振荡为主，但结构性机会依然存在，所以始终坚持“自下而上”挖掘个股的投资思路。上半年主要关注以下几个方面：一是遵循产业结构调整思路，选取以“新能源、新材料、新技术”为方向的个股，包括智能电网、TMT、生物医药等。二是新能源发展受益的上游原材料，如稀土、锂等。三是受益于政策扶持的航空军工行业的相关公司。四是受经济波动影响小、业绩稳定增长的消费类公司，包括食品饮料、医药等。

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 0.9467 元，累计净值 0.9467 元；本报告期份额净值增长率-9.29%，同期业绩比较基准收益率为-20.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，市场将面临“经济向下，政策向上”的情况。在投资增速回落、出口增速不明朗、消费难以启动的情况下，市场普遍预期下半年经济增速将呈现逐季下降态势，只是预计

下降幅度上存在差别。但货币政策与财政政策将相对上半年更加宽松和积极，特别是政府将加大新兴产业的扶持力度，并可能加大投资拉动的力度，即在“保增长”的基础上加大推进“调结构”。

在此背景下，我们仍坚持对市场“区间振荡为主、存在结构机会”的判断，将遵循以下投资主线：一是关注产业结构转型下的战略新兴产业，如新能源、电动汽车等，以及稀土等上游原材料；二是与拉动内需、稳定增长的行业的投资机会，如食品饮料、医药、农业、家电等；三是把握政府加大保障性住房及基建力度，带来投资拉动相关行业的机会，如建材等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、公司有关参与估值流程各方、组成及职责分工情况：

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、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、总经理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，职责分工主要如下：公司总经理、投资总监、投资部负责人及基金经理等参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定；运营总监、基金会计等参与基金组合停牌估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；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；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。

2、基金经理参与或决定估值的程度：基金经理参与估值委员会对相关停牌股票估值的讨论，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。

3、公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、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

本基金合同约定，基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；根据该合同约定以及相关法律法规要求，同时结合基金实际运作情况，本基金本报告期末可供分配利润为负值，不需进行利润分配。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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

基金管理人在报告期内的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内本基金未进行利润分配。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2010 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等数据信息真实、准确和完整。

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：东吴行业轮动股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	189,655,674.56	248,729,273.85
结算备付金		5,210,105.34	5,776,144.68
存出保证金		1,723,363.58	2,846,326.89
交易性金融资产	6.4.7.2	1,007,055,295.02	889,583,726.40
其中：股票投资		932,996,015.02	857,138,134.10
基金投资		-	-

债券投资		74,059,280.00	32,445,592.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,261,004.47	-
应收利息	6.4.7.5	737,311.04	71,508.09
应收股利		-	-
应收申购款		6,286,423.34	231,275.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,213,929,177.35	1,147,238,255.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009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		24,112,913.96	126,720,599.14
应付赎回款		3,658,675.80	5,876,868.53
应付管理人报酬		1,626,527.71	1,347,984.82
应付托管费		271,087.96	224,664.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,518,662.40	2,117,391.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,706,639.66	1,801,250.05
负债合计		34,894,507.49	138,088,758.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,245,408,590.60	967,010,645.83
未分配利润	6.4.7.10	-66,373,920.74	42,138,851.29
所有者权益合计		1,179,034,669.86	1,009,149,497.12
负债和所有者权益总计		1,213,929,177.35	1,147,238,255.45

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9467 元，基金份额总额 1,245,408,590.60 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴行业轮动股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010 年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009 年6月30日
一、收入		-116,161,778.73	517,607,578.21
1.利息收入		1,008,894.22	3,873,780.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	592,267.32	1,217,747.86
债券利息收入		369,321.40	2,656,032.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		47,305.50	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		37,262,674.54	290,500,196.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,263,232.97	280,307,069.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,908,255.97	-227,240.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,091,185.60	10,420,366.32
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-154,766,446.34	222,850,002.34
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	333,098.85	383,599.48
减：二、费用		17,987,186.67	40,942,583.80
1.管理人报酬		7,736,210.81	14,555,047.17
2.托管费		1,289,368.52	2,425,841.21
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	8,758,478.27	23,758,302.94
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	203,129.07	203,392.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-134,148,965.40	476,664,994.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-134,148,965.40	476,664,994.41

