# 东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

## 【2013】第二季度报告

**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：二〇一三年七月十八日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东吴进取策略混合 |
| 基金主代码 | 580005 |
| 交易代码 | 580005 |
| 前端交易代码 | – |
| 后端交易代码 | – |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年5月6日 |
| 报告期末基金份额总额 | 621,362,718.55份 |
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，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，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。 |
| 业绩比较基准 | 65%＊沪深300指数+35%＊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混合型基金，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。 |
| 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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2013年4月1日 – 2013年6月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 29,737,801.01 |
| 2.本期利润 | –754,925.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | –0.0012 |
| 4.期末基金资产净值 | 607,742,504.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9781 |

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、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要低于所列数字。

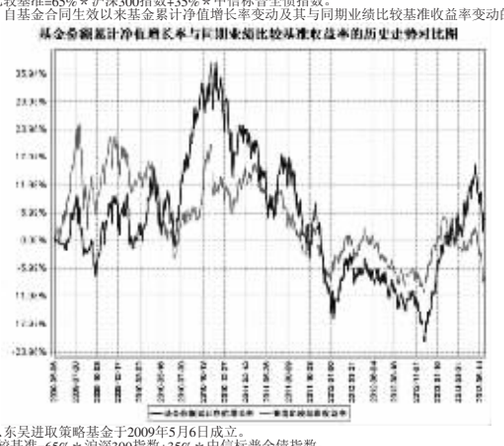
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | –0.11% | 1.40% | –7.33% | 0.95% | 7.22% | 0.45% |

注：比较基准=65%＊沪深300指数+35%＊中信标普全债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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




注：1、东吴进取策略基金于2009年5月6日成立。

2、比较基准=65%＊沪深300指数+35%＊中信标普全债指数。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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 | | |
| 唐祝益 | 本基金基金经理、公司权益类投资总监兼投资管理部总经理 | 2012年4月6日 | – | 13.5年 | 经济学硕士，南京大学毕业，曾任上海证券综合研究有限公司证券分析师、华鑫证券投资经理、海通证券投资经理等职；2009年8月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司投资管理部总经理助理、投资管理部副总经理、公司投资副总监、东吴嘉禾优势精选混合基金基金经理，现担任公司权益类投资总监兼投资管理部总经理、东吴进取策略混合基金基金经理、东吴双动力股票基金基金经理。 |

注：1、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

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》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，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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 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 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

2013年二季度，A股市场结构分化加剧，沪深300期间涨幅为–11.8%，而中小板、创业板指数涨幅分别为–3.72%与16.76%。从申万行业指数看，只有电子、信息设备、信息服务获得正收益，其余行业全部下跌，与投资相关的有色、黑色金属、化工、采掘等行业表现较差，下跌幅度超过15%。

本基金继续坚持在日常消费、医药等领域的核心配置，根据行业景气周期的判断，相对增加了电子、汽车等行业的配置，减少了金融的持仓，较为有效的规避了市场下跌的风险。

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0.9781元，累计净值1.0481元；本报告期份额净值增长率–0.11%，同期业绩比较基准收益率为–7.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内经济在去杠杆的主旨下，依旧会维持较弱的局面，美国经济复苏导致QE退出，进而引发资金外流的担忧，流动性与基本面的因素会一直困扰A股市场。从这个角度来看，A股市场的结构性行情还不会有大的变化，受益于经济转型、产业转移的消费、电子、传媒、医药等行业还会受到市场的追捧，而房地产、固定资产投资等相关行业的估值还会受到压制。

