# 东吴新创业股票型证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十三日**

### §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10月21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7月1日起至9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 | 93,514,345.68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7月1日 - 2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 6,859,580.04 |
| 2.本期利润 | 11,448,663.02 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1129 |
| 4.期末基金资产净值 | 95,190,441.92 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.018 |

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。

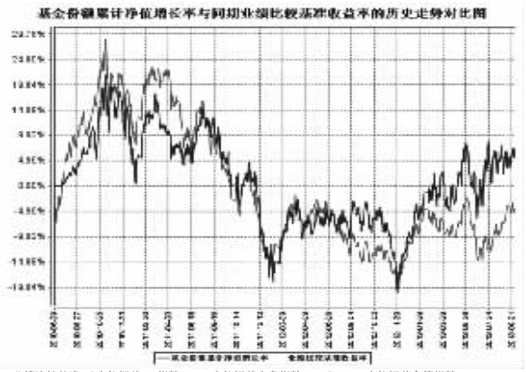
3.2 基金净值表现

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 | 11.99% | 1.52% | 12.63% | 1.01% | -0.64% | 0.51% |

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

经历了六月份的快速下跌之后,在经济数据好于预期和流动性状况环比改善等因素的驱动下,股市在第三季度出现了恢复性上涨,上证综指反弹9.88%,而中小板和创业板指数则分别大涨17.46%和35.21%。从行业层面来看,传媒行业仍强者恒强,交通运输、商贸零售和农林牧渔等与自贸区、O2O及农地流转等主题相关的传统行业也表现突出,而医药则因GSK贿赂事件的影响而表现一般,消费电子和环保等也相对落后。

其间,本基金整体保持了中性偏高的股票仓位,并对二季度超配的医药和环保行业进行了适度减持,同时增配了化工(染料和氨纶)、汽车以及信息消费相关的行业如传媒和4G等,由于对自贸区等主题理解不够深刻,所以基本没有参与相关主题投资。

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1.018元,累计净值1.078元;本报告期份额净值增长率11.99%,同期业绩比较基准收益率为12.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为,自七月份开始的企业补库存行为在第四季度将接近尾声,基建投资和房地产投资的扩张也将面临资金的约束,反映在宏观数据上就是,GDP同比增速将在三季度见到高点后,大概率上在第四季度出现回落,尽管他对水平可能还会高于第二季度。另外,美国QE退出和IPO重新开闸的预期还会对流动性产生一定的压力。

所以,股市在第四季度出现趋势性机会的概率不大,预计仍将以围绕改革展开的结构性和主题性机会为主,业绩能够稳定增长的医药和大众消费品行业有望受到青睐,已度过行业拐点、业绩将持续环比改善的行业也值得关注。

### §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 | 80,752,837.16 | 84.00 |
| | 其中:股票 | 80,752,837.16 | 84.00 |
| 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 | 15,154,299.10 | 15.76 |
| 6 | 其他资产 | 229,322.45 | 0.24 |
| 7 | 合计 | 96,136,458.71 | 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 | 50,376,208.21 | 52.92 |
| 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 | 1,952,000.00 | 2.05 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,098,100.00 | 9.56 |
| J | 金融业 | 4,038,000.00 | 4.24 |
| K | 房地产业 | 4,638,602.65 | 4.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,615,326.30 | 1.70 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,275,000.00 | 1.34 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,046,000.00 | 2.15 |
| 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 | 5,713,600.00 | 6.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 80,752,837.16 | 84.83 |

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 | 600872 | 中炬高新 | 360,000 | 3,607,200.00 | 3.79 |
| 2 | 600880 | 博瑞传播 | 110,000 | 3,212,000.00 | 3.37 |
| 3 | 600703 | 三安光电 | 158,000 | 3,205,820.00 | 3.37 |
| 4 | 002022 | 科华生物 | 190,000 | 3,182,500.00 | 3.34 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 70,000 | 3,127,600.00 | 3.29 |
| 6 | 002185 | 华天科技 | 250,000 | 2,850,000.00 | 2.99 |
| 7 | 000063 | 中兴通讯 | 170,000 | 2,822,000.00 | 2.96 |
| 8 | 601515 | 东风股份 | 130,050 | 2,366,910.00 | 2.49 |
| 9 | 300017 | 网宿科技 | 40,000 | 2,280,000.00 | 2.40 |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 80,000 | 2,112,000.00 | 2.22 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 127,551.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,954.09 |
| 5 | 应收申购款 | 98,816.67 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 229,322.45 |

