东吴新创业混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§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 2016 年 4 月 19 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 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴新创业混合
场内简称	-
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	15,054,872.89 份
投资目标	本基金为混合型基金,主要投资于市场中的中小盘股票,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中小盘股,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	(标普中国 A 股 200 指数 *50%+标普中国 A 股小盘 300 指数 *50%)*75%+中证全债指数 *25%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其预期风险和预期收益均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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-4,964,002.58
2.本期利润	-4,875,789.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3349
4.期末基金资产净值	20,744,611.17
5.期末基金份额净值	1.378

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。

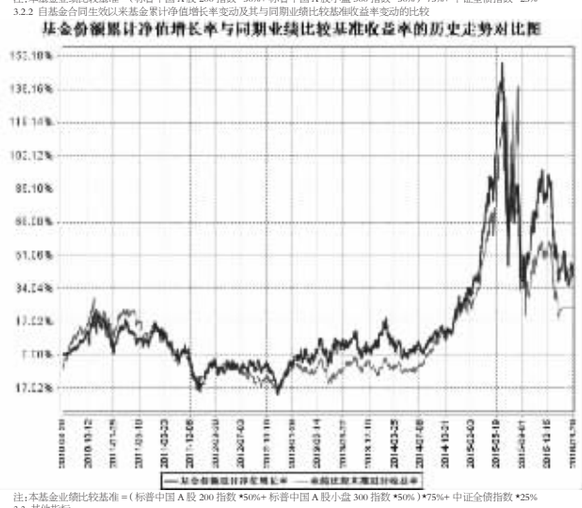
3.2 基金净值表现

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	-21.08%	2.60%	-14.20%	2.34%	-6.88%	0.26%

注:本基金业绩比较基准=(标普中国 A 股 200 指数 *50%+ 标普中国 A 股小盘 300 指数 *50%)*75%+ 中证全债指数 *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:本基金业绩比较基准=(标普中国 A 股 200 指数 *50%+ 标普中国 A 股小盘 300 指数 *50%)*75%+ 中证全债指数 *25%

3.3 其他指标

§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		
徐赠	本基金基金经理	2015年 5 月 29 日	-	6年	硕士,香港中文大学毕业。2009 年 7 月至 2010 年 12 月就职于埃森哲咨询公司上海分公司任行业研究员,自 2011 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司,一直从事投资研究工作,曾任研究员、基金经理助理,现任基金经理,其中 2015 年 5 月 12 日起担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理、2015 年 5 月 29 日起担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理、2015 年 5 月 29 日起担任东吴新创业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 报告期内基金投资策略和运作分析

市场在过去的一个季度里呈现了修复的格局。上证综指最终下跌 15%,创业板下跌 18%。供给侧改革和景气度回升的农林牧渔、化工等板块表现较好,高估值的中小创跌幅巨大。

期间东吴新创业基金重点布局了供给侧改革板块,仓位从 1 月开始就处于较低位置,初始阶段获得了较好的相对收益,但由于对后市判断较为谨慎,因此没能在 3 月中旬市场反弹的第一时间提升仓位,导致反弹幅度较小。

4.5 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 1.3780 元,累计净值 1.4380 元;本报告期份额净值增长率 -21.08%,同期业绩比较基准收益率为 -14.20%。

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,本基金出现连续五十九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	16,858,941.32	78.02
	其中:股票	16,858,941.32	78.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,707,108.91	21.78
8	其他资产	42,656.11	0.20
9	合计	21,608,706.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	716,136.82	3.45
C	制造业	9,600,396.27	46.28
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	1,728,726.00	8.33
J	金融业	724,160.00	3.49
K	房地产业	1,155,162.23	5.57
L	租赁和商务服务业	352,110.00	1.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	386,820.00	1.86
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	1,455,615.16	7.02
S	综合	739,814.84	3.57
	合计	16,858,941.32	81.27

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	300032	金龙机电	48,100	1,017,315.00	4.90
2	000750	国海证券	62,000	724,160.00	3.49
3	300251	光线传媒	28,400	654,620.00	3.16
4	000002	万 科 A	34,483	648,625.23	3.13
5	601028	玉龙股份	77,900	621,642.00	3.00
6	002488	金固股份	24,500	617,890.00	2.98
7	600699	均胜电子	17,000	581,570.00	2.80
8	002230	科大讯飞	17,800	577,076.00	2.78
9	600666	奥瑞德	18,117	558,184.77	2.69
10	002655	共达电声	30,650	547,715.50	2.64

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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	36,726.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,257.56
5	应收申购款	4,672.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,656.11

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

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	648,625.23	3.13	重大资产重组
2	002230	科大讯飞	577,076.00	2.78	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	13,312,599.95
报告期期间基金总申购份额	2,527,309.78
减:报告期期间基金总赎回份额	785,036.84
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	15,054,872.89

