东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17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	745,782,289.92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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-37,034,191.62
2.本期利润	14,699,051.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179
4.期末基金资产净值	622,893,857.34
5.期末基金份额净值	0.8352

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。

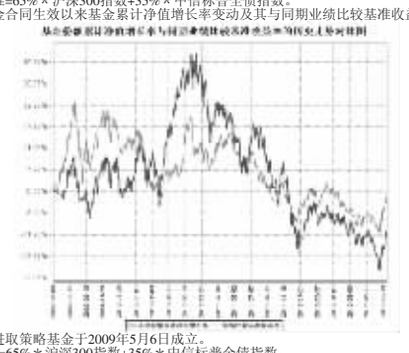
3.2 基金净值表现

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	2.35%	0.95%	6.87%	0.78%	-4.52%	0.17%

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	本基金的基金经理、公司投资副总监兼投资管理部总经理	2012年4月6日	-	13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,曾任东吴嘉禾优势精选混合基金基金经理,现担任投资副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、东吴深证100指数增强(LOF)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

2012年四季度,A股市场先抑后扬,沪深300的季度涨幅达到了10.02%,其中以早周期的地产、汽车板块涨幅最为明显,另外,低估值的银行板块也出现了大幅上涨,为近年来罕见。A股市场的大幅上涨,一方面与经济见底复苏相关,另一方面也与新领导层的一系列反腐、改革的表态密切相关,投资者信心得到了有效恢复。

本基金在过去的一个季度保持了稳定且较高的股票资产配置比例,并根据市场与基本面的变化作出了一定的调整,减少了部分防御类资产的配置比例,增加了金融服务等低估值板块的配置。

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0.8352元,累计净值0.9052元:本报告期份额净值增长率2.35%,同期业绩比较基准收益率为6.87%。

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2013年一季度,宏观经济将继续呈现弱复苏的状态,在产能过剩、房价较高的背景下,传统的经济增长方式已经不能持续,经济的复苏只是短期的复苏,中国经济的结构性矛盾并没有根本改变,要解决制约经济增长的长期问题,一方面需要创新、另一方面需要改革。

A股市场无疑已经走出了底部,随着社会资金成本的下降,A股再融资的放缓,股票市场的供求结构得到了修复,市场将围绕经济复苏与估值修复两大主题持续活跃。我们的投资还将坚持消费这个长期核心主题,在此基础上,适当增加低估值板块的配置,适当增加与改革主题相关板块的配置,以获得更好的收益。

§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	485,962,052.38	77.70
	其中:股票	485,962,052.38	77.70
2	固定收益投资	90,233,819.90	14.43
	其中:债券	90,233,819.90	14.43
	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	36,468,182.23	5.83
6	其他资产	12,801,870.65	2.05
7	合计	625,465,925.16	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	33,323,942.30	5.35
B	采掘业	-	-
C	制造业	297,552,990.65	47.77
C0	食品、饮料	67,478,758.75	10.83
C1	纺织、服装、皮毛	14,560,673.24	2.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	80,859,133.65	12.98
C5	电子	207,300.00	0.03
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	58,624,133.07	9.41
C8	医药、生物制品	75,822,991.94	12.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,785,046.00	0.77
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,597,018.80	0.74
H	批发和零售贸易	19,407,171.13	3.12
I	金融、保险业	103,993,072.50	16.70
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	22,302,811.00	3.58
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	485,962,052.38	78.02

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	000423	东阿阿胶	889,996	35,964,738.36	5.77
2	002477	雏鹰农牧	1,782,029	33,323,942.30	5.35
3	601633	长城汽车	1,274,944	30,216,172.80	4.85
4	600267	海正药业	1,870,392	27,850,136.88	4.47
5	000895	双汇发展	477,000	27,618,300.00	4.43
6	600030	中信证券	2,000,000	26,720,000.00	4.29
7	600587	新华医疗	748,391	23,282,444.01	3.74
8	600305	恒顺醋业	1,133,259	18,415,458.75	2.96
9	601601	中国太保	799,973	17,999,392.50	2.89
10	601166	兴业银行	1,000,000	16,690,000.00	2.68