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴行业轮动股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	967,010,645.83	42,138,851.29	1,009,149,497.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-134,148,965.40	-134,148,965.40
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）	278,397,944.77	25,636,193.37	304,034,138.14
其中：1. 基金申购款	673,880,966.44	52,642,532.20	726,523,498.64
2. 基金赎回款	-395,483,021.67	-27,006,338.83	-422,489,360.50
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）	1,245,408,590.60	-66,373,920.74	1,179,034,669.86
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 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）	2,506,029,301.97	-665,673,203.06	1,840,356,098.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	476,664,994.41	476,664,994.41
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）	-429,717,992.13	56,902,879.44	-372,815,112.69
其中：1. 基金申购款	27,456,812.46	-4,261,377.52	23,195,434.94
2. 基金赎回款	-457,174,804.59	61,164,256.96	-396,010,547.63
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）	2,076,311,309.84	-132,105,329.21	1,944,205,980.63
-----------------	------------------	-----------------	------------------

报告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：

基金管理公司负责人：徐建平，主管会计工作负责人：黄忠平，会计机构负责人：金婕

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴行业轮动股票型证券投资基金（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[2008]296 号文《关于核准东吴行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》的核准，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 2008 年 4 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 3,171,531,068.11 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，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%。本基金业绩比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则（以下简称“新会计准则”）、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》（以下简称“指引”）。

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

本基金本年度所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

1、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
活期存款	189,655,674.56
定期存款	-
其他存款	-
合计	189,655,674.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		994,066,369.49	932,996,015.02	-61,070,354.47
债券	交易所市场	13,948,227.70	13,054,280.00	-893,947.70
	银行间市场	61,298,820.00	61,005,000.00	-293,820.00
	合计	75,247,047.70	74,059,280.00	-1,187,767.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,069,313,417.19	1,007,055,295.02	-62,258,122.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2010 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	37,270.31
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	1,641.22
应收债券利息	697,502.69
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	896.82
其他	-
合计	737,311.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,518,212.40
银行间市场应付交易费用	450.00
合计	3,518,662.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00
应付赎回费	13,242.97
预提费用	193,396.69
合计	1,706,639.66

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	967,010,645.83	967,010,645.83
本期申购	673,880,966.44	673,880,966.44
本期赎回（以“-”号填列）	-395,483,021.67	-395,483,021.67
本期末	1,245,408,590.60	1,245,408,590.60

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；
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。

6.4.7.10 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
上年度末	9,758,950.51	32,379,900.78	42,138,851.29
本期利润	20,617,480.94	-154,766,446.34	-134,148,965.40
本期基金份额交易产生的变动数	20,563,786.17	5,072,407.20	25,636,193.37
其中：基金申购款	35,777,073.72	16,865,458.48	52,642,532.20
基金赎回款	-15,213,287.55	-11,793,051.28	-27,006,338.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,940,217.62	-117,314,138.36	-66,373,920.74

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2010年1月1日至2010年6月30日
活期存款利息收入	537,653.44
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	30,054.18
其他	24,559.70
合计	592,267.32

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2010年1月1日至2010年6月30日
卖出股票成交总额	2,825,864,724.55
减：卖出股票成本总额	2,793,601,491.58
买卖股票差价收入	32,263,232.97

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2010年1月1日至2010年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	52,380,078.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,363,342.97
减：应收利息总额	108,479.54
债券投资收益	1,908,255.97

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,091,185.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,091,185.60

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
1. 交易性金融资产	-154,766,446.34
——股票投资	-152,733,656.34
——债券投资	-2,032,790.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-154,766,446.34

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
基金赎回费收入	288,372.00
转换费收入	39,434.54
印花税手续费返还	5,292.31
合计	333,098.85

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
交易所市场交易费用	8,758,028.27
银行间市场交易费用	450.00
合计	8,758,478.27

