# 东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）

## 2015 第二季度 报告

2015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：二〇一五年七月二十一日

§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2015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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东吴深证100指数增强(LOF) |
| 场内简称 | 东吴100 |
| 基金主代码 | 165806 |
| 交易代码 | 165806 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2012年3月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 12,528,469.22份 |
| 投资目标 | 本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证100价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后) |
| 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混合基金、债券基金与货币市场基金。 |
| 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 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(2015年4月1日－2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,899,959.42 |
| 2.本期利润 | 6,859,993.27 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3131 |
| 4.期末基金资产净值 | 19,203,770.24 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.533 |

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。

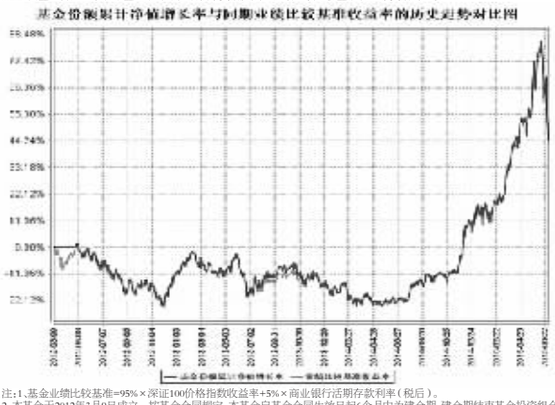
3.2 基金净值表现

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 | 12.31% | 2.62% | 12.65% | 2.51% | -0.34% | 0.11% |

注：基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）

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、基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

2、本基金于2012年3月9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 | | |
| 周健 | 本基金基金经理 | 2013年6月5日 | － | 8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、此处的任职日期为公司对外公告之日；

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，因赎回等原因，本基金2015年4月30日至2015年6月30日出现连续四十二个交易日基金资产净值低于5000万元的情形，除此之外，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

从二季度的月度数据来看，国内宏观经济有企稳迹象，但是并不稳固，在货币宽松政策的推动下，需求有望回暖，可是从上游价格和企业景气度等微观层面的数据看，需求向生产面的传导效应并不顺畅，经济下行压力仍在。二季度沪深300指数上涨10%，创业板指上涨22%，深100指数的配置较为均衡，涨幅介于两者之间，累计上涨13%。报告期内，本基金主要采用复制指数配置与行业内量化选股的策略，严格控制仓位，在日常的基金操作中积极应对申购赎回，并在个股配置上进行适度偏离，力争获得超额收益。

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1.533元，累计净值1.533元；本报告期份额净值增长率12.31%，同期业绩比较基准收益率为12.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段经济和市场运行形势，个人认为国内经济下行压力仍然存在，随着城投债置换政策和财政政策的不断推进，基建投资有望回升，拉动总需求。但是股市去杠杆今实体暂时失去直接融资渠道，增加了经济结构转型的难度，拉长了经济磨底的时间。虽然短期投资者预期比较混乱，市场可能震荡，但后续金融市场改革、国企改革等都将逐步进入兑现阶段，在当前股市估值水平下，会形成很多的投资机会。

深证100指数行业分布均衡合理，指数成分股成长性较高，流动性较好，中长期的投资价值明显。作为被动投资的基金，本基金将继续坚持跟定的指数化投资策略，以严格控制基金相对基准指数的跟踪偏离、主动增强获取超额收益为投资目标，努力为投资者实现单位风险收益上的最优化。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金2015年4月30日至2015年6月30日出现连续四十二个交易日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 18,170,092.07 | 92.41 |
| | 其中：股票 | 18,170,092.07 | 92.41 |
| 2 | 固定收益投资 | － | － |
| | 其中：债券 | － | － |
| | 资产支持证券 | － | － |
| 3 | 贵金属投资 | － | － |
| 4 | 金融衍生品投资 | － | － |
| 5 | 买入返售金融资产 | － | － |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | － | － |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,246,568.68 | 6.34 |
| 7 | 其他资产 | 244,762.23 | 1.24 |
| 8 | 合计 | 19,661,422.98 | 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 | 33,592.00 | 0.17 |
| B | 采矿业 | 326,226.90 | 1.70 |
| C | 制造业 | 10,301,286.69 | 53.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 84,924.18 | 0.44 |
| E | 建筑业 | 160,344.72 | 0.83 |
| F | 批发和零售业 | 379,660.22 | 1.98 |
| 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 | 1,117,160.69 | 5.82 |
| J | 金融业 | 1,916,635.34 | 9.98 |
| K | 房地产业 | 1,436,201.99 | 7.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 332,679.58 | 1.73 |
| M | 科学研究和技术服务业 | － | － |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 509,923.85 | 2.66 |
| 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 | 397,909.02 | 2.07 |
| S | 综合 | 111,103.72 | 0.58 |
| | 合计 | 17,107,648.90 | 89.08 |

