

东吴深证100指数增强型证券投资基金 (LOF)

2014 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:二〇一五年一月二十一日

§1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人东吴基金管理有限公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》,于2015年1月19日编制了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,这些内容真实、准确和完整。投资者如有任何疑问,应咨询其基金管理人。
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,也不保证基金资产净值不受损失。投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金招募说明书。
本报告中所载资料未作审计。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称:东吴深证100指数增强(LOF)
场内简称:东吴100
基金主代码:160806
交易代码:160806
上市期间:2014年7月15日
报告期末基金份额总额:64,297,371.15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,力争实现超越标的指数的长期投资回报。本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理,力争实现超越标的指数的长期投资回报。本基金力争实现超越标的指数收益率不低于5%,年化跟踪误差率不超过7.75%。

投资策略
本基金主要采用指数复制的方法,跟踪深证100指数的表现,同时结合量化模型,对标的指数的成分股及其权重进行动态调整。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,力争实现超越标的指数的长期投资回报。本基金力争实现超越标的指数收益率不低于5%,年化跟踪误差率不超过7.75%。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。

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混合基金、债券基金及货币市场基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标

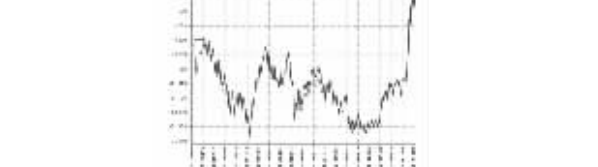
报告期(2014年10月1日—2014年12月31日)

1.本期已实现收益:3,068,904.10
2.本期利润:12,097,682.91
3.加权平均基金份额本期利润:0.2226
4.期末基金资产净值:72,354,120.20
5.期末基金份额净值:1.125

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.上述基金净值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据。
3.2.1 本报告期末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	净值增长率基准②	业绩比较基准差③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.26%	1.40%	26.40%	1.41%	0.86%	-0.01%

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较



注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

注:1.本基金业绩比较基准:85%×深证100指数收益率+15%×中国债券综合指数收益率。
2.2.2 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的比较

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,860,588.15	2.57
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	971,746.52	1.34
S	综合	568,686.30	0.79
合计		62,064,510.33	85.78

6.2 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	511,865.23	0.71
C	制造业	1,567,426.16	2.17
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	119,255.96	0.16
F	批发和零售业	429,195.18	0.59
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	459,542.75	0.64
J	金融业	271,037.34	0.37
K	房地产业	727,843.52	1.01
L	租赁和商务服务业	146,844.67	0.20
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	263,977.32	0.36
S	综合	-	-
合计		4,496,988.13	6.22

6.3 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	000002	万科A	282,419	3,925,024.10	5.43
2	000001	格力电器	81,162	3,012,733.44	4.16
3	000776	广发证券	188,990	2,828,290.50	3.91
4	000001	平安银行	168,252	2,665,111.68	3.68
5	000033	美的集团	76,593	2,101,711.92	2.90
6	000783	长江证券	114,523	1,926,276.86	2.66
7	000063	中兴通讯	78,707	1,423,073.82	1.97
8	002024	苏宁云商	138,430	1,245,870.00	1.72
9	000562	宏源证券	31,994	1,163,941.72	1.61
10	000038	雅鲁动力	39,051	1,065,701.79	1.47

6.4 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债券投资明细

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	600048	保利地产	38,059	411,798.38	0.57
2	600085	同仁堂	13,800	309,534.00	0.43
3	601088	中国神华	13,063	265,048.27	0.37
4	600219	南山铝业	28,921	256,529.27	0.35
5	600875	东方电气	10,746	221,797.44	0.31

6.5 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权证投资明细

6.6 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资产支持证券投资明细

6.7 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贵金属投资明细

6.8 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指期货投资明细

6.9 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国债期货投资明细

6.10 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融资融券投资明细

6.11 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其他资产投资明细

6.12 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其他资产投资明细

6.13 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其他资产投资明细

6.14 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其他资产投资明细

6.15 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其他资产投资明细

6.16 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其他资产投资明细

6.17 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其他资产投资明细

6.18 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其他资产投资明细

6.19 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其他资产投资明细

6.20 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其他资产投资明细

6.21 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其他资产投资明细

6.22 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其他资产投资明细

6.23 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其他资产投资明细

6.24 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其他资产投资明细

6.25 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其他资产投资明细

6.26 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其他资产投资明细

6.27 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其他资产投资明细

6.28 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其他资产投资明细

6.29 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其他资产投资明细

6.30 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其他资产投资明细

6.31 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其他资产投资明细

6.32 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其他资产投资明细

6.33 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其他资产投资明细

6.34 报告期末按公允价值占基金