

东吴新兴产业精选股票型证券投资基金

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

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:二〇一二年一月十九日

重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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基金合同规定,于2012年1月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资并不构成对任何人的投资建议,投资者在作出投资决策前应先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。

本报告自2011年10月1日起至2012年1月31日止。

基金产品概况

基金名称:东吴新兴产业精选股票
基金代码:580008
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

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,分享新兴产业带来的成长性投资机会,追求长期超额收益。

投资策略
本基金奉行研究驱动和自上而下、资产配置相结合,自上而下精选个股相结合的投资策略。

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
本基金是一只主动管理型股票基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券基金和混合基金。

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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

1.本期已实现收益 -1,458,398.52

2.本期利润 -15,329,864.14

3.期末基金份额净值 220.441,543.50

4.期末基金资产净值 220,441,543.50

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。

2.上期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实现的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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.30% 0.57% -0.03% 1.25% 3.74% -0.68%

注:1.业绩比较基准: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2011年9月28日成立,本基金合同生效日起计算时点不满一年,按基金合同生效日至报告期末的期间计算。

3.本基金合同生效以来,本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新兴产业精选股票型证券投资基金

业绩比较基准: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

注:1.本基金合同生效以来,本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

同时把投资资产配置力度加大至以成长性较强的中期票为主的股性投资组合,如汽车、房地产和家电。

我们判断,2012年A股市场可能继续震荡,2011年,当前高位投资收益率要求下投资风险,2012年东吴新兴产业资产类投资者带来良好投资体验。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

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

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

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

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中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.4 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.5 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.6 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.7 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.8 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.9 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.10 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.11 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.12 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.13 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.14 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.15 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.16 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.17 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.18 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.19 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.20 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.21 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.22 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.23 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.24 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.25 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.26 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.27 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.28 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.29 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.30 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.31 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.32 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.33 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.34 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.35 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.36 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.37 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.38 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.39 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.40 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.41 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.42 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.43 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.44 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.45 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.46 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.47 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.48 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.49 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.50 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.51 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.52 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.53 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.54 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.55 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.56 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.57 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.58 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.59 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.60 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.61 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

5.8.62 本基金投资的前十名证券的发行主体中,无被证监会于2011年5月27日下午收到中国证监会警示函有公开处罚记录。

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:二〇一二年一月十九日

重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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基金合同规定,于2012年1月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资并不构成对任何人的投资建议,投资者在作出投资决策前应先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。

本报告自2011年10月1日起至2012年1月31日止。

基金产品概况

基金名称:东吴中证新兴产业指数
基金代码:585001

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年12月1日

报告期末基金份额总额 1,797,038,605.48份

本基金为股票型基金,通过程序化的投资程序对数量化风险管理手段,力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪偏离度不超过1.5%,以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金通过采用指数化投资策略,选择中证新兴产业指数作为跟踪基准,按照指数的构成及其权重构建股票投资组合,为投资者获取新兴产业的增值或所带来的投资收益。

本基金业绩比较基准:95%\*中证新兴产业指数收益率+5%\*银行同业存款利率

本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金。本基金为主动管理型,跟踪中证新兴产业指数,具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。

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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

1.本期已实现收益 -82,200,267.36

2.本期利润 -200,284,002.54

3.期末基金份额净值 1,209.731,670.84

4.期末基金资产净值 1,209,731,670.84

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。

2.上期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实现的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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 -12.71% 1.56% -12.73% 1.58% -0.34% -0.02%

注:1.业绩比较基准:95%\*中证新兴产业指数收益率+5%\*银行同业存款利率

2.本基金2011年12月1日成立,本基金合同生效日起计算时点不满一年,按基金合同生效日至报告期末的期间计算。

3.本基金合同生效以来,本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

业绩比较基准:95%\*中证新兴产业指数收益率+5%\*银行同业存款利率

注:1.本基金合同生效以来,本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

业绩比较基准:95%\*中证新兴产业指数收益率+5%\*银行同业存款利率

注:1.本基金合同生效以来,本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较