

东吴新创业股票型证券投资基金

[2012]第四季度报告

东吴新经济股票型证券投资基金

[2012]第四季度报告

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月十九日
§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司保证复核本报告，对本报告的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。

本基金报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 东吴新创业股票

基金主代码 588007

交易代码 588007

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2010年6月29日

报告期末基金份额总额 127,583,083.71份

投资目标 本基金为股票型基金，主要投资于市场中的创成长股票，通过精选具有价值创造的成长型股票，追求资本增值。

投资策略 本基金通过研究和挖掘行业，采用“自上而下”投资配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。

本基金通过分析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动态调整股票、债券、现金等大类资产的配置。

基金经理 李伟华

基金公司名称 东吴基金管理有限公司

§ 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(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -16,501,479.66

2.本期利润 -5,971,006.30

3.加权平均基金份额本期利润 0.0360

4.期末基金份额净值 109,660,532.94

5.期末可供分配基金份额利润 0.860

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 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.04% 1.04% 2.91% -1.03% -5.95% 0.01%

注:1.本基金业绩比较基准:中信标普200指数*50%+中信标普小盘指数*50%*50%+中信标普全债指数*25%

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

序号 期间 业绩比较基准收益率(%) 基金净值增长率(%) 备注

1 2010-06-29~2012-12-31 2.91% 81,338,612.71

注:1.此处在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》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在损害基金持有人利益的行为。

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的规定,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之间交易公平性差异的分析,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、风险管理等方面符合公平对待。

4.4 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,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。

4.5 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在损害基金持有人利益的行为。

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的规定,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之间交易公平性差异的分析,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、风险管理等方面符合公平对待。

4.7 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在损害基金持有人利益的行为。

4.8 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

4.9 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

4.10 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

4.11 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在不公平交易、内幕交易、利用未公开信息交易等违法违规行为。

4.12 投资者的风险提示

同一账户内持有的不同类型的理财产品存在不同的风险,如股市有较大的波动,可能会出现较大的损失。

对于风险承受能力较低的客户,建议购买货币市场基金、债券型基金等风险较低的理财产品。

对于风险承受能力较高的客户,建议购买股票型基金。

对于风险承受能力一般的客户,建议购买混合型基金。

对于风险承受能力较高的客户,建议购买股票型基金。

对于风险承受能力一般的客户,建议购买混合型基金。