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创业混合型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴新创业混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴新创业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、报告期内东吴新创业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 4 月 22 日

东吴新产业精选混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:二〇一六年四月二十二日

§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 4 月 19 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 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴新产业精选混合
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	72,077,230.78 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。
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-27,851,615.16
2.本期利润	-47,660,900.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6681
4.期末基金资产净值	134,591,209.68
5.期末基金份额净值	1.867

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	-25.44%	3.51%	-13.11%	2.23%	-12.33%	1.28%

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

§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		
戴斌	权益投资部副总经理,本基金基金经理	2013年 12 月 24 日	-	9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,现任权益投资部副总经理。其中自 2013 年 12 月 24 日起担任东吴新产业混合型证券投资基金基金经理,自 2014 年 12 月 12 日起担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理,自 2015 年 5 月 27 日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2015 年 7 月 1 日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金基金经理,自 2015 年 8 月 19 日起担任东吴配置优化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》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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度,受地产调控政策阶段性放松以及库存周期重启的拉动,国内宏观经济出现企稳反弹,各项指标均呈现出回升态势。

投资回暖,二月份地产投资增速回升至 3%,受此影响,二月份固定资产投资增速回升至 10.2%;消费平稳,前两个月社会消费品零售总额同比增长 10.2%;三月份出口回比增长 11.5%,这是去年 6 月份以来首次正增长。

景气指数方面,3 月 PMI 回比上涨 50.2%,连续 7 个月来首次站上荣枯线。

可喜的是,经济的复苏并未带来明显的通胀,三月份 CPI 同比上涨 2.3%,其中食品价格上涨 7.6%,是物价上涨的主因,但依然低于市场预期。相对平稳的物价水平为货币政策留出了空间。

资本市场在一季度经历了剧烈波动。市场自身的结构性问题叠加制度性缺陷,导致上证综指开年即出现巨幅下跌,至 2 月始企稳,并逐步回暖。截至 3 月末,上证综指下跌 15.12%,创业板指数下跌 17.53%。板块中,新能源汽车、智能驾驶等主题反弹较快。

这一过程中,新产业精选基金保持了一贯的成长股投资策略,重点布局了传媒、计算机、汽车电子等板块。未来将继续重点在成长股中寻找确定性的投资机会,坚持自下而上的选股理念。重点关注医疗服务、传媒、大金融等行业。

4.5 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 1.867 元,累计净值 1.867 元;本报告期份额净值增长率 -25.44%,同期业绩比较基准收益率为 -13.11%。

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	126,659,958.55	90.45
	其中:股票	126,659,958.55	90.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	7,787,158.67	5.56
8	其他资产	5,587,898.69	3.99
9	合计	140,035,015.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	70,024,124.69	52.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,965,165.44	2.95
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	789,945.50	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,666,382.56	8.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,477,901.83	10.76
L	租赁和商务服务业	3,970,430.00	2.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,570,805.00	1.91
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	15,918,512.60	11.83
S	综合	3,276,690.93	2.43
	合计	126,659,958.55	94.11

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	603601	再升科技	372,736	12,773,662.72	9.49
2	300031	宝通科技	469,868	11,366,106.92	8.44
3	000002	万 科 A	527,080	9,914,374.80	7.37
4	002329	皇氏集团	437,350	7,316,865.50	5.44
5	600556	慧球科技	352,791	5,616,432.72	4.17
6	300133	华策影视	205,093	5,455,473.80	4.05
7	002488	金固股份	157,500	3,972,150.00	2.95
8	002325	洪涛股份	320,288	3,965,165.44	2.95
9	600730	中国高科	233,400	3,939,792.00	2.93
10	300150	世纪瑞尔	307,793	3,912,049.03	2.91

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	145,213.29
2	应收证券清算款	4,960,170.35
3	应收股利	-
4	应收利息	2,625.32
5	应收申购款	479,889.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,587,898.69

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

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	9,914,374.80	7.37	重大资产重组
2	600556	慧球科技	5,616,432.72	4.17	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	75,687,644.82
报告期期间基金总申购份额	29,348,542.69
减:报告期期间基金总赎回份额	32,958,956.73
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	72,077,230.78

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混合型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴新产业精选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、报告期内东吴新产业精选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 4 月 22 日

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)

2016 第一季度 报告

2016年3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:二〇一六年四月二十二日

§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 4 月 19 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 2016 年 1 月 1 日起至 3 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	11,742,294.91 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-205,857.12
2.本期利润	-2,588,034.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2181
4.期末基金资产净值	12,947,099.45
5.期末基金份额净值	1.103

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	-16.88%	2.92%	-14.68%	2.66%	-2.20%	0.26%

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、自 2016 年 2 月 3 日起担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2016 年 2 月 5 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,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、此处的任职日期均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 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 3 月 31 日连续五十九个工作日出现基金资产净值低于 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,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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,在地产、基建等一系列稳增长政策的推动下,经济数据