但是我们应当看到，经过长达半年的结构性行情，行业的估值差异已经到了历史高位，成长股的估值泡沫开始显现，一旦业绩不达预期，个股的风险就相当大。我们将从业绩出发，认真甄别个股，在优势行业寻找真正有业绩支撑的个股。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 470,804,189.39 | 77.07 |
| | 其中：股票 | 470,804,189.39 | 77.07 |
| 2 | 固定收益投资 | 71,569,403.55 | 11.72 |
| | 其中：债券 | 71,569,403.55 | 11.72 |
| | 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 | 67,196,901.98 | 11.00 |
| 6 | 其他资产 | 1,329,632.33 | 0.22 |
| 7 | 合计 | 610,900,127.25 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 18,392,760.44 | 3.03 |
| B | 采矿业 | 1,085,051.24 | 0.18 |
| C | 制造业 | 379,954,961.39 | 62.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 8,266,022.13 | 1.36 |
| F | 批发和零售业 | 17,824,610.45 | 2.93 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | – | – |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,541,822.20 | 0.58 |
| J | 金融业 | 22,586,927.44 | 3.72 |
| K | 房地产业 | 7,173,544.64 | 1.18 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,583,750.36 | 0.92 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | – | – |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,394,739.10 | 1.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | – | – |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 470,804,189.39 | 77.47 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600867 | 通化东宝 | 2,519,818 | 37,520,090.02 | 6.17 |
| 2 | 600305 | 恒顺醋业 | 1,252,656 | 31,604,510.88 | 5.20 |
| 3 | 000625 | 长安汽车 | 2,926,170 | 27,184,119.30 | 4.47 |
| 4 | 601633 | 长城汽车 | 759,940 | 26,917,074.80 | 4.43 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 2,407,988 | 22,586,927.44 | 3.72 |
| 6 | 000895 | 双汇发展 | 540,092 | 20,761,136.48 | 3.42 |
| 7 | 601965 | 中国汽研 | 2,039,310 | 18,863,617.50 | 3.10 |
| 8 | 000800 | 一汽轿车 | 1,504,220 | 18,501,906.00 | 3.04 |
| 9 | 002477 | 雏鹰农牧 | 1,164,836 | 18,392,760.44 | 3.03 |
| 10 | 600703 | 三安光电 | 916,531 | 18,000,668.84 | 2.96 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 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 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | 71,569,403.55 | 11.78 |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 71,569,403.55 | 11.78 |

5.5 报告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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 110003 | 新钢转债 | 163,500 | 17,028,525.00 | 2.80 |
| 2 | 113003 | 重工转债 | 100,000 | 10,932,000.00 | 1.80 |
| 3 | 113001 | 中行转债 | 104,910 | 10,502,540.10 | 1.73 |
| 4 | 113002 | 工行转债 | 95,520 | 10,447,977.60 | 1.72 |
| 5 | 110016 | 川投转债 | 73,650 | 8,896,920.00 | 1.46 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 333,015.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 476,962.30 |
| 5 | 应收申购款 | 519,654.78 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,329,632.33 |

5.9.4 报告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 | 17,028,525.00 | 2.80 |
| 2 | 113003 | 重工转债 | 10,932,000.00 | 1.80 |
| 3 | 113001 | 中行转债 | 10,502,540.10 | 1.73 |
| 4 | 113002 | 工行转债 | 10,447,977.60 | 1.72 |
| 5 | 110016 | 川投转债 | 8,896,920.00 | 1.46 |
| 6 | 110017 | 中海转债 | 8,123,493.00 | 1.34 |
| 7 | 110015 | 石化转债 | 3,484,716.20 | 0.57 |
| 8 | 126729 | 燕京转债 | 1,938,189.85 | 0.32 |
| 9 | 110011 | 歌华转债 | 170,975.00 | 0.03 |
| 10 | 110018 | 国电转债 | 44,066.80 | 0.01 |

5.9.5 报告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。

5.9.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 706,684,571.42 |
| 本报告期基金总申购份额 | 50,391,552.25 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 135,713,405.12 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | – |
| 本报告期期末基金份额总额 | 621,362,718.55 |

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。

### §7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金合同）；

3、东吴进取策略灵活配置混合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、报告期内东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

8.3 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 / 400–821–0588

**东吴基金管理有限公司**

2013年7月18日

# 东吴新产业精选股票型证券投资基金

## 【2013】第二季度报告

**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：二〇一三年七月十八日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东吴新产业精选股票 |
| 基金主代码 | 580008 |
| 交易代码 | 580008 |
| 前端交易代码 | – |
| 后端交易代码 | – |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年9月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,989,918.08份 |
| 投资目标 | 本基金为股票型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享新兴产业所带来的投资机会，追求超越市场的收益。 |
| 投资策略 | 本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。 |
| 业绩比较基准 | 75%＊中证新兴产业指数+25%＊中国债券综合全价指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只进行主动投资的股票型基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益较高的基金产品。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2013年4月1日 – 2013年6月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 5,938,593.00 |
| 2.本期利润 | 1,222,426.69 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0243 |
| 4.期末基金资产净值 | 53,167,288.12 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.043 |

