

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
报告送出日期:二〇一二年八月二十五日

1.1 重要提示

基金管理人和基金托管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，并对内容的真实性、准确性、完整性、及时性、合法性承担责任。本基金在2012年8月15日复权后的报告期净值为1.00元，即复权后的基金份额净值。

基金管理人和基金托管人承诺，遵守《基金法》及《运作办法》等有关法律法规的规定，恪守职业道德，诚实信用，勤勉尽责地管理基金资产，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，在投资前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘录了半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本公司中财财务资料未经审计。

本报告书于2012年3月9日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴深证100指数增强型证券投资基金 LOF
基金主代码	165806
交易代码	165806
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9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
报告期末基金份额总额	175,233,549.69份
基金成立以来累计净值	不定期
基金名称	深圳证券交易所
上市日期	2012年4月27日

2.2 基金产品说明

本基金为股票型指数增强基金，在力图超越指数的基础上进行有效的风险管理，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金的长期增值。

本基金力争使年度跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证100价格指数，即按照该指数的成份股及其权重构建基金股票组合，并根据股票的成份股及其权重定期进行调整。

本基金在严格控制跟踪误差的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。

本基金业绩比较基准为95%×深证100价格指数收益率+5‰×商业银行银行存款利息(税后)。

本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	黄忠平	尹东
联系电话	021-5098888-8219	010-67595003
电子邮箱	huangzh@scfund.com.cn	yindong.z@ccb.com

客户服务电话 021-509666-400-8211 010-67595096

传真 021-509888-8211 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互

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

3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年6月30日)

本期利润 -12,791,186.57

加权平均基金份额本期利润 -0.0460

本期基金份额净值增长率 -7.20%

3.2 期末数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.0718

期末基金份额净值 162,654,165.35

期末基金份额净值增长率 0.928

注:本基金业绩比较基准-95%×深证100价格指数收益率+4‰×商业银行银行存款利息(税后)。

3.2.2 本基金的收益分配政策以基金份额净值增长率为基准计算，具体见本基金的《基金合同》。

东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)份额累计净值增长率历史走势对比如图

2012年3月9日至2012年6月30日

东吴深证100指数增强型证券投资基金 LOF)

2012牛年度报告摘要

报告期(2012年3月9日至6月30日)

本期末 2012年6月30日

资产 14,789,710.35

结算准备金 1,724,193.41

交易性金融资产 156,828,851.58

其中：股票投资 153,798,851.58

基金投资 -

债券投资 3,030,000.00

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 3,871,161.47

应收利息 36,223.31

应收股利 -

应收申购款 2,179.08

递延所得税资产 -

其他资产 51,380.86

资产总计 177,303,700.06

负债和所有者权益 177,303,700.06

负债 2012年6月30日

短期借款 -

应付票据 -

应付账款 -

预收款项 -

应付职工薪酬 11,084,351.76

应付手续费及佣金 -

应付股利 147,418.58

应付托管费 22,112.79

应付销售服务费 -

应付交易费用 213,874.65

应付税费 -

应付利息 522.22

应付利润 -

递延所得税负债 -

其他负债 214,190.63

负债合计 14,649,534.71

所有者权益 177,303,700.06

所有者权益合计 177,303,700.06

负债和所有者权益总计 177,303,700.06

负债 2012年6月30日

短期借款 -

应付票据 -

应付账款 -

预收款项 -

应付职工薪酬 1,067,531.52

应付手续费及佣金 -

应付股利 -

应付管理人报酬 1,361,870.85

应付托管费 189,759.04

应付销售服务费 -

应付交易费用 7,548.49

应付股利收入 -

买入返售金融资产收入 1,164,563.32

其他利得收入 -

投资收益 -244,988.92

其中：股票投资收益 -312,520.44

基金投资收益 -

债券投资收益 -

资产支持证券投资收益 -

衍生工具收益 -

股利收益 1,067,531.52

公允价值变动收益 -12,739,047.62

汇兑损益 -

其他收入 341,088.93

减：二、费用 1,510,109.81

1.管理人报酬 865,833.64

2.托管费 129,875.03

3.销售服务费 307,508.28

4.交易费用 4,644.44

5.利息支出 4,644.44

6.其他费用 202,249.42

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) -12,791,186.57

减：所得税费用 -

四、净利润(净亏损以“-”号填列) -12,791,186.57

注:本基金于2012年3月9日成立,基金合同生效日起至披露时点不满一年。

6.3 所有者权益变动表 报告期(2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年6月30日)

本期末 2012年6月30日

所有者权益合计 175,233,549.69

减：库存股 -12,579,384.34

所有者权益净额 162,654,165.35

注:本基金于2012年3月9日成立,基金合同生效日起至披露时点不满一年。

6.4 所有者权益变动表 报告期(2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年6月30日)

本期末 2012年6月30日

所有者权益变动表 14,789,710.35

注:本基金于2012年3月9日成立,基金合同生效日起至披露时点不满一年。

6.5 所有者权益变动表 报告期(2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年6月30日)

本期末 2012年6月30日

所有者权益变动表 171,120.70

注:本基金于2012年3月9日成立,基金合同生效日起至披露时点不满一年。

6.6 所有者权益变动表 报告期(2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年6月30日)

本期末 2012年6月30日

所有者权益变动表 14,789,710.35

注:本基金于2012年3月9日成立,基金合同生效日起至披露时点不满一年。

6.7 所有者权益变动表 报告期(2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年6月30日)

<p