东吴中证新兴产业指数证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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:二〇一三年七月十八日

§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7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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴中证新兴指数
基金主代码	585001
交易代码	585001
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2月1日
报告期末基金份额总额	1,288,676,828.14份
投资目标	本基金采用指数化投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	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,按照指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,为投资者获取新兴产业高速成长所带来的投资收益。
业绩比较基准	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
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货币市场基金、债券型基金以及混合型基金,本基金为指数型基金,紧密跟踪中证新兴产业指数,具有和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(2013年4月1日 – 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	2,588,295.65
2.本期利润	−18,622,174.07
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0134
4.期末基金资产净值	891,996,049.53
5.期末基金份额净值	0.692

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。

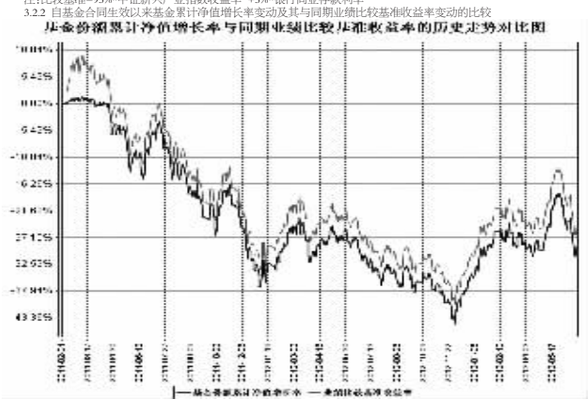
3.2 基金净值表现

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	−3.08%	1.55%	−3.44%	1.57%	0.36%	−0.02%

注: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

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.业绩比较基准=(中信标普200指数*50%+中信标普小盘指数*50%)*75%+中信标普全债指数*25%

§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		
周 健	本基金基金经理	2012年10月27日	–	6.5年	硕士,南开大学毕业。曾就职于海通证券;2011年5月加入东吴基金管理有限公司,曾任公司研究策划部研究员,现担任东吴中证新兴指数基金基金经理、东吴新创业股票基金基金经理、东吴深证100指数增强型证券投资基金基金经理(LOF)。

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

在经历连续两个季度的复苏后,经济实体的复苏动力逐步减弱,六月份汇丰PMI已经回落到荣枯线之下。同时,六月份央行主动收紧流动性,市场风险骤升,造成股市快速下挫。在市场宽幅震荡过程中,中证新兴指数重配的医药、交运和军工板块表现稳定,受到流动性冲击的程度较小,与银行、地产、有色等权重板块形成明显反差。由于在行业配置上的优势,二季度中证新兴指数仅下跌3.64%,远远跑赢沪深300、上证50、深100等主流指数,超额收益明显。报告期内,本基金采用复制指数配置的策略,努力控制仓位和成份股上的偏离,在日常的基金操作中积极应对申购赎回,尽量减少跟踪误差。

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0.692元,累计净值0.692元;本报告期份额净值增长率−3.08%,同期业绩比较基准收益率为−3.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度,海外市场经历了QE退出预期的冲击,但是其资本市场表现仍然比较稳定,远好于A股,这直接反映出目前中国经济的艰难程度。从之前的地产调控、清理影子银行等一系列动作,到最近央行无视经济下滑而坚决收紧流动性,显示出中国政府推进去杠杆、调结构的决心很大,预计在未来一段时间里,原来依靠政府投资拉动、产能过剩的行业会更加艰难。

虽然改革是痛苦的,是有代价的,但长期看有利于股市,改革过程中也会不断涌现出真正的投资机会。我们认为,此次受益于改革的将会是顺应经济发展方向,同时具备高回报、长远社会效益以及创新驱动等要素的行业和公司。首先,政府会更多地借助市场来进行资源配置,而市场考虑的是回报和风险,这些因素将决定哪些板块和个股会有投资机会。其次,在衡量行业和公司前景时,其对社会发展的促进作用不可忽略,有利于节约资源、保护环境、提高人民群众文化和生活素质的将会受到政府支持,对应这些行业特征以及当前市场趋势,我们认为以现代服务业、高端制造业和新能源为主的新兴行业的发展趋势不可阻挡,中证新兴产业指数正是基于以上转型思路优选出的主题策略指数,具备长期投资价值。