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
审计费用	44,630.98

信息披露费	148,765.71
其他费用	-
汇划费	732.38
帐户维护费	9,000.00
合计	203,129.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
东吴证券有限责任公司	1,319,591,691.10	22.65%	2,734,839,293.15	17.55%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东吴证券有限责任公司	200,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日 至 2010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
东吴证券有限责任公司	1,115,284.62	22.90%	657,627.18	18.69%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009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
东吴证券有限责任公司	2,287,743.53	17.54%	1,571,004.76	18.67%

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。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,736,210.81	14,555,047.17
其中：支付销售机构的客户维护费	1,235,537.17	2,001,164.25

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。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,289,368.52	2,425,841.21

注：支付基金托管人华夏银行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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日 - 2009年6月30日
期初持有的基金份额	-	15,007,250.00
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	-	15,007,250.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	
	2010年1月1日至2010年6月30日		2009年1月1日至2009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
华夏银行股份有限公司	189,655,674.56	537,653.44	164,299,167.02	1,154,031.29

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2010 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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、增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，追求超额收益。

本基金投资目标为通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并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，追求超额收益。基于该投资目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

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。

6.4.13.2 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 - 华夏银行股份有限公司。本基金认为与华夏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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010年6月30日	上年末 2009年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	29,901,000.00
合计	-	29,901,000.00

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、中央银行票据或政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2010年6月30日	上年末 2009年12月31日
AAA	10,114,000.00	-
AAA 以下	2,940,280.00	2,544,592.30
未评级	61,005,000.00	-
合计	74,059,280.00	2,544,592.30

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、中央银行票据或政策性金融债。

6.4.13.3 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公司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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年6 月30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	189,655,67 4.56	-	-	-	-	-	189,655,67 4.56
结算备付 金	5,210,105.3 4	-	-	-	-	-	5,210,105.3 4
存出保证 金	-	-	-	-	-	1,723,363.5 8	1,723,363.5 8
交易性金 融资产	-	2,940,280.0 0	71,119,000. 00	-	-	932,996,01 5.02	1,007,055,2 95.02
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	3,261,004.4 7	3,261,004.4 7
应收利息	-	-	-	-	-	737,311.04	737,311.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购	6,286,423.3	-	-	-	-	-	6,286,423.3

款	4						4
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	201,152,20 3.24	2,940,280.0 0	71,119,000. 00	-	-	938,717,69 4.11	1,213,929,1 77.35
负债							
卖出回购 金融资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	24,112,913. 96	24,112,913. 96
应付赎回 款	-	-	-	-	-	3,658,675.8 0	3,658,675.8 0
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	1,626,527.7 1	1,626,527.7 1
应付托管 费	-	-	-	-	-	271,087.96	271,087.96
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易 费用	-	-	-	-	-	3,518,662.4 0	3,518,662.4 0
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,706,639.6 6	1,706,639.6 6
负债总计	-	-	-	-	-	34,894,507. 49	34,894,507. 49
利率敏感 度缺口	201,152,20 3.24	2,940,280.0 0	71,119,000. 00	-	-	903,823,18 6.62	1,179,034,6 69.86
上年度末 2009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	248,729,27	-	-	-	-	-	248,729,27

	3.85						3.85
结算备付金	5,776,144.68	-	-	-	-	-	5,776,144.68
存出保证金	-	-	-	-	-	2,846,326.89	2,846,326.89
交易性金融资产	-	29,901,000.00	-	-	2,544,592.30	857,138,134.10	889,583,726.40
应收利息	-	-	-	-	-	71,508.09	71,508.09
应收申购款	231,275.54	-	-	-	-	-	231,275.54
资产总计	254,736,694.07	29,901,000.00	-	-	2,544,592.30	860,055,969.08	1,147,238,255.45
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	126,720,599.14	126,720,599.14
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,876,868.53	5,876,868.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,347,984.82	1,347,984.82
应付托管费	-	-	-	-	-	224,664.13	224,664.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,117,391.66	2,117,391.66
其他负债	-	-	-	-	-	1,801,250.05	1,801,250.05
负债总计	-	-	-	-	-	138,088,758.33	138,088,758.33
利率敏感度缺口	254,736,694.07	29,901,000.00	-	-	2,544,592.30	721,967,210.75	1,009,149,497.12

