

# 东吴保本混合型证券投资基金

## 2015 半年度报告摘要

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      | --             | --           |
| 3  | 金融债券      | --             | --           |
| 4  | 政府/政策性金融债 | 170,808,549.20 | 98.19        |
| 5  | 企业债/短期融资券 | --             | --           |
| 6  | 中期票据      | 70,820,000.00  | 40.71        |
| 7  | 可转债       | --             | --           |
| 8  | 其他        | --             | --           |
| 9  | 合计        | 241,628,549.20 | 138.90       |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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  | 124315  | 13国债(3) | 400,000 | 40,684,000.00 | 23.30        |
| 2  | 124241  | 13国债(1) | 200,000 | 20,446,000.00 | 11.75        |
| 3  | 1203426 | 12国债(7) | 200,000 | 20,228,000.00 | 11.63        |
| 4  | 1203102 | 13国债(1) | 200,000 | 20,160,000.00 | 11.59        |
| 5  | 1203102 | 13国债(1) | 200,000 | 20,120,000.00 | 11.57        |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本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。

7.12.3 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   | 17,173.10    |
| 2  | 应收证券清算款 | --           |
| 3  | 应收股利    | --           |
| 4  | 应收利息    | 4,426,132.35 |
| 5  | 应收申购款   | 21,816.46    |
| 6  | 其他应收款   | --           |
| 7  | 待摊费用    | --           |
| 8  | 其他      | --           |
| 9  | 合计      | 4,465,125.91 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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中不存在流通受限情况。

7.12.6 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

8.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有户数(户) | 户均持有的基金份额 | 机构投资者持有份额      | 个人投资者持有份额 |
|---------|-----------|----------------|-----------|
| 1,006   | 76,376.20 | 10,000,600.00  | 67.7%     |
|         |           | 137,791,208.15 | 103.23%   |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金股票总量区间的情况

注:高级管理人员、基金投资和研究人员及其直系亲属均未持有本基金份额。

9 开放式基金业绩变动

单位:份

| 基金合同生效日:2015年6月13日    | 基金份额总额         | 775,672,462.62 |
|-----------------------|----------------|----------------|
| 本报告期初基金份额总额           | 775,672,462.62 |                |
| 本报告期间基金总申购减:本报告期间基金总回 | 4,915,827.54   |                |
| 减:本报告期间基金总回           | 49,948,080.97  |                |
| 本报告期间基金份额总额           | 147,791,808.15 |                |

注:1.如本报告期间发生转换入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务份额;

2.如本报告期间发生转换转出业务,则总赎回份额中包含该业务份额。

10.3 基金份额持有人大会决议

10.4 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

2015年6月23日,东吴基金管理有限公司召开2015年第一次临时股东大会,会议审议通过,全体股东一致通过以下议案:

(1) 同意选举李生先生为公司第二届董事会独立董事,第二届董事会独立董事候选人简历如下:

(2) 同意聘任李生先生为公司第二届董事会独立董事,第二届董事会独立董事候选人简历如下:

(3) 同意聘任李生先生为公司第二届董事会独立董事,第二届董事会独立董事候选人简历如下:

(4) 同意聘任李生先生为公司第二届董事会独立董事,第二届董事会独立董事候选人简历如下:

本报告期基金管理人无重大人事变动。

10.5 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金资产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.6 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未改变。

10.7 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期间聘用天衡会计师事务所(特殊普通合伙)担任本基金会计师事务所。

10.8 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(1) 管理人及其高级管理人员、基金经理和其他投资管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

(2) 报告期内,中国证券投资基金业协会对东吴基金管理有限公司进行了检查,未发现违法违规事实,未发现违法违规事实。

(3) 报告期内,中国证监会对东吴基金管理有限公司进行了检查,未发现违法违规事实。

(4) 报告期内,中国证监会对东吴基金管理有限公司进行了检查,未发现违法违规事实。

10.9 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.9.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易成交金额     | 占当期股票成交金额比例 | 佣金       | 占当期佣金比例 | 备注 |
|------|--------|--------------|-------------|----------|---------|----|
| 东方证券 | 1      | 6,026,760.24 | 41.26%      | 6,120.51 | 41.11%  | -- |
| 申银万国 | 1      | 5,849,832.00 | 39.07%      | 5,326.70 | 35.72%  | -- |
| 招商证券 | 1      | 3,904,853.11 | 23.41%      | 3,455.47 | 23.17%  | -- |
| 中国银河 | 2      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 浙商证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 华泰证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 金元证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 中信建投 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 国海证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 华泰证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 中信证券 | 2      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 方正证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 安信证券 | 2      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 爱建证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 东吴证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 国信证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 华泰证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 中信证券 | 2      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 长江证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 平安证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 华安证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 东吴证券 | 2      | --           | --          | --       | --      | -- |
| 招商证券 | 1      | --           | --          | --       | --      | -- |

注:1.租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括:证券公司基本评价(财务状况、资信状况、经营情况)、证券公司研究能力评价(报告质量、及时性、数量)、证券公司信息服务评价(全面性、及时性、及时性)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,然后根据考评指标对证券公司进行综合评价,最后根据综合评价结果选择租用证券公司专用交易单元。