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、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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.17% | 1.71% | –2.69% | 1.24% | 5.86% | 0.47% |

注：比较基准= 75%＊中证新兴产业指数收益率 +25%＊中国债券综合全价指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注：1.比较基准= 75%＊中证新兴产业指数收益率 +25%＊中国债券综合全价指数收益率

2.本基金于2011年9月28日成立。按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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 | | |
| 刘元海 | 本基金的基金经理 | 2011年10月26日 | – | 9年 | 博士，同济大学毕业。2004年2月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理等职务；现担任东吴新产业精选股票基金经理、东吴内需增长混合型证券投资基金经理。 |
| 任壮 | 本基金基金经理、公司权益类投资副总监 | 2011年9月28日 | 2013年6月5日 | 8.5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月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司基金经理助理、研究策划部总经理助理，公司研究副总监兼研究策划部副总经理、东吴新经济股票基金基金经理等职，现担任公司权益类投资副总监兼东吴行业轮动股票基金基金经理。 |

注：1、任壮为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；其他日期均为公司对外公告之日。

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》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，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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 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 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

2013年2季度上证指数先涨后跌，特别是6月份，由于投资者担心央行货币政策收紧致使实体经济去杠杆导致经济更差，在此预期下6月份上证指数出现大幅下跌。2季度，上证指数下跌11.51%；中小板下跌3.24%；但创业板上涨了16.76%。从市场风格和行业表现看，2季度创业板和中小板股票表现要强于大盘股，医药、信息技术、食品等消费成长型行业表现继续强于周期性行业。

出于对1季度经济增速低于预期的担忧，4月份本基金降低仓位以防御为主；5月份增加了新能源汽车产业链和LED行业的配置，并在医药股调整时继续增加医药行业的配置。从仓位看，2季度本基金仓位基本控制在85%左右波动。2季度本基金净值继续保持正增长，并跑赢比较基准。

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1.043元，累计净值1.043元；本报告期份额净值增长率3.17%，同期业绩比较基准收益率为–2.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，在“扭好增量、盘活存量”货币政策取向下，清理影子银行收紧货币将是今后比较长时期内一个趋势。因此从中长期看，对宏观经济影响将是去杠杆、去产能。对于产能过剩的行业而言，将要经历一个比较长时间痛苦过程。在这个过程中，谁率先去产能实现市场集中度提高，谁才有可能走出行业底谷。而面向消费终端的行业受负面影响相对较小些。因此对于本基金而言，配置上相对偏向新兴产业、消费成长类股票以及受益率先去产能和市场集中度提高具有定价权的行业。

从3季度看，我们判断货币收紧对A股市场快速冲击阶段已经过去，3季度对A股市场冲击关键因素是中报，要识别真成长和伪成长，真成长股票有望在下半年行情中胜出。因此，3季度本基金将加强研究去伪存真精选个股战略布局下半年。3季度乃至更长时期内，本基金相对看好以下几条主线：1)医药行业。从4月份开始，医药股已经开始调整，目前等待药品招标不明朗逐步确定以及年底估值切换，预期下半年投资机会将再现。2)信息技术行业。中长期看好LED、安防、通信行业，阶段性把握智能机、平板电脑产业链投资机会，关注超级本进展。3)汽车。等待中报不确定消除和旺季到来。4)化工。看好率先去产能和市场集中度提高具有定价权的染料和氨纶行业。

本基金将继续努力为投资者带来好的回报。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 46,136,566.47 | 83.83 |
| | 其中：股票 | 46,136,566.47 | 83.83 |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 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 | 7,010,217.03 | 12.74 |
| 6 | 其他资产 | 1,886,161.23 | 3.43 |
| 7 | 合计 | 55,032,944.73 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | – | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 37,641,753.67 | 70.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 1,488,600.00 | 2.80 |
| F | 批发和零售业 | – | – |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | – | – |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,599,612.80 | 4.89 |
| J | 金融业 | 2,949,800.00 | 5.55 |
| K | 房地产业 | 1,456,800.00 | 2.74 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | – | – |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 卫生和社会工作 | – | – |
| R | 文化、体育和娱乐业 | – | – |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 46,136,566.47 | 86.78 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600867 | 通化东宝 | 228,000 | 3,394,920.00 | 6.39 |
| 2 | 600352 | 浙江龙盛 | 279,894 | 2,625,405.72 | 4.94 |
| 3 | 002063 | 远光软件 | 179,904 | 2,599,612.80 | 4.89 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 70,617 | 2,495,604.78 | 4.69 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 86,000 | 2,266,960.00 | 4.26 |
| 6 | 600261 | 阳光照明 | 177,608 | 2,252,069.44 | 4.24 |
| 7 | 002241 | 歌尔声学 | 60,000 | 2,177,400.00 | 4.10 |
| 8 | 002005 | 德豪润达 | 210,000 | 1,953,000.00 | 3.67 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 200,000 | 1,876,000.00 | 3.53 |
| 10 | 000625 | 长安汽车 | 200,000 | 1,858,000.00 | 3.49 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 69,411.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 1,723.86 |
| 5 | 应收申购款 | 1,815,025.82 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,886,161.23 |