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 106,030,640.97 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,599,619.85 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 18,115,915.14 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 93,514,345.68 |

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金报告期间无基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 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10月23日

# 东吴新经济股票型证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十三日**

### §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10月21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7月1日起至9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 | 127,532,902.72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7月1日 - 2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,408,433.62 |
| 2.本期利润 | 5,103,486.48 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0391 |
| 4.期末基金资产净值 | 127,177,550.12 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.997 |

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。

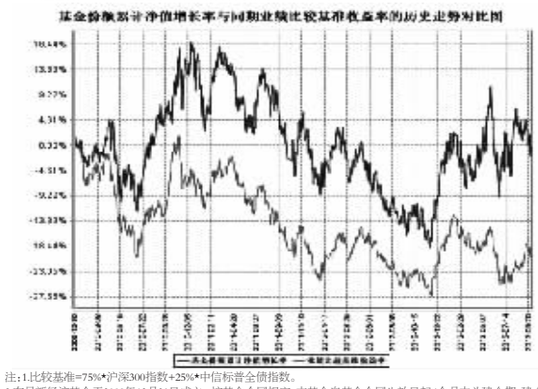
3.2 基金净值表现

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 | 3.85% | 1.59% | 7.20% | 1.08% | -3.35% | 0.51% |

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日成立。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 | | |
| 邹国英 | 本基金基金经理 | 2012年8月10日 | - | 7.5年 | 硕士,西南财经大学毕业,曾担任新疆证券研究所研究员、兴业证券研究所研究员;2008年6月起加入东吴基金管理有限公司,曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理等职务;现担任东吴新经济股票型基金基金经理、东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理。 |

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》的相关规定。

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

在经历了2季度经济增速下滑和资金面时点性紧紧之后,管理层为增加政策的透明性,提出经济的“上、下限”论,以稳定和管控市场预期,并且也先后出台了棚户区改造、铁路等基础设施建设、信息消费等稳增长的措施。自7月份开始,我国工业增加值、PMI、发电量等主要经济数据逐步好转。良好的经济数据带动股指出现一轮上涨行情,自贸区、土地改革以及国企改革等主题性热点相继涌现。3季度沪深300指数上涨9.47%,其中以传媒为主的信息服务涨幅最大,金融、地产等低估值蓝筹以及食品饮料等板块涨幅靠后。在此期间,本基金虽然抓住了4G、光伏等板块的投资机会,但对传媒、自贸区等主要热点基本没有参与,加上重仓股表现一般,致使基金净值涨幅落后于基准指数。

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0.997元,累计净值0.997元;本报告期份额净值增长率3.85%,同期业绩比较基准收益率为7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着政府稳增长举措逐步实施以及释放改革红利的预期,我国宏观经济向好的趋势将有望得到延续。十八届三中全会在今年11月份召开的时间已经确定,更重要的是,确定会议的主要内容为研究全面深化改革重大问题。因此,对大会的成果以及改革红利推动下的经济增长前景,预期可以更乐观些。

我们看好4季度的A股市场,在继续看好基本面持续超预期的汽车、新能源、4G及节能环保等板块的同时,看好低估值优质蓝筹的估值修复行情。

### §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 | 114,032,793.82 | 88.83 |
| | 其中:股票 | 114,032,793.82 | 88.83 |
| 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 | 14,036,446.22 | 10.93 |
| 6 | 其他资产 | 300,108.21 | 0.23 |
| 7 | 合计 | 128,369,348.25 | 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 | 74,047,864.54 | 58.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,301,558.00 | 4.17 |
| F | 批发和零售业 | 122,060.04 | 0.10 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | 7,555,312.81 | 5.94 |
| K | 房地产业 | 27,005,998.43 | 21.23 |
| 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 | - | - |
| 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 | 114,032,793.82 | 89.66 |

