东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§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2016年1月15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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴进取策略混合
场内简称	-
基金主代码	580005
交易代码	580005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年5月6日
报告期末基金份额总额	66,771,803.16份
投资目标	本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,以成长股作为投资对象,并对不同成长类型股票采取不同操作策略,追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。
业绩比较基准	65%*沪深300指数+35%*中证全债指数。
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其风险和预期收益要低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	14,197,676.61
2.本期利润	29,763,652.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.4291
4.期末基金资产净值	103,747,490.88
5.期末基金份额净值	1.5538

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,计入费用后实购或赎回净值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	37.43%	2.19%	11.65%	1.08%	25.78%	1.11%

注:比较基准=65%*沪深300指数+35%*中证全债指数

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:比较基准=65%*沪深300指数+35%*中证全债指数

§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		
王立立	本基金基金经理、基金投资总部副总经理	2015年2月6日	-	5.5年	硕士,复旦大学世界经济专业。2010年7月至2010年12月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理,2011年1月至2012年7月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员。自2012年7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,现任基金投资总部副总经理,其中自2013年12月24日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理、自2014年6月14日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自2015年2月6日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理、自2015年5月29日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理、自2015年12月30日起担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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,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投权、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业绩分析

市场在经历了股灾之后信心逐渐恢复,九、十月份出现反弹,个股虽有分化,但赚钱效应明显,面对美联储加息、人民币加入SDR等诸多不利因素,四季度中旬市场进入横盘整理阶段,进取策略基金在反弹中坚持成长股投资,主要仓位集中在TMT、化工、医药生物等板块。

如果说2015年是充满动荡的一年,那么年初的大幅下跌可能预示着2016年更加充满刺棘,投资时机的把握显得格外重要,进取策略基金坚持投资代表国家经济战略转型方向的优质成长股,目前持仓化工、交运设备、TMT、医药生物等个股。

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1.5538元,累计净值1.6238元;本报告期份额净值增长率37.43%,同期业绩比较基准收益率为11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观面上来看,人民币汇率持续贬值,经济依然没有见底,供给侧改革可能面临不破不立的境地,货币宽松虽然仍是方向,但宽松的边际效应可能逐渐减弱。

国家战略转型背景下,代表未来方向的成长个股是市场的热情所在,但估值整体泡沫化是一个不可回避的问题,在估值泡沫化与宏松货币的情况下,巨大的震荡可能成为一种常态,在经历了过去两年的上涨后,今年的投资难度将远胜以往。

全年看成长股仍是投资重点,但也需关注供给侧改革带来的传统行业脉冲式机会,去年股灾后成长类个股反弹幅度较大,估值再度回到历史高位,高估值情况下大幅震荡难以避免,珍惜跌出来的机会,精选个股加波段操作。

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	79,961,207.38	76.39
	其中:股票	79,961,207.38	76.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,948,811.14	12.37
	其中:债券	12,948,811.14	12.37
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,507,150.14	8.13
8	其他资产	3,261,932.39	3.12
9	合计	104,679,101.05	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	66,764,074.57	64.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,560,443.68	3.43
F	批发和零售业	201,422.00	0.19
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	5,997,282.00	5.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,958,345.13	1.89
L	租赁和商务服务业	1,479,640.00	1.43
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	79,961,207.38	77.07

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	002488	金固股份	244,486	7,090,094.00	6.83
2	300073	当升科技	151,515	5,883,327.45	5.67
3	601799	星宇股份	143,399	5,407,576.29	5.21
4	300054	鼎龙股份	212,300	5,377,559.00	5.18
5	300261	雅本化学	341,810	5,161,331.00	4.97
6	002217	合力泰	235,100	3,984,945.00	3.84
7	300028	金亚科技	151,320	3,704,313.60	3.57
8	600463	空港股份	190,704	3,560,443.68	3.43
9	002235	安妮股份	143,100	3,520,260.00	3.39
10	002276	万马股份	112,900	3,398,290.00	3.28

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	12,948,811.14	12.48
8	回业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,948,811.14	12.48

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	128009	歌尔转债	33,482	4,703,216.54	4.53
2	110030	格力转债	33,430	4,612,671.40	4.45
3	110031	航信转债	27,980	3,632,923.20	3.50

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	125,426.03
2	应收证券清算款	2,944,291.06
3	应收股利	-
4	应收利息	5,709.50
5	应收申购款	186,505.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,261,932.39

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	128009	歌尔转债	4,703,216.54	4.53
2	110030	格力转债	4,612,671.40	4.45
3	110031	航信转债	3,632,923.20	3.50

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	300054	鼎龙股份	5,377,559.00	5.18	重大资产重组
2	300028	金亚科技	3,704,313.60	3.57	重大事项停牌
3	002235	安妮股份	3,520,260.00	3.39	重大资产重组