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 | － | － |
| B | 采掘业 | 38,099.88 | 0.20 |
| C | 制造业 | 437,851.27 | 2.28 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 22,868.28 | 0.12 |
| E | 建筑业 | － | － |
| F | 批发和零售业 | 24,661.24 | 0.13 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 63,783.72 | 0.33 |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 57,585.57 | 0.30 |
| J | 金融业 | 143,031.39 | 0.74 |
| K | 房地产业 | 33,495.00 | 0.17 |
| L | 租赁和商务服务业 | 147,009.90 | 0.77 |
| 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 | 43,260.66 | 0.23 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 50,796.26 | 0.26 |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 1,062,443.17 | 5.53 |

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 | 000651 | 格力电器 | 11,916 | 761,432.40 | 3.97 |
| 2 | 000024 | 招商地产 | 16,823 | 614,039.50 | 3.20 |
| 3 | 000002 | 万 科A | 36,666 | 532,390.32 | 2.77 |
| 4 | 000709 | 河北钢铁 | 62,794 | 439,558.00 | 2.29 |
| 5 | 000783 | 长江证券 | 30,795 | 429,590.25 | 2.24 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 28,817 | 418,999.18 | 2.18 |
| 7 | 000625 | 长安汽车 | 18,638 | 394,193.70 | 2.05 |
| 8 | 000630 | 铜陵有色 | 37,230 | 384,213.60 | 2.00 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 10,000 | 372,800.00 | 1.94 |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 7,509 | 336,403.20 | 1.75 |

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 | 601888 | 中国国旅 | 1,703 | 112,908.90 | 0.59 |
| 2 | 601006 | 大秦铁路 | 4,543 | 63,783.72 | 0.33 |
| 3 | 002153 | 石基信息 | 443 | 57,585.57 | 0.30 |
| 4 | 300005 | 探路者 | 2,005 | 54,937.00 | 0.29 |
| 5 | 600436 | 片仔癀 | 728 | 48,535.76 | 0.25 |

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券中长信科技（300088）在2014年12月16日公告《中国证券监督管理委员会安徽监管局行政处罚决定书（2014）1号》关于公司基建总监杨建南与业务相关人员陈彬辉涉嫌内幕交易，在内幕信息尚未公开前其股票操作存在明显异常，构成了《证券法》的内幕交易行为，并被中国证券监督管理委员会安徽监管局处以行政处罚。本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该处罚事项未对长信科技的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除此之外，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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 26,539.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | 166,616.02 |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 297.00 |
| 5 | 应收申购款 | 51,309.33 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 244,762.23 |

5.11.4 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。

5.11.5 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

5.11.5.1 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 | 000630 | 铜陵有色 | 384,213.60 | 2.00 | 重大事项停牌 |
| 2 | 000709 | 河北钢铁 | 439,558.00 | 2.29 | 重大事项停牌 |
| 3 | 000024 | 招商地产 | 614,039.50 | 3.20 | 重大事项停牌 |

5.11.5.2 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。

5.11.6 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 | 36,455,553.32 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 9,003,624.69 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 32,930,708.79 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | － |
| 报告期期末基金份额总额 | 12,528,469.22 |