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	90,233,819.90	14.49
8	其他	-	-
9	合计	90,233,819.90	14.49

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	113001	中行转债	300,000	28,905,000.00	4.64
2	110003	新钢转债	222,480	22,910,990.40	3.68
3	113002	工行转债	130,000	14,245,400.00	2.29
4	110016	川投转债	100,650	10,946,694.00	1.76
5	110017	中海转债	120,000	10,622,400.00	1.71

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 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	12,273,159.21
3	应收股利	-
4	应收利息	452,907.19
5	应收申购款	75,804.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,801,870.65

5.8.4 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	113001	中行转债	28,905,000.00	4.64
2	110003	新钢转债	22,910,990.40	3.68
3	113002	工行转债	14,245,400.00	2.29
4	110016	川投转债	10,946,694.00	1.76
5	110017	中海转债	10,622,400.00	1.71
6	126729	燕京转债	2,603,335.50	0.42

5.8.5 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。

5.8.6 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	984,179,613.35
本报告期基金总申购份额	6,374,184.24
减:本报告期基金总赎回份额	244,771,507.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	745,782,289.92

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1月19日

东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1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	东吴深证100指数增强(LOF)
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	167,706,176.37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跟踪,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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,694,583.78
2.本期利润	7,805,555.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0460
4.期末基金资产净值	150,226,672.93
5.期末基金份额净值	0.896

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。

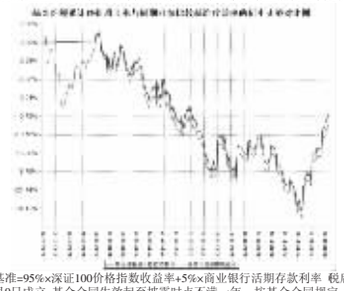
3.2 基金净值表现

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	5.54%	1.29%	4.92%	1.28%	0.62%	0.01%

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,基金合同生效起至披露时点不满一年。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	本基金基金经理	2012年3月14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、东吴深证100指数增强(LOF)基金经理。
唐祝益	本基金基金经理、公司投资副总监兼投资管理部总经理	2012年3月9日	-	13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,曾任东吴嘉禾优势精选混合基金基金经理,现担任投资副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、东吴深证100指数增强基金(LOF)基金经理、东吴双动力股票基金基金经理。

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,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。

4.4 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

数据显示,经济从三季度末开始温和复苏,主要动力就是基建投资加速和外需改善,刚刚召开的中央经济工作会议也表现出了较强的短期稳增长的政策取向,这降低了因为政府换届带来的政策不确定性。地产投资加速和房价上升共同推动房地产板块上涨,深100指数重仓地产行业,明显受益。但是,另一大重仓行业-白酒板块受增速下降和塑化剂风波的影响,远远跑输于大盘,对指数又形成拖累。由于指数对银行、券商等金融股的配置较少,在四季度的市场风格中,表现不及其他核心指数,如沪深300、上证50,两者在四季度涨幅均超过10%,大幅跑赢深100指数。报告期内,本基金主要采用复制指数配置与行业内量化选股的策略,严格控制仓位,在日常的基金操作中积极应对申购赎回,并在个股配置上进行适度偏离,力争获得超额收益。

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0.896元,累计净值0.896元:本报告期份额净值增长率5.54%,同期业绩比较基准收益率为4.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年经济走势,随着内外需求回升,三季度出现的温和复苏有望在接下来几个月中持续,但其势头可能逐步下降。另一个重要因素——政策的不确定性已经大为下降,中短期内通货膨胀和就业形势还不会对政策形成制约。随着新型城镇化的推进,基础设施、房地产及相关制造业投资有望企稳回升,城镇化、工业化、信息化和农业现代化还有很大进步空间,中国经济的中长期增长潜力仍然可观。

但目前国内体制方面的制约因素仍不可小觑。虽然经济长期高速增长,但无论是监管、法制、税收、产业结构等层面,都没能跟得上经济增长,由此带来的一系列负面结果正在显现,比如私人投资和消费热情较低,政府债务泡沫和地产泡沫难以得到解决,贫富差距拉大,行政成本高,脆弱的民营经济等等。新一届政府显然已经意识到问题的严重性,所以2013年将会看到一系列改革的曙光,以及由此带来的投资机会,受益于改革的将不会是垄断性行业,而是具备高回报、长远社会效益、创新驱动等要素的行业和公司。