作为被动投资的基金,本基金将继续坚持指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标,积极应对申购赎回、成分股调整等因素对指数跟踪带来的冲击,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

§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	831,978,067.80	92.73
	其中:股票	831,978,067.80	92.73
2	固定收益投资	29,893,000.00	3.33
	其中:债券	29,893,000.00	3.33
	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	24,216,233.52	2.70
6	其他资产	11,137,319.21	1.24
7	合计	897,224,620.53	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	2,590,741.56	0.29
B	采矿业	15,827,765.69	1.77
C	制造业	639,661,716.98	71.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,715,092.10	2.99
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	92,450,911.50	10.36
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	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	5,049,609.60	0.57
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	782,295,837.43	87.70

5.2.2 报告期末积极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	5,680,999.39	0.64
B	采矿业	–	–
C	制造业	34,601,057.98	3.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	5,712,125.00	0.64
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	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	3,688,048.00	0.41
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	49,682,230.37	5.57

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	600867	通化东宝	739,188	11,006,509.32	1.23
2	002038	双鹭药业	182,866	10,715,947.60	1.20
3	600765	中航重机	781,979	10,509,797.76	1.18
4	002230	科大讯飞	220,893	10,205,256.60	1.14
5	000598	兴蓉投资	2,113,986	10,168,272.66	1.14
6	600436	片仔癀	74,282	10,163,263.24	1.14
7	600498	烽火通信	613,165	10,104,959.20	1.13
8	600804	鹏博士	932,288	9,872,929.92	1.11
9	000063	中兴通讯	757,640	9,659,910.00	1.08
10	000625	长安汽车	1,038,552	9,648,148.08	1.08

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	000400	许继电气	219,336	5,939,618.88	0.67
2	600518	康美药业	306,900	5,901,687.00	0.66
3	600557	康缘药业	221,286	5,875,143.30	0.66
4	600435	北方导航	487,811	5,775,682.24	0.65
5	601929	吉视传媒	913,940	5,712,125.00	0.64

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	29,893,000.00	3.35
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	29,893,000.00	3.35

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	1001079	10央行票据79	200,000	19,936,000.00	2.23
2	1001099	10央行票据99	100,000	9,957,000.00	1.12

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	99,104.01
2	应收证券清算款	9,953,474.46
3	应收股利	380,497.80
4	应收利息	621,644.05
5	应收申购款	82,598.89
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,137,319.21

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.5.1 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	600436	片仔癀	10,163,263.24	1.14	配股发行临时停牌

5.9.5.2 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。

5.9.6 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	1,446,128,471.95
本报告期基金总申购份额	11,094,969.86
减:本报告期基金总赎回份额	168,546,613.67
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	1,288,676,828.14

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中证新兴产业指数证券投资基金设立的文件;

2.《东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金合同》;

3.《东吴中证新兴产业指数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.报告期内东吴中证新兴产业指数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7月18日

东吴新创业股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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:二〇一三年七月十八日

§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根据本基金合同规定,于2013年7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2013年4月1日起至6月30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	580007
交易代码	580007
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	2010年6月29日
报告期末基金份额总额	106,030,640.97份
投资目标	本基金为股票型基金,主要投资于市场中的创业型股票,包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票,通过精选具有合理价值的高成长创业型股票,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,动态调整股票、债券、现金等大类资产的配置。运用本公司自行开发的东吴GARP策略选股模型,精选具有成长优势与估值优势的创业型上市公司股票。
业绩比较基准	(中信标普200指数*50%+中信标普小盘指数*50%)*75%+中信标普全债指数*25%
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。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。
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

§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(2013年4月1日 – 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	5,256,770.65
2.本期利润	−4,453,094.48
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0401
4.期末基金资产净值	96,371,424.83
5.期末基金份额净值	0.909

