

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
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会对本基金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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同约定，于2012年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
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该基金的招募说明书。
本报告期从2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东吴中证新兴产业指数
基金主代码	585001
交易代码	585001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年2月1日
报告期末基金份额总额	1,852,920,256.68份
投资目标	本基金将采用指数化投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的跟踪效果。
投资策略	本基金将通过采用指数化投资策略，选择中证新兴产业指数作为跟踪标的，投资于成份股、权证、债券、现金等金融工具，构建基金份额净值投资组合，为投资者获取新兴产业成长所带来的投资收益。
业绩比较基准	95%×中证新兴产业指数收益率+5%×银行存款利率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，风险收益特征与混合型基金、紧密跟踪中证新兴产业指数的基金和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -62,014,298.48

2.本期利润 22,663,216.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0121

4.期末基金份额净值 1,279,978,824.88

5.期末基金份额总额 0.691

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和相关费用的余额，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.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，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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	净值增长 率①	净值增长 率标准差 率②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 率④	①-③	②-④
过去三个月	1.77%	1.13%	1.27%	1.15%	0.50%	-0.02%

注:比较基准:95%×中证新兴产业指数收益率+5%×银行同业存款利率

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

东吴中证新兴产业指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2011年1月1日至2012年6月30日)

注:1.本基金为契约型开放式基金，其收益分配方式为现金分红。
2.本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较