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	69,184,942.04
报告期期间基金总申购份额	11,331,581.70
减:报告期期间基金总赎回份额	13,744,720.58
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	66,771,803.16

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;

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。

§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进取策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2.《东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《东吴进取策略灵活配置混合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.报告期内东吴进取策略灵活配置混合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
2016年1月20日

东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)

2015 第四季度 报告

2015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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1月15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10月1日起至12月31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	11,858,737.23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来建基金股票组合,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10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	43,903.96
2.本期利润	3,198,686.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.2719
4.期末基金资产净值	15,740,812.01
5.期末基金份额净值	1.327

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,计入费用后实购或赎回净值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	25.66%	1.93%	24.55%	1.89%	1.11%	0.04%

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: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)。

§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	-	9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,现任基金经理,自2012年05月03日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自2013年6月5日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,其中自2012年10月27日至2015年5月29日担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理。

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10月8日至2015年12月31日出现连续六十一个交易日基金资产净值低于5000万元的情形,已上报中国证券监督管理委员会,公司正在拟定相关应对方案。

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投权、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业绩分析

四季度宏观经济依旧疲弱,PMI、原材料价格等高频数据显示稳增长政策下生产面并未明显企稳。此时,政府提出在适度宽松的前提下推动供给侧改革,有可能会给经济带来利好冲击,这在最近人民币汇率和债券收益率上都有所表现。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1.327元,累计净值1.327元;本报告期份额净值增长率25.66%,同期业绩比较基准收益率为24.55%。

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,个人认为短期风险释放之后会迎来较长时间的稳定增长期。一方面经济增速已经从快速下滑进入缓慢探底区域,供给侧改革的推进最终希望产能进入到改好的阶段,其对经济的负面冲击到了最后显现的阶段。其次,汇率的快速贬值短期会推升通胀,但是一次性贬值对经济的负面效应要好于持续性贬值,对股市的影响也将会是一次性。第三,在人民币继续下行,慢解困境实体的经营压力,后续各项改革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。比较不确定的是外部环境,美联储加息、贸易环境恶化等因素仍然存在,会造成投资者预期混乱,市场会出现较大的波动。

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10月8日至2015年12月31日出现连续六十一个交易日基金资产净值低于5000万元的情形,已上报中国证券监督管理委员会,公司正在拟定相关应对方案。

§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	14,752,530.05	91.99
	其中:股票	14,752,530.05	91.99
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	1,275,924.21	7.96
7	其他资产	8,384.70	0.05
8	合计	16,036,838.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按投资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	122,351.62	0.78
C	制造业	8,065,081.44	51.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,470.88	0.40
E	建筑业	96,911.84	0.62
F	批发和零售业	426,572.89	2.71
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	1,297,746.96	8.24
J	金融业	1,189,362.37	7.56
K	房地产业	1,291,236.02	8.20
L	租赁和商务服务业	194,568.99	1.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	469,380.59	2.98
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	371,716.52	2.36
S	综合	127,731.52	0.81
	合计	13,715,131.64	87.13

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	23,222.00	0.15
B	采掘业	-	-
C	制造业	658,484.35	4.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,803.00	0.39
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	-	-
J	金融业	95,619.78	0.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	134,779.50	0.86
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	42,348.78	0.27
R	文化、体育和娱乐业	21,141.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	1,037,398.41	6.59

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	000002	万 科A	37,066	905,522.38	5.75
2	000651	格力电器	23,232	519,235.20	3.30
3	000001	平安银行	29,217	350,311.83	2.23
4	000333	美的集团	10,492	344,347.44	2.19
5	300104	乐视网	5,419	318,637.20	2.02
6	002236	大华股份	8,216	303,170.40	1.93
7	002415	海康威视	8,309	285,746.51	1.82
8	002241	歌尔声学	7,892	273,063.20	1.73
9	000063	中兴通讯	14,535	270,787.05	1.72
10	002024	苏宁云商	19,717	265,193.65	1.68

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	600085	同仁堂	4,500	200,745.00	1.28
2	300146	汤臣倍健	3,754	144,529.00	0.92
3	002106	莱宝高科	7,738	103,224.92	0.66
4	601888	中国国旅	1,700	100,827.00	0.64
5	603288	海天味业	2,429	85,865.15	0.55

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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	1,285.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	281.53
5	应收申购款	6,817.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,384.70

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	000002	万 科A	905,522.38	5.75	重大事项停牌
2	300104	乐视网	318,637.20	2.02	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	11,753,304.31
报告期期间基金总申购份额	448,775.02
减:报告期期间基金总赎回份额	343,342.10
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	11,858,737.23

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	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(%)	53.16

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
2016年1月20日

东吴新产业精选混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1月15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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴新产业精选混合
场内简称	-
基金主代码	580008
交易代码	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
报告期末基金份额总额	75,687,644.82份
投资目标	本基金为混合型基金,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混合型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,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。