深证100指数行业分布均衡合理,指数成分股成长性较高,中长期的投资价值明显。在业绩获得验证,以及平稳度过创业板解禁潮之后,仍将会获得资金的青睐。作为被动投资的基金,本基金将继续坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对基准指数的跟踪偏离、主动增强获取超额收益为投资目标,努力为投资者实现单位风险收益上的最优化。

§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	142,191,689.46	94.14
	其中:股票	142,191,689.46	94.14
2	固定收益投资	3,001,200.00	1.99
	其中:债券	3,001,200.00	1.99
	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	5,163,660.76	3.42
6	其他资产	684,577.37	0.45
7	合计	151,041,127.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	945,159.66	0.63
B	采掘业	8,572,483.19	5.71
C	制造业	77,136,080.46	51.35
C0	食品、饮料	16,452,338.61	10.95
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	167,894.32	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,128,566.99	2.75
C5	电子	5,859,530.50	3.90
C6	金属、非金属	15,750,070.45	10.48
C7	机械、设备、仪表	27,059,839.62	18.01
C8	医药、生物制品	7,717,839.97	5.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,084,271.98	0.72
E	建筑业	1,356,916.50	0.90
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,455,167.00	1.63
H	批发和零售贸易	4,215,543.70	2.81
I	金融、保险业	14,383,433.95	9.57
J	房地产业	19,687,123.73	13.10
K	社会服务业	3,894,160.35	2.59
L	传播与文化产业	912,484.31	0.61
M	综合类	1,044,115.80	0.70
	合计	135,686,940.63	90.32

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	591,172.07	0.39
C	制造业	2,637,901.04	1.76
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	9,401.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	67,358.79	0.04
C5	电子	75,790.76	0.05
C6	金属、非金属	786,431.99	0.52
C7	机械、设备、仪表	1,447,145.77	0.96
C8	医药、生物制品	251,772.73	0.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	94,265.27	0.06
E	建筑业	208,934.48	0.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	192,610.26	0.13
H	批发和零售贸易	188,839.41	0.13
I	金融、保险业	719,005.03	0.48
J	房地产业	617,141.02	0.41
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	959,148.06	0.64
M	综合类	295,732.19	0.20
	合计	6,904,748.83	4.33

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	1,081,036	11,480,602.32	7.64
2	000651	格力电器	269,816	6,880,308.00	4.58
3	000858	五 粮 液	217,440	6,138,331.20	4.09
4	000001	平安银行	324,936	5,205,474.72	3.47
5	000157	中联重科	509,602	4,693,434.42	3.12
6	000024	招商地产	146,803	4,387,941.67	2.92
7	002024	苏宁电器	496,684	3,302,948.60	2.20
8	000568	泸州老窖	92,207	3,264,127.80	2.17
9	000776	广发证券	202,186	3,117,708.12	2.08
10	000069	华侨城A	400,547	3,004,102.50	2.00

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600031	三一重工	91,747	971,600.73	0.65
2	300291	华录百纳	15,159	909,540.00	0.61
3	600219	南山铝业	74,536	508,335.52	0.34
4	600383	金地集团	44,485	312,284.70	0.21
5	600376	首开股份	23,236	304,856.32	0.20

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	3,001,200.00	2.00
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,001,200.00	2.00

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	019202	12国债02	30,000	3,001,200.00	2.00

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 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,520.82
2	应收证券清算款	592,698.04
3	应收股利	-
4	应收利息	78,259.46
5	应收申购款	99.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	684,577.37

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	11,480,602.32	7.64	重大事项停牌

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 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	171,575,405.79
本报告期基金总申购份额	279,367.17
减:本报告期基金总赎回份额	4,148,596.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	167,706,176.37

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深证100指数增强型证券投资基金(LOF)设立的文件;

2.《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)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.报告期内东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)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1月19日

东吴新产业精选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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1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	67,457,214.66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