5.9.4 报告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。

5.9.5 报告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。

5.9.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 68,443,500.01 |
| 本报告期基金总申购份额 | 22,601,548.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 40,055,130.36 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | – |
| 本报告期期末基金份额总额 | 50,989,918.08 |

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。

### §7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴新产业精选股票型证券投资基金设立的文件；

2、东吴新产业精选股票型证券投资基金合同）；

3、东吴新产业精选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、报告期内东吴新产业精选股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

8.3 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 / 400–821–0588

**东吴基金管理有限公司**

2013年7月18日

# 东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）

## 【2013】第二季度报告

**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：二〇一三年七月十八日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东吴深证100指数增强(LOF)(场内简称：东吴100) |
| 基金主代码 | 165806 |
| 交易代码 | 165806 |
| 前端交易代码 | – |
| 后端交易代码 | – |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2012年3月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 141,893,782.54份 |
| 投资目标 | 本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。 |
| 投资策略 | 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，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后) |
| 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混合基金、债券基金与货币市场基金。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2013年4月1日 – 2013年6月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | –3,472,798.47 |
| 2.本期利润 | –11,564,063.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | –0.0801 |
| 4.期末基金资产净值 | 115,651,910.03 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.815 |

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、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要低于所列数字。

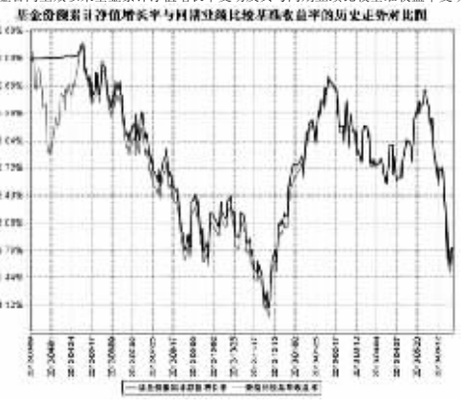
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | –9.14% | 1.48% | –10.13% | 1.51% | 0.99% | –0.03% |

注：基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）

3.2.2 自基金合同生效以来基金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




注：1、基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

2、本基金于2012年3月9日成立。按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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 | | |
| 周健 | 本基金基金经理 | 2013年6月5日 | – | 6.5年 | 硕士，南开大学毕业。曾就职于海通证券；2011年5月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研究策划部研究员，现担任东吴中证新兴指数基金基金经理、东吴新创业股票基金基金经理、东吴深证100指数增强型证券投资基金基金经理(LOF)。 |
| 唐祝益 | 本基金基金经理、公司权益类投资总监兼投资管理部总经理 | 2012年3月9日 | 2013年6月5日 | 13.5年 | 经济学硕士，南京大学毕业，曾任上海证券综合研究有限公司证券分析师、华鑫证券投资经理、海通证券投资经理等职；2009年8月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司投资管理部总经理助理、投资管理部副总经理、公司投资副总监、东吴嘉禾优势精选混合基金基金经理，现担任公司权益类投资总监兼投资管理部总经理、东吴进取策略混合基金基金经理、东吴双动力股票基金基金经理。 |
| 刘元海 | 本基金基金经理 | 2012年3月14日 | 2013年6月5日 | 9年 | 博士，同济大学毕业。2004年2月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理等职务；现担任东吴新产业精选股票基金经理、东吴内需增长混合基金基金经理。 |

注：1、唐祝益为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日，其他日期均指公司对外公告之日。

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》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