注：本表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 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）	
		本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
	利率下降25个基点	增加28.28万元	增加4.92万元
	利率上升25个基点	减少27.65万元	减少4.78万元

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日		上年度末 2009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	932,996,015.02	79.13	857,138,134.10	84.94
衍生金融资产 - 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	932,996,015.02	79.13	857,138,134.10	84.94

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，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%。

6.4.13.4.3.2 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）

	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
业绩基准下跌1%	减少1,095.83万元	减少1,029.33万元
业绩基准下跌5%	减少5,479.16万元	减少5,146.66万元
业绩基准下跌10%	减少10,958.33万元	减少10,293.32万元

注：报告期内，本基金 beta 值为 0.93，09 年为 1.02，在市场下跌期，低于市场的 Beta 系数会使得基金组合避免过高系统性风险。

6.4.14 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

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	932,996,015.02	76.86
	其中：股票	932,996,015.02	76.86
2	固定收益投资	74,059,280.00	6.10
	其中：债券	74,059,280.00	6.10
	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	194,865,779.90	16.05
6	其他各项资产	12,008,102.43	0.99
7	合计	1,213,929,177.35	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	占基金资产净值 比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	19,823,261.53	1.68
B	采掘业	55,077,679.50	4.67
C	制造业	546,965,325.08	46.39
C0	食品、饮料	64,393,560.00	5.46

C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	94,248,007.80	7.99
C5	电子	72,104,800.90	6.12
C6	金属、非金属	161,337,852.00	13.68
C7	机械、设备、仪表	115,940,091.55	9.83
C8	医药、生物制品	38,941,012.83	3.30
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	56,339,640.05	4.78
H	批发和零售贸易	65,785,896.80	5.58
I	金融、保险业	160,238,055.06	13.59
J	房地产业	27,102,138.00	2.30
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	1,664,019.00	0.14
M	综合类	-	-
	合计	932,996,015.02	79.13

7.3 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	600111	包钢稀土	2,980,000	105,819,800.00	8.98
2	600844	丹化科技	6,455,343	94,248,007.80	7.99
3	002214	大立科技	2,546,710	72,046,425.90	6.11
4	601601	中国太保	2,542,778	57,899,055.06	4.91
5	601166	兴业银行	2,500,000	57,575,000.00	4.88
6	000848	承德露露	1,584,260	57,033,360.00	4.84
7	600118	中国卫星	3,599,977	56,339,640.05	4.78
8	000762	西藏矿业	2,159,909	55,077,679.50	4.67
9	002223	鱼跃医疗	1,560,000	55,036,800.00	4.67
10	002091	江苏国泰	2,154,000	47,948,040.00	4.07
11	600038	哈飞股份	1,728,080	35,097,304.80	2.98
12	601169	北京银行	2,800,000	33,964,000.00	2.88
13	600549	厦门钨业	1,711,360	31,146,752.00	2.64
14	600383	金地集团	4,472,300	27,102,138.00	2.30

15	600456	宝钛股份	1,270,000	24,371,300.00	2.07
16	600055	万东医疗	1,473,025	22,198,486.75	1.88
17	600354	敦煌种业	1,012,402	18,891,421.32	1.60
18	600713	南京医药	1,347,800	14,178,856.00	1.20
19	600869	三普药业	1,069,959	13,235,392.83	1.12
20	000538	云南白药	195,560	12,613,620.00	1.07
21	601998	中信银行	2,000,000	10,800,000.00	0.92
22	600267	海正药业	300,000	7,545,000.00	0.64
23	000596	古井贡酒	174,000	7,360,200.00	0.62
24	600664	哈药股份	300,000	5,547,000.00	0.47
25	300022	吉峰农机	100,522	3,659,000.80	0.31
26	002249	大洋电机	150,000	3,607,500.00	0.31
27	300027	华谊兄弟	52,826	1,664,019.00	0.14
28	002041	登海种业	19,099	931,840.21	0.08
29	300077	国民技术	500	58,375.00	0.00