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 6,303,909.21 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | － |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | － |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 6,303,909.21 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 50.32 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§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深证100指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；

2.《东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同）；

3.《东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）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.报告期内东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）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
2015年7月21日

# 东吴新产业精选股票型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015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：二〇一五年七月二十一日

§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2015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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东吴新产业精选股票 |
| 场内简称 | － |
| 基金主代码 | 580008 |
| 交易代码 | 580008 |
| 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9月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 77,364,686.38份 |
| 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，分享新兴产业所带来的投资机会，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，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。 |
| 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较预期风险较高、较预期收益较高的基金产品。 |
| 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(2015年4月1日－2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 40,268,685.88 |
| 2.本期利润 | 2,727,198.61 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0309 |
| 4.期末基金资产净值 | 198,836,930.75 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.570 |

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 | 15.71% | 3.67% | 13.21% | 2.17% | 2.50% | 1.50% |

注：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

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：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

§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 | | |
| 刘元海 | 本基金基金经理、投资管理部副总经理 | 2011年10月26日 | 2015年5月29日 | 11年 | 博士，同济大学毕业。2004年2月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理、投资管理部副总经理、东吴新产业精选股票基金经理、东吴内需增长混合型证券投资基金经理、东吴行业轮动股票型证券投资基金经理。 |
| 戴斌 | 本基金基金经理 | 2013年12月24日 | － | 8年 | 博士，中国人民大学金融学毕业。自2007年1月起加入东吴基金管理有限公司一直从事证券投资研究工作，曾任研究部宏观经济、金融工程研究员、产品策划部产品设计研究员、基金经理助理，现担任基金投资总部副总经理、东吴新产业股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、东吴移动互联股票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》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

2015年二季度，国内资本市场出现了明显波动。大盘在经历了连续上涨之后，于6月15日阶段性见顶进入调整，此后快速下跌，至6月底日高点下跌幅度接近20%。中小市值公司在此轮调整中下跌无其明显，创业板指数自6月5日高点至6月底下跌28%，其中部分个股跌幅更是明显。

二季度宏观经济面环境未发生明显变化。微观数据上，部分一线城市地产出现复苏迹象，但5月份固定资产投资累计增速仅为11.4%，再创新低。6月份中国采购经理人指数为50.2%，与上月持平，略高于50%荣枯线，显示宏观经济依然较为低迷。

随着市场短时间内快速下跌，管理层护市的态度也越发明显。尽管市场还在继续探底，但人气已经有所恢复。尤其是考虑央行降准降息后整体流动性依然保持宽松，市场向好的格局并未发生根本转变。

新产业精选基金保持了一贯的成长投投资策略，重点布局了互联网金融、互联网医疗、电子等板块。未来将继续重点在成长股中寻找确定性的投资机会，重点关注医疗服务、环保、消费电子、互联网等行业。

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2.570元，累计净值2.570元；本报告期份额净值增长率15.71%，同期业绩比较基准收益率为13.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体上我们对三季度市场持乐观态度。

短期看，资金强弱已经发生逆转，负向循环一时难以结束，震荡在所难免，需要用时间换空间。但这波牛市成功的标志一定是产业资本和市场的深度融合，因此这波牛市的魂一定是成长股，所以这个肯定还是大方向。