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。

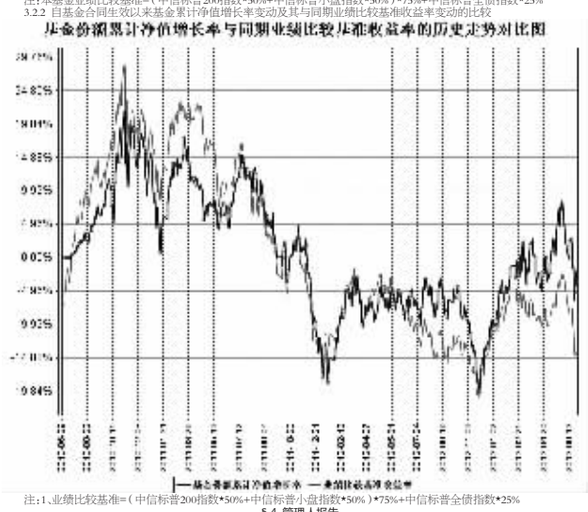
3.2 基金净值表现

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	−4.32%	1.61%	−6.68%	1.08%	2.36%	0.53%

注: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%)*75%+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变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.业绩比较基准=(中信标普200指数*50%+中信标普小盘指数*50%)*75%+中信标普全债指数*25%

§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		
周 健	本基金基金经理	2012年10月27日	–	6.5年	硕士,南开大学毕业。曾就职于海通证券;2011年5月加入东吴基金管理有限公司,曾任公司研究策划部研究员,现担任东吴中证新兴指数基金基金经理、东吴新创业股票基金基金经理、东吴深证100指数增强型证券投资基金基金经理(LOF)。

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

第二季度,A股市场结构分化依旧,成长股和中小市值股票维持强势,即便是在6月份由流动性危机触发的股市大跌中,创业板指数相对其他指数仍有明显的超额收益。市场没有理会投资者对高估值的担忧,本基金也顺势而为,股票仓位维持在中高水平,继续超配了消费电子和医药等行业,也适度参与了新能源汽车等相关主题投资。

需要检讨的是,几个重仓股一季报业绩低于预期,导致本基金净值在第二季度遭受不小的损失。今后本基金将进一步加强对重仓持有股票的持续跟踪,规避业绩低于预期带来的风险,为投资者创造超额回报。

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0.909元,累计净值0.969元;本报告期份额净值增长率−4.32%,同期业绩比较基准收益率为−6.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第三季度,本基金认为影响股市运行的关键变量大概率上仍是流动性和经济基本面。流动性将总体趋紧已经成为市场的一致预期,尤其是6月份银行间流动性压力测试已经让金融机构和投资者认识到新的高层领导的态度变化,市场对未来金融机构流动性的创造的预期值已经降到低位。从外部因素来看,美国量化宽松政策退出的路径虽不清晰但市场预期却在不断强化,下半年美元继续走强和全球资金流动方向逆转发生的概率在增大,国内流动性宽松的外部环境也将面临挑战。

从经济基本面来看,所谓七上八下的GDP增速应该是未来几个季度的常态,盘活存量使空转货币流向实体经济是一个渐进的过程,货币对经济的促进作用不能期望太高。相反,"钱荒"已经促使投资者开始产生实体经济也终将受到负面冲击的预期。就目前情势看,经济失速下行的风险还不大,不至于触及高层对经济增速回落的容忍底线(尽管市场并不清晰地知道底线在哪里),所以也很难指望政府会出台措施对冲经济增速下行。也就是说,至少在第三季度我们也看不到所谓"经济退、政策进"的过去熟悉的场景。

总之,股市在第三季度将没有经济基本面的支撑,也会受到资金面趋紧的压制,来自财政和货币政策方面的上行风险出现的概率也较低,预计股市区间波动的概率较大。本基金关注的上行风险因素包括:政府出台直接针对股市的利好政策、宏观政策上摇摆不定。