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	600844	丹化科技	134,590,437.97	13.34
2	600111	包钢稀土	116,827,405.09	11.58
3	002214	大立科技	107,891,767.59	10.69
4	601166	兴业银行	78,120,058.36	7.74
5	601601	中国太保	74,796,859.07	7.41
6	600118	中国卫星	66,332,603.25	6.57
7	000848	承德露露	62,374,739.37	6.18
8	600456	宝钛股份	61,948,242.16	6.14
9	002091	江苏国泰	61,376,697.00	6.08
10	601318	中国平安	57,896,266.77	5.74
11	600267	海正药业	57,763,008.63	5.72
12	000762	西藏矿业	57,467,347.16	5.69
13	002223	鱼跃医疗	53,706,555.68	5.32
14	600198	大唐电信	51,501,242.81	5.10
15	002106	莱宝高科	50,681,306.74	5.02
16	600664	哈药股份	49,992,665.27	4.95
17	600383	金地集团	47,489,208.86	4.71
18	600038	哈飞股份	44,648,192.94	4.42

19	600050	中国联通	43,729,749.32	4.33
20	002038	双鹭药业	43,249,458.83	4.29
21	600750	江中药业	42,460,541.07	4.21
22	600549	厦门钨业	40,076,732.44	3.97
23	600810	神马股份	38,806,982.75	3.85
24	000400	许继电气	38,646,617.62	3.83
25	000969	安泰科技	38,422,243.53	3.81
26	600115	东方航空	37,900,080.37	3.76
27	002153	石基信息	37,626,099.18	3.73
28	600062	双鹤药业	37,414,929.10	3.71
29	600000	浦发银行	37,239,669.94	3.69
30	600869	三普药业	37,233,111.70	3.69
31	600739	辽宁成大	36,177,876.99	3.58
32	601169	北京银行	34,925,039.76	3.46
33	600055	万东医疗	34,755,820.17	3.44
34	600518	康美药业	32,513,084.53	3.22
35	600406	国电南瑞	31,639,367.40	3.14
36	600770	综艺股份	29,459,556.20	2.92
37	000024	招商地产	28,792,485.65	2.85
38	600583	海油工程	28,632,341.35	2.84
39	000623	吉林敖东	28,609,372.70	2.83
40	002261	拓维信息	28,485,946.75	2.82
41	600088	中视传媒	28,453,818.88	2.82
42	000786	北新建材	28,385,298.12	2.81
43	600195	中牧股份	28,384,612.10	2.81
44	000983	西山煤电	27,733,419.48	2.75
45	002007	华兰生物	27,201,170.82	2.70
46	002148	北纬通信	27,016,517.00	2.68
47	600054	黄山旅游	26,411,143.97	2.62
48	600536	中国软件	26,283,001.33	2.60
49	601998	中信银行	26,186,572.51	2.59
50	601999	出版传媒	26,044,169.28	2.58
51	002155	辰州矿业	25,946,624.81	2.57
52	000547	闽福发 A	25,852,451.30	2.56
53	600410	华胜天成	25,756,110.36	2.55
54	000999	华润三九	25,290,667.06	2.51
55	000538	云南白药	24,284,329.09	2.41
56	600036	招商银行	23,542,360.55	2.33
57	000060	中金岭南	23,478,011.68	2.33
58	600087	长航油运	23,468,645.12	2.33
59	600117	西宁特钢	22,755,505.04	2.25

60	000961	中南建设	22,328,059.62	2.21
61	600521	华海药业	22,268,237.60	2.21
62	600395	盘江股份	21,458,101.15	2.13
63	600354	敦煌种业	21,299,697.33	2.11
64	000655	金岭矿业	21,111,533.77	2.09
65	000977	浪潮信息	20,936,330.51	2.07
66	600048	保利地产	20,886,785.95	2.07
67	000933	神火股份	20,590,246.51	2.04
68	000612	焦作万方	20,384,461.10	2.02

