

## 东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

2015年6月30日

[2015] 第二季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	877,916,637.64	89.46
其中：股票		877,916,637.64	89.46
2	固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	货币市场工具投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	49,966,451.86	6.02
7	其他资产	36,030,431.92	4.34
8	合计	829,119,622.75	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中：股票	-	-	-
2	固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	货币市场工具投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	74,262,345.67	7.57
7	其他资产	29,212,567.19	2.98
8	合计	981,391,530.50	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 矿业业 - -

C 制造业 502,557,703.68 63.65

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发零售业 34,348,728.67 4.35

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 餐饮住宿业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 126,981,993.15 16.08

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 79,461,313.47 10.06

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 743,349,738.97 94.14

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 300001 上海莱士 4,986,357 79,461,313.47 10.06

2 300128 锦富新材 3,183,244 71,194,134.40 9.11

3 002465 四维图新 1,519,269 66,543,982.20 8.43

4 002642 万华化学 1,095,533 60,438,010.95 7.65

5 300073 当升科技 1,945,322 52,212,442.48 6.61

6 002488 金固股份 3,171,940 44,560,611.20 5.64

7 002223 通策医疗 725,802 41,915,065.50 5.31

8 300285 国瓷材料 1,172,387 41,854,215.90 5.30

9 300008 中航黑豹 1,492,000 40,755,000.00 5.16

10 002217 合力泰 1,588,379 35,614,457.18 4.51

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.1 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.2 自基金成立以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 399,826,411.89

2.本期利润 236,298,300.99

3.加权平均基金份额本期利润 0.1802

4.期末基金资产净值 789,389,186.98

5.期末基金份额总额 1,024.00

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.3 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.4 自基金成立以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 399,826,411.89

2.本期利润 236,298,300.99

3.加权平均基金份额本期利润 0.1802

4.期末基金资产净值 789,389,186.98

5.期末基金份额总额 1,024.00

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.5 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.6 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.7 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.8 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.9 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.10 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.11 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.12 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.34% 3.37% 7.29% 1.68% -3.95% 1.69%

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计算费用后实际收益水平将有所下降。

3.2.13 本基金份额净值增长率为及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩报酬增长② 业绩基准收益率③ 盈利标准