短期看，尽管管理层出台强力维稳信号，但市场毕竟在短期内剧烈调整，市场的情绪需要时间修复，加之去杠杆的影响，市场在这个位置出现宽幅震荡的概率较大。

往后看，场外配资的清理不会终结，讲故事，市值管理的成长股的逻辑链被打断，所以价值投资有望占据更为重要的位置，精选优质成长股是未来一段时间的选股核心。

新产业精选基金将坚持自下而上的选股策略，坚持选择能够代表未来发展方向的优质成长股。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§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 | 186,512,532.70 | 80.62 |
| | 其中：股票 | 186,512,532.70 | 80.62 |
| 2 | 固定收益投资 | 11,890,075.38 | 5.14 |
| | 其中：债券 | 11,890,075.38 | 5.14 |
| | 资产支持证券 | － | － |
| 3 | 贵金属投资 | － | － |
| 4 | 金融衍生品投资 | － | － |
| 5 | 买入返售金融资产 | － | － |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | － | － |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 24,067,071.70 | 10.40 |
| 7 | 其他资产 | 8,866,984.47 | 3.83 |
| 8 | 合计 | 231,336,664.25 | 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 | 74,683,118.44 | 37.56 |
| 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 | 14,436,757.80 | 7.26 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,341,958.00 | 1.68 |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 46,218,021.98 | 23.24 |
| J | 金融业 | － | － |
| K | 房地产业 | 10,838,679.70 | 5.45 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,789,448.00 | 1.91 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,041,840.00 | 2.54 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,173,240.66 | 1.09 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | － | － |
| P | 教育 | － | － |
| Q | 卫生和社会工作 | 25,989,468.12 | 13.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | － | － |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 186,512,532.70 | 93.80 |

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 | 300244 | 迪安诊断 | 223,066 | 18,724,160.04 | 9.42 |
| 2 | 600446 | 金证股份 | 128,411 | 15,853,622.06 | 7.97 |
| 3 | 002589 | 瑞康医药 | 153,828 | 14,436,757.80 | 7.26 |
| 4 | 002217 | 合力泰 | 612,764 | 13,738,168.88 | 6.91 |
| 5 | 300041 | 回天新材 | 320,131 | 11,515,112.07 | 5.79 |
| 6 | 300299 | 富春通信 | 385,494 | 10,246,430.52 | 5.15 |
| 7 | 002488 | 金固股份 | 253,900 | 8,246,672.00 | 4.15 |
| 8 | 300088 | 长信科技 | 296,171 | 8,144,702.50 | 4.10 |
| 9 | 600571 | 信雅达 | 73,268 | 7,755,417.80 | 3.90 |
| 10 | 600663 | 陆家嘴 | 150,700 | 7,495,818.00 | 3.77 |

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 | － | － |
| 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 | 11,890,075.38 | 5.98 |
| 8 | 其他 | － | － |
| 9 | 合计 | 11,890,075.38 | 5.98 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 | 113008 | 电气转债 | 23,060 | 4,174,782.40 | 2.10 |
| 2 | 113501 | 洛钼转债 | 29,460 | 4,107,902.40 | 2.07 |
| 3 | 113007 | 吉视转债 | 29,110 | 3,606,437.90 | 1.81 |
| 4 | 128009 | 歌尔转债 | 6 | 952.68 | 0.00 |

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券中长信科技（300088）在2014年12月16日公告《中国证券监督管理委员会安徽监管局行政处罚决定书（2014）1号》关于公司基建总监杨建南与业务相关人员陈彬辉涉嫌内幕交易，在内幕信息尚未公开前其股票操作存在明显异常，构成了《证券法》的内幕交易行为，并被中国证券监督管理委员会安徽监管局处以行政处罚。本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该处罚事项未对长信科技的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除此之外，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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 174,692.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,109,551.56 |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 24,679.85 |
| 5 | 应收申购款 | 558,060.18 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 8,866,984.47 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113501 | 洛钼转债 | 4,107,902.40 | 2.07 |
| 2 | 113007 | 吉视转债 | 3,606,437.90 | 1.81 |
| 3 | 128009 | 歌尔转债 | 952.68 | 0.00 |

5.11.5 报告期末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 | 002589 | 瑞康医药 | 14,436,757.80 | 7.26 | 重大事项停牌 |

5.11.6 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 | 54,365,788.24 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 177,796,689.73 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 154,797,791.59 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | － |
| 报告期期末基金份额总额 | 77,364,686.38 |

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§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产业精选股票型证券投资基金设立的文件；

2、《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同）；

3、《东吴新产业精选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、报告期内东吴新产业精选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
2015年7月21日

# 东吴新创业股票型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015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：二〇一五年