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	600406	国电南瑞	103,603,236.18	10.27
2	600664	哈药股份	68,844,069.99	6.82
3	002106	莱宝高科	65,154,558.11	6.46
4	600770	综艺股份	62,587,232.61	6.20
5	601318	中国平安	59,524,624.41	5.90
6	600810	神马股份	58,619,371.19	5.81
7	600267	海正药业	51,376,435.52	5.09
8	000400	许继电气	49,652,985.64	4.92
9	600869	三普药业	49,426,294.38	4.90
10	600880	博瑞传播	45,482,862.34	4.51
11	600198	大唐电信	42,760,149.40	4.24
12	600750	江中药业	42,634,427.60	4.22
13	000969	安泰科技	40,364,198.03	4.00
14	600570	恒生电子	39,828,589.93	3.95
15	600050	中国联通	38,874,183.37	3.85
16	600000	浦发银行	38,031,343.41	3.77
17	002153	石基信息	37,265,916.85	3.69
18	600062	双鹤药业	37,087,397.00	3.68
19	601998	中信银行	36,367,280.50	3.60
20	002038	双鹭药业	36,113,592.57	3.58
21	600739	辽宁成大	35,666,791.94	3.53
22	002024	苏宁电器	35,078,866.02	3.48
23	600518	康美药业	34,270,193.66	3.40
24	600111	包钢稀土	34,033,051.20	3.37
25	000422	湖北宜化	33,143,922.23	3.28
26	600115	东方航空	32,301,067.67	3.20

27	600096	云天化	30,966,739.93	3.07
28	600195	中牧股份	30,625,463.51	3.03
29	600088	中视传媒	30,234,439.99	3.00
30	000568	泸州老窖	29,523,856.24	2.93
31	600519	贵州茅台	29,309,914.30	2.90
32	002007	华兰生物	29,261,306.71	2.90
33	000024	招商地产	28,388,094.69	2.81
34	601999	出版传媒	28,312,714.13	2.81
35	600054	黄山旅游	27,645,601.14	2.74
36	000759	武汉中百	27,453,758.00	2.72
37	002261	拓维信息	27,297,673.77	2.71
38	000786	北新建材	27,208,866.28	2.70
39	600456	宝钛股份	26,946,849.06	2.67
40	000596	古井贡酒	26,325,136.10	2.61
41	000983	西山煤电	26,270,158.00	2.60
42	600583	海油工程	25,921,642.72	2.57
43	002138	顺络电子	25,499,102.37	2.53
44	000401	冀东水泥	25,449,980.20	2.52
45	000623	吉林敖东	25,390,749.20	2.52
46	000060	中金岭南	25,168,067.16	2.49
47	000860	顺鑫农业	24,856,732.05	2.46
48	002214	大立科技	24,686,985.80	2.45
49	000538	云南白药	24,388,061.95	2.42
50	600089	特变电工	24,158,721.35	2.39
51	600410	华胜天成	24,072,026.89	2.39
52	600036	招商银行	23,827,987.96	2.36
53	000999	华润三九	23,663,684.05	2.34
54	601111	中国国航	23,523,751.10	2.33
55	600536	中国软件	23,186,017.47	2.30
56	000961	中南建设	22,831,503.00	2.26
57	600117	西宁特钢	22,547,264.55	2.23
58	000069	华侨城 A	22,170,012.87	2.20
59	002148	北纬通信	21,853,896.81	2.17
60	000977	浪潮信息	21,507,873.26	2.13
61	600521	华海药业	21,138,922.28	2.09
62	600087	长航油运	21,113,307.25	2.09
63	600376	首开股份	20,783,401.20	2.06
64	002155	辰州矿业	20,690,305.25	2.05
65	000612	焦作万方	20,325,190.99	2.01
66	601328	交通银行	20,305,735.40	2.01

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,999,746,961.64
卖出股票的收入（成交）总额	2,825,864,724.55

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	61,005,000.00	5.17
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	可转债	13,054,280.00	1.11
7	其他	-	-
8	合计	74,059,280.00	6.28