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 | 601633 | 长城汽车 | 209,909 | 10,722,151.72 | 8.43 |
| 2 | 000625 | 长安汽车 | 1,025,416 | 10,561,784.80 | 8.30 |
| 3 | 000024 | 招商地产 | 412,382 | 9,897,168.00 | 7.78 |
| 4 | 002146 | 荣盛发展 | 678,491 | 8,637,190.43 | 6.79 |
| 5 | 000063 | 中兴通讯 | 424,989 | 7,054,817.40 | 5.55 |
| 6 | 600703 | 三安光电 | 320,000 | 6,492,800.00 | 5.11 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 139,925 | 6,251,849.00 | 4.92 |
| 8 | 000800 | 一汽轿车 | 440,000 | 5,838,800.00 | 4.59 |
| 9 | 600340 | 华夏幸福 | 153,000 | 4,969,440.00 | 3.91 |
| 10 | 600498 | 烽火通信 | 220,000 | 4,083,200.00 | 3.21 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 109,422.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,445.31 |
| 5 | 应收申购款 | 186,240.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 300,108.21 |

5.10.4 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。

5.10.5 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未存在流通受限情况。

5.10.6 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 131,505,982.50 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 16,810,962.59 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 20,784,042.37 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 127,532,902.72 |

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金报告期间无基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴新经济股票型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴新经济股票型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴新经济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、报告期内东吴新经济股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 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10月23日

# 东吴中证新兴产业指数证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十三日**

### §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10月21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7月1日起至9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 | 1,193,219,470.54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7月1日 - 2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,062,119.19 |
| 2.本期利润 | 149,159,105.05 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1194 |
| 4.期末基金资产净值 | 967,015,031.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.810 |

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。

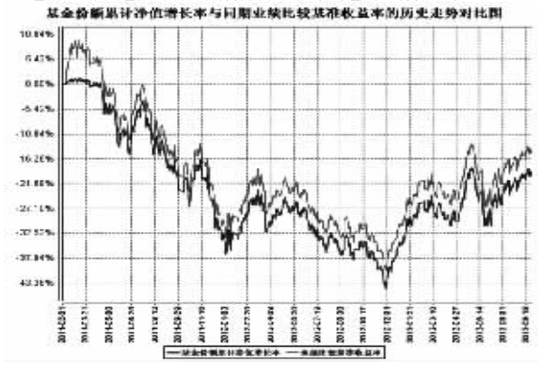
3.2 基金净值表现

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 | 17.05% | 1.43% | 17.37% | 1.44% | -0.32% | -0.01% |

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=95%*中证新兴产业指数收益率 +5%*银行同业存款利率。

2、本基金于2011年2月1日成立。

### §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5月3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

三季度全球经济处于平静复苏的过程中,国内经济也出现补库存迹象。最值得关注的是物价走势,下游原材料价格上涨,PPI实现两个月连续环比正增长,CPI同比上升到3以上,显示出供给端的去杠杆已经出现效果。但是需求端的复苏还没有出现强有力的信号,市场多认为经济处于库存周期的高点,仍怀疑复苏是否能够持续。报告期内,中证新兴指数大幅上涨,主要来源于偏周期板块的上涨,虽然重配的医药板块表现透后,但是在信息服务、交运设备和军工装备制造等板块上有较高收益,同时强周期的地产、有色以及金融等权重板块并未实现预期上涨,最终三季度中证新兴指数远远跑赢沪深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0.810元,累计净值0.810元;本报告期份额净值增长率17.05%,同期业绩比较基准收益率为17.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度宏观经济和证券市场走势,我们认为当前经济仍处于复苏阶段,无论是政府或企业,都在主动进行资产重组,降低杠杆,而在这种大背景下,需求和供给将会出现相对平衡的状态,企业盈利水平会逐步恢复。风险方面,市场存在一定的结构性失衡,创业板连创新高,而其业绩增速却赶不上估值的提升幅度,甚至有出现背离的可能性,市场内部风险正在积聚,但是短期还没有出现新的外在因素可以刺破这种艳旋上升的泡沫状态,预期未来可能出现的负面因素主要有IPO和业绩不达预期等。政策方面,市场对十八届三中全会的期望较高,诸多方向上的改革政策有望明确,进而释放出改革红利,但之前股票市场已经在金改、土改和自贸区等主题上炒作了一段时间,政策超预期的可能性不大,我们应该对政策进行深度挖掘,更加关注其中长期效应。总体来看,四季度宏观经济出现大波动的可能性较低,企业盈利逐步恢复,系统性风险较低,但IPO、流动性等冲击因素可能会对估值偏高的部分板块形成不利影响,需要规避。

新一届政府已经在推动经济结构调整,未来十八届三中全会将把改革深化,推出在国企、土地、金融、