

## 东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)

## 2014 第二季度 报告

2014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:二〇一四年七月十八日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事局及监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2014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，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金经理承诺并声明，本人未将基金资产投资于国债、货币市场基金、短期融资券、超短期融资券、股票、可转换债券、权证等高风险品种，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。

本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东吴深证100指数增强(LOF) 简称(场内简称:东吴100)
基金主代码	168806
交易代码	168806
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2012年3月19日
报告期末基金份额总额	59,169,661.2090
投资目标	本基金为股票型增强型基金，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，力争在扣除相关费用后的净值增长率超越标的指数10%左右，年度跟踪误差不超过7.79%。
投资策略	本基金主要采用指数复制的方法构建组合，跟踪深证100指数，即按照标的指数的成分股及其权重比例构建股票组合，同时通过股票择时策略、行业配置策略以及个股精选策略对组合进行动态调整。本基金力争通过指数增强策略使本基金的净值增长率超越标的指数10%左右，年度跟踪误差不超过7.79%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%×深证100价格指数收益+5%×商业银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期收益较高，风险也较高。请投资者在做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。
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

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,386,967.91
2.本期利润	1,290,016.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0199
4.期末基金份额净值	46,541,742.08
5.期末可供分配基金份额净值	0.787

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,计算费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2 本基金目前尚未开放申购赎回,因此本期基金份额的变动情况与同行业相比基准收益单变动的比例

阶段 净值增长① 净值增长率标准差② 业绩比较基准 业绩比较基准收益③ 标准差④ ①-③ ②-④

过去二个月 -0.88% 0.87% 2.27% 0.87% 0.61% 0.00%

注:2.本基金成立以来以现金累计净值增长率与同行业相比基准收益单变动的比例

本基金成立以来以现金累计净值增长率与同行业相比基准收益单变动的比例

3.3 本基金的业绩评价指标

3.3.1 本基金报告期来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

3.3.2 本基金报告期来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

3.3.3 本基金报告期来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

3.3.4 本基金报告期来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组合

3.3.5 本基金报告期来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组合

3.3.6 本基金报告期来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组合

3.3.7 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.8 本基金报告期来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组合

3.3.9 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.10 本基金报告期来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组合

3.3.11 本基金报告期来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组合

3.3.12 本基金报告期来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组合

3.3.13 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.14 本基金报告期来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组合

3.3.15 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.16 本基金报告期来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组合

3.3.17 本基金报告期来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组合

3.3.18 本基金报告期来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组合

3.3.19 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.20 本基金报告期来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组合

3.3.21 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.22 本基金报告期来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组合

3.3.23 本基金报告期来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组合

3.3.24 本基金报告期来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组合

3.3.25 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.26 本基金报告期来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组合

3.3.27 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.28 本基金报告期来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组合

3.3.29 本基金报告期来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组合

3.3.30 本基金报告期来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组合

3.3.31 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.32 本基金报告期来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组合

3.3.33 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.34 本基金报告期来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组合

3.3.35 本基金报告期来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组合

3.3.36 本基金报告期来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组合

3.3.37 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.38 本基金报告期来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组合

3.3.39 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.40 本基金报告期来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组合

3.3.41 本基金报告期来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组合

3.3.42 本基金报告期来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组合

3.3.43 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.44 本基金报告期来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组合

3.3.45 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.46 本基金报告期来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组合

3.3.47 本基金报告期来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组合

3.3.48 本基金报告期来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组合

3.3.49 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.50 本基金报告期来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组合

3.3.51 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.52 本基金报告期来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组合

3.3.53 本基金报告期来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组合

3.3.54 本基金报告期来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组合

3.3.55 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.56 本基金报告期来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组合

3.3.57 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.58 本基金报告期来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组合

3.3.59 本基金报告期来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组合

3.3.60 本基金报告期来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组合

3.3.61 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.62 本基金报告期来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组合

3.3.63 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.64 本基金报告期来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组合

3.3.65 本基金报告期来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组合

3.3.66 本基金报告期来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组合

3.3.67 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.68 本基金报告期来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组合

3.3.69 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.70 本基金报告期来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组合

3.3.71 本基金报告期来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组合

3.3.72 本基金报告期来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组合

3.3.73 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.74 本基金报告期来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组合

3.3.75 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.76 本基金报告期来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组合

3.3.77 本基金报告期来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组合

3.3.78 本基金报告期来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组合

3.3.79 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合

3.3.80 本基金报告期来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组合

3.3.81 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资组合

3.3.82 本基金报告期来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组合

3.3.83 本基金报告期来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组合

3.3.84 本基金报告期来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组合

3.3.85 本基金报告期来公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生金融工具投资组合