

## 东吴行业轮动股票型证券投资基金

## [2013] 年度报告摘要

单位:人民币元

资产	本期末		上年度末		金额单位:人民币元
	2013年6月30日	2012年12月31日			
资产:					
银行存款	24,307,428.19	14,371,721.92			
结算备付金	15,059,391.55	4,965,302.60			
存出保证金	3,719,471.86	2,250,000.00			
交易性金融资产	1,537,040,230.61	2,214,549,623.21			
其中:股票投资	1,457,296,230.61	2,104,743,623.21			
基金投资	-	-			
债券投资	79,744,000.00	109,806,000.00			
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	-	75,048,129.15			
应收利息	1,718,401.80	939,750.17			
应收股利	-	-			
应收申购款	945,325.07	1,615,818.14			
递延所得税资产	-	-			
其他资产	-	-			
资产总计	1,582,790,249.08	2,313,740,345.19			
负债和所有者权益					
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	4,805,777.50	72,750,219.30			
应付赎回款	3,885,333.10	4,875,591.88			
应付托管人报酬	2,178,778.59	2,599,178.49			
应付托管费	363,129.76	433,196.40			
应付销售服务费	-	-			
应付交易费用	7,999,084.13	5,380,967.19			
应付税费	-	-			
应付利息	-	-			
应付利润	-	-			
递延所得税负债	-	-			
其他负债	699,291.03	2,655,003.29			
负债合计	19,931,394.11	88,694,156.55			
所有者权益:					
实收基金	2,687,769,741.43	3,132,622,828.33			
未分配利润	-1,124,910,886.46	-907,576,639.69			
所有者权益合计	1,562,858,854.97	2,225,046,188.64			
负债和所有者权益总计	1,582,790,249.08	2,313,740,345.19			
3.1 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			
性别:	吕鹏	郑鹏			
联系人:	021-5059888-8206	010-85286677			
电子邮箱:	lhvhu@efund.com.cn	zhjh@hb.com.cn			
客户服务电话:	021-5059966/400-811-0528	95577			
传真:	021-5059888-8211	010-8528680			
24 估值方法说明					
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址:	www.efund.com.cn				
基金半年度报告置地点:	基金管理人及托管人办公处				
3.3 主要财务指标和基金净值表现					
3.3.1 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(2013年1月1日至2013年6月30日)				
本期已实现收益	29,151,589.84				
本期利润	-338,876,146.88				
加权平均基金份额本期利润	-0.1179				
本期基金份额净值增长率	-18.13%				
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)				
期末可供分配基金份额利润	-0.4185				
期末基金净值	1,562,858,854.97				
期末基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	0.5815%				
注:1、本期实现收益基金本期利润收入,投资收益、其他收入、含各公允价值变动收益、减除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本部分的公允价值变动收益。 2、本期利润可按一定比例计提未分配利润和未分配利润中已实现部分的预提数。 3、本基金的利润分配政策包括但不限于认购或交回基金的客户费用,例如基金管理的认购、申购、赎回等,计入费用后实际收益水平将低于所列示的基金净值。					
3.2 基金净值表现					
3.2.1 基金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	
过去一个月	-18.85%	2.25%	-11.75%	1.41%	-7.10%
过去三个月	-14.31%	1.87%	-8.61%	1.10%	-5.70%
过去六个月	-18.13%	1.79%	-8.93%	1.13%	-9.20%
过去一年	-20.68%	1.82%	-7.01%	1.03%	-13.67%
过去三年	-34.52%	1.78%	-8.16%	1.03%	-26.36%
过去五年	-28.89%	1.75%	-10.44%	1.34%	-18.45%
自基金合同生效起至今	-38.01%	1.74%	-19.50%	1.40%	-18.51%
3.2.2 本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较					
3.3 会计数据和分析					
3.3.1 本期报告期与上年同期相比,本基金的资产情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.2 本期报告期与上年同期相比,本基金的负债情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.3 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.4 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.5 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.6 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.7 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.8 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.9 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.10 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.11 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.12 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.13 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.14 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.15 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.16 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.17 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.18 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.19 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.20 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.21 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.22 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.23 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.24 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.25 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.26 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.27 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.28 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.29 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.30 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.31 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.32 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.33 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.34 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.35 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.36 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.37 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.38 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.39 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.40 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.41 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.42 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.43 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.44 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.45 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.46 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.47 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.48 本期报告期与上年同期相比,本基金的收入情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当说明。					
3.3.49 本期报告期与上年同期相比,本基金的费用情况、投资策略、投资组合报告等发生重大变化,对本期业绩产生影响的,应当					