§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	80,000,651.62	78.30
	其中:股票	80,000,651.62	78.30
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	21,284,675.21	20.83
6	其他资产	886,052.31	0.87
7	合计	102,171,379.14	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	采矿业	–	–
C	制造业	57,852,985.43	60.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	5,758,574.60	5.98
F	批发和零售业	–	–
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	3,640,000.00	3.78
J	金融业	469,000.00	0.49
K	房地产业	1,952,400.00	2.03
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	3,909,878.00	4.06
N	水利、环境和公共设施管理业	4,085,373.59	4.24
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	2,332,440.00	2.42
S	综合	–	–
	合计	80,000,651.62	83.01

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	002138	顺络电子	295,800	5,324,400.00	5.52
2	002140	东华科技	160,000	3,969,600.00	4.12
3	600867	通化东宝	252,000	3,752,280.00	3.89
4	600637	百视通	130,000	3,640,000.00	3.78
5	601965	中国汽研	380,000	3,515,000.00	3.65
6	300054	鼎龙股份	200,000	3,438,000.00	3.57
7	002450	康得新	110,000	3,077,800.00	3.19
8	600887	伊利股份	95,000	2,971,600.00	3.08
9	002022	科华生物	200,000	2,962,000.00	3.07
10	002415	海康威视	79,989	2,826,811.26	2.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	81,304.90
2	应收证券清算款	640,995.12
3	应收股利	–
4	应收利息	2,771.19
5	应收申购款	160,981.10
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	886,052.31

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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	123,772,563.56
本报告期基金总申购份额	6,388,130.65
减:本报告期基金总赎回份额	24,130,053.24
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	106,030,640.97

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新创业股票型证券投资基金设立的文件;

2.《东吴新创业股票型证券投资基金基金合同》;

3.《东吴新创业股票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.报告期内东吴新创业股票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7月18日

东吴新经济股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30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:二〇一三年七月十八日

§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7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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴新经济股票
基金主代码	580006
交易代码	580006
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12月30日
报告期末基金份额总额	131,505,982.50份
投资目标	本基金为股票型基金,通过投资于引领经济发展未来方向的新兴行业的上市公司,享受新经济发展带来的高成长和高收益。重点投资其中具有成长优势和竞争优势的上市公司股票,追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,根据自上而下对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,在遵循前述本基金资产配置总体比例限制范围内,确定基金资产在股票、债券、现金和其他金融工具上的具体投资比例。根据科学技术和产业的发展趋势对与新经济相关创新技术、典型产业进行识别。随后自下而上地精选代表新经济的典型上市公司和与新经济密切相关的上市公司,针对两类公司的不同特征,充分考虑公司的成长性,运用东吴基金企业竞争优势评价体系进行评价,构建股票池。投资其中具有成长优势和竞争优势的上市公司股票,追求超额收益。
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*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股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、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(2013年4月1日 – 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	1,911,699.00
2.本期利润	1,058,899.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0080
4.期末基金资产净值	126,296,009.70
5.期末基金份额净值	0.960

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。

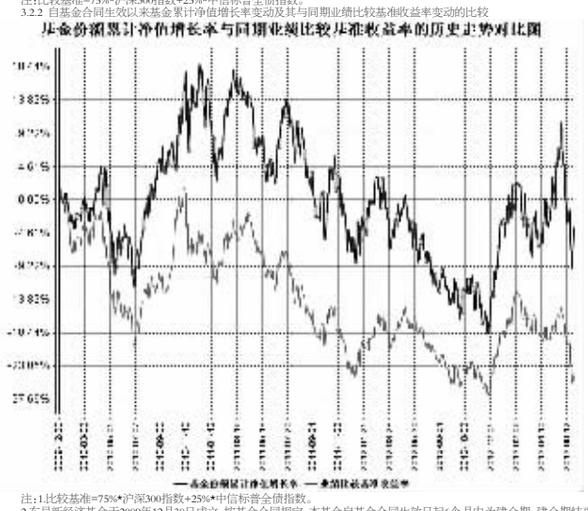
3.2 基金净值表现

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	1.37%	1.77%	−8.61%	1.10%	9.98%	0.67%

注:比较基准=75%*沪深300指数+25%*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.比较基准=75%*沪深300指数+25%*中信标普全债指数。

2.东吴新经济基金于2009年12月30日