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	0801044	08 央票 44	300,000	30,528,000.00	2.59
2	0801032	08 央票 32	300,000	30,477,000.00	2.58
3	113001	中行转债	100,000	10,114,000.00	0.86
4	110003	新钢转债	28,000	2,940,280.00	0.25

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	1,723,363.58
2	应收证券清算款	3,261,004.47
3	应收股利	-
4	应收利息	737,311.04
5	应收申购款	6,286,423.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,008,102.43

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	2,940,280.00	0.25

7.9.5 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。

7.9.6 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。

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
30,385	40,987.61	317,224,511.27	25.47%	928,184,079.33	74.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年4月23日)基金份额总额	3,173,064,234.06
本报告期期初基金份额总额	967,010,645.83
本报告期基金总申购份额	673,880,966.44
减：本报告期基金总赎回份额	395,483,021.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,245,408,590.60

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

本基金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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内聘用江苏公证天业会计师事务所。该会计师事务所从 2008 年提供审计服务至今。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金本报告期内基金管理人、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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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	
东吴证券	2	1,319,591,691.10	22.65%	1,115,284.62	22.90%	-
平安证券	1	784,257,250.44	13.46%	666,619.39	13.69%	-
华泰联合证券	1	693,888,718.14	11.91%	563,790.13	11.58%	-
长城证券	1	675,453,861.04	11.59%	548,812.20	11.27%	-
国元证券	1	661,480,160.60	11.36%	562,256.85	11.54%	-
中信证券	1	404,401,975.53	6.94%	343,739.32	7.06%	-
光大证券	1	365,838,290.92	6.28%	297,245.95	6.10%	-
中银国际	1	266,158,290.03	4.57%	216,253.69	4.44%	-
招商证券	1	250,119,837.69	4.29%	212,600.60	4.37%	-
渤海证券	1	187,795,526.96	3.22%	159,625.51	3.28%	-
中投证券	1	127,218,495.11	2.18%	108,134.47	2.22%	-
财富证券	1	89,232,338.63	1.53%	75,847.25	1.56%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
合计	14	5,825,436,436.19	100.00%	4,870,209.98	100.00%	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

本报告期本基金无交易单元变更情况。

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		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	-	-	200,000,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	3,855,592.90	11.76%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	18,822,667.76	57.40%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	10,111,168.50	30.84%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
合计	32,789,429.16	100.00%	200,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 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基金增加上海证券有限责任公司为代销机构并开通转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-14
2	《东吴行业轮动股票型证券投资基金2009年第4季度报告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-20
3	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-28
4	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在深圳发展银行股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-28

5	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国银河证券股份有限公司推出定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-17
6	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通基金转换业务的公告季度报告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-25
7	《东吴行业轮动股票型证券投资基金2009年年度报告摘要》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-27
8	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司延长网上银行基金申购费率及定投申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-01
9	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司延长“金融@家”电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-01
10	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在东方证券股份有限公司网上交易、电话、手机交易系统委托申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-06
11	《东吴行业轮动股票型证券投资基金2010年第1季度报告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-22
12	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在深圳发展银行股份有限公司推出基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-29
13	《东吴基金管理有限公司关于在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-06
14	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在南京证券有限责任公司网上交易、电话委托、手机委托系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-20
15	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中信银行股份有限公司推出定期定额业务同时参与个人网银申购开放式基金费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-01
16	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-02
17	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在申银万国证券股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-03
18	《东吴行业轮动股票型证券投资基金更新招募说明书摘要》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-04
19	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金推出定期定额投资业务并参与网上交易	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-24

	申购费率优惠公告的备案报告》		
20	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国邮政储蓄银行网上交易系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-25
21	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司延长网上银行基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准东吴行业轮动股票型证券投资基金设立的文件；
2. 《东吴行业轮动股票型证券投资基金基金合同》；
3. 《东吴行业轮动股票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. 报告期内东吴行业轮动股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

12.3 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。

东吴基金管理有限公司
二〇一〇年八月二十四日