2.本期租用证券公司交易单元的情况

本基金本报告期新增3个交易单元:华泰证券、首创证券。

10.9.2 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 | 债券交易成交金额       | 占当期债券成交金额比例 | 佣金                | 占当期佣金比例 | 权证交易成交金额 | 占当期权证成交金额比例 |
|------|----------------|-------------|-------------------|---------|----------|-------------|
| 东方证券 | 36,226,067.94  | 11.16%      | 1,389,050.000.00  | 9.25%   | --       | --          |
| 申银万国 | 131,007,687.79 | 41.44%      | 12,571,400.000.00 | 84.10%  | --       | --          |
| 招商证券 | 10,049,461.08  | 3.18%       | 988,070.000.00    | 6.61%   | --       | --          |
| 中国银河 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 方正证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 安信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 爱建证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 国信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 中信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 长江证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 平安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 招商证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |

注:1.租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括:证券公司基本评价(财务状况、资信状况、经营情况)、证券公司研究能力评价(报告质量、及时性、数量)、证券公司信息服务评价(全面性、及时性、及时性)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,然后根据考评指标对证券公司进行综合评价,最后根据综合评价结果选择租用证券公司专用交易单元。

2.本期租用证券公司交易单元的情况

本基金本报告期新增3个交易单元:华泰证券、首创证券。

10.9.2 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 | 债券交易成交金额       | 占当期债券成交金额比例 | 佣金                | 占当期佣金比例 | 权证交易成交金额 | 占当期权证成交金额比例 |
|------|----------------|-------------|-------------------|---------|----------|-------------|
| 东方证券 | 36,226,067.94  | 11.16%      | 1,389,050.000.00  | 9.25%   | --       | --          |
| 申银万国 | 131,007,687.79 | 41.44%      | 12,571,400.000.00 | 84.10%  | --       | --          |
| 招商证券 | 10,049,461.08  | 3.18%       | 988,070.000.00    | 6.61%   | --       | --          |
| 中国银河 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 方正证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 安信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 爱建证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 国信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 中信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 长江证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 平安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 招商证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |

注:1.租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括:证券公司基本评价(财务状况、资信状况、经营情况)、证券公司研究能力评价(报告质量、及时性、数量)、证券公司信息服务评价(全面性、及时性、及时性)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,然后根据考评指标对证券公司进行综合评价,最后根据综合评价结果选择租用证券公司专用交易单元。

2.本期租用证券公司交易单元的情况

本基金本报告期新增3个交易单元:华泰证券、首创证券。

10.9.2 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 | 债券交易成交金额       | 占当期债券成交金额比例 | 佣金                | 占当期佣金比例 | 权证交易成交金额 | 占当期权证成交金额比例 |
|------|----------------|-------------|-------------------|---------|----------|-------------|
| 东方证券 | 36,226,067.94  | 11.16%      | 1,389,050.000.00  | 9.25%   | --       | --          |
| 申银万国 | 131,007,687.79 | 41.44%      | 12,571,400.000.00 | 84.10%  | --       | --          |
| 招商证券 | 10,049,461.08  | 3.18%       | 988,070.000.00    | 6.61%   | --       | --          |
| 中国银河 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 方正证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 安信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 爱建证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 国信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 中信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 长江证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 平安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 招商证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |

注:1.租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括:证券公司基本评价(财务状况、资信状况、经营情况)、证券公司研究能力评价(报告质量、及时性、数量)、证券公司信息服务评价(全面性、及时性、及时性)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,然后根据考评指标对证券公司进行综合评价,最后根据综合评价结果选择租用证券公司专用交易单元。

2.本期租用证券公司交易单元的情况

本基金本报告期新增3个交易单元:华泰证券、首创证券。

10.9.2 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 | 债券交易成交金额       | 占当期债券成交金额比例 | 佣金                | 占当期佣金比例 | 权证交易成交金额 | 占当期权证成交金额比例 |
|------|----------------|-------------|-------------------|---------|----------|-------------|
| 东方证券 | 36,226,067.94  | 11.16%      | 1,389,050.000.00  | 9.25%   | --       | --          |
| 申银万国 | 131,007,687.79 | 41.44%      | 12,571,400.000.00 | 84.10%  | --       | --          |
| 招商证券 | 10,049,461.08  | 3.18%       | 988,070.000.00    | 6.61%   | --       | --          |
| 中国银河 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 方正证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 安信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 爱建证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 国信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华泰证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 中信证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 长江证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 平安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 华安证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 东吴证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |
| 招商证券 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |

注:1.租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括:证券公司基本评价(财务状况、资信状况、经营情况)、证券公司研究能力评价(报告质量、及时性、数量)、证券公司信息服务评价(全面性、及时性、及时性)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,然后根据考评指标对证券公司进行综合评价,最后根据综合评价结果选择租用证券公司专用交易单元。

2.本期租用证券公司交易单元的情况

本基金本报告期新增3个交易单元:华泰证券、首创证券。

10.9.2 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 | 债券交易成交金额       | 占当期债券成交金额比例 | 佣金                | 占当期佣金比例 | 权证交易成交金额 | 占当期权证成交金额比例 |
|------|----------------|-------------|-------------------|---------|----------|-------------|
| 东方证券 | 36,226,067.94  | 11.16%      | 1,389,050.000.00  | 9.25%   | --       | --          |
| 申银万国 | 131,007,687.79 | 41.44%      | 12,571,400.000.00 | 84.10%  | --       | --          |
| 招商证券 | 10,049,461.08  | 3.18%       | 988,070.000.00    | 6.61%   | --       | --          |
| 中国银河 | --             | --          | --                | --      | --       | --          |