

# 东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：二〇一七年一月二十一日

## § 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东吴中证新兴指数
场内简称	-
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	107, 443, 603. 28 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增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（2016年10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	-1,845,092.40
2. 本期利润	-784,284.10
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0070
4. 期末基金资产净值	118,481,995.33
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

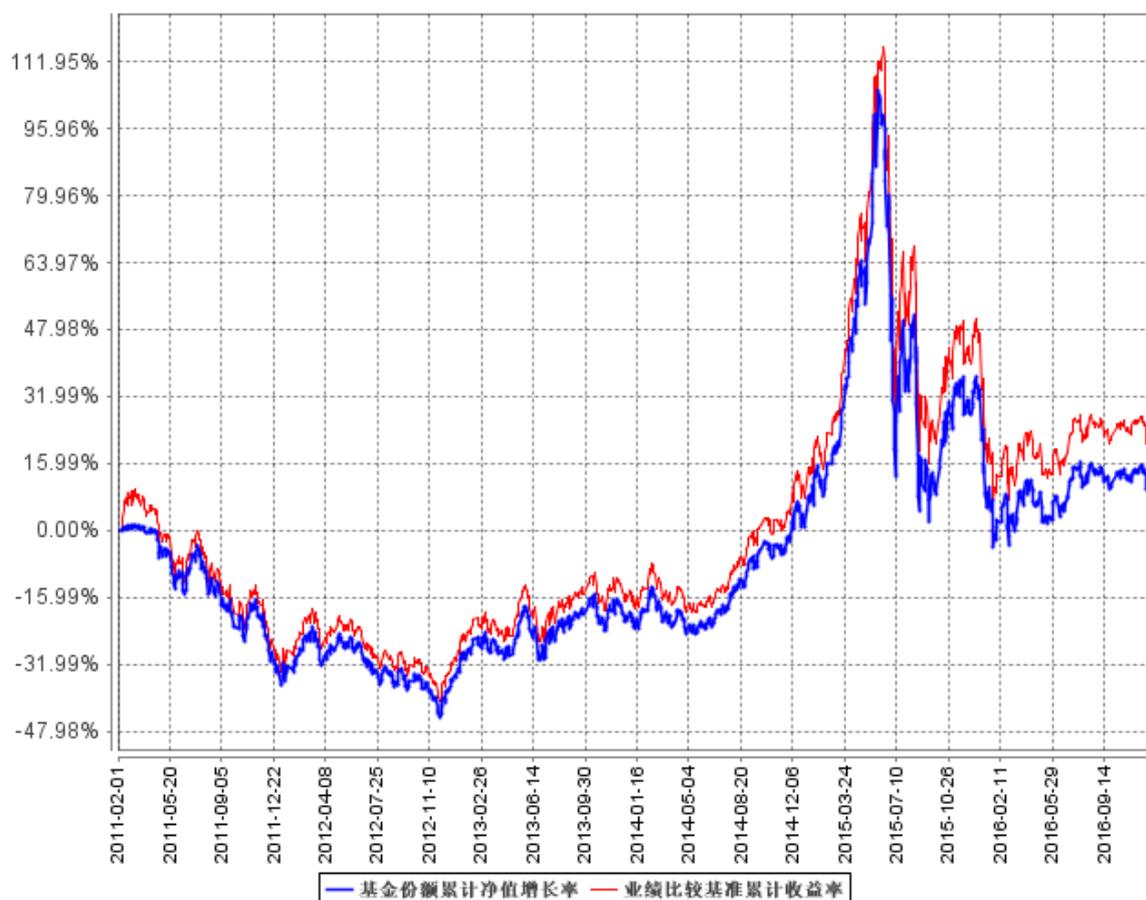
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.81%	0.72%	-1.94%	0.75%	1.13%	-0.03%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

## § 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	-	10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，自 2016 年 6 月 3 日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 11 日起担任东吴智慧医疗量化策略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 日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期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间向交易价差的分析，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

四季度，经济保持平稳增长，但通胀水平回升，PPI 快速上行，市场上开始出现滞胀的讨论。在地产、汽车等行业需求降温的同时，政府启动 PPP 基建项目，拉动民间投资，对冲投资增速快速下滑的风险。货币政策方面，上半年宽松的信贷政策出现拐头，监管层也在不断推动债市去杠杆，引发资金成本阶段性快速上升，对市场风险偏好造成负面影响。海外方面，国际政治局势快

速变化，美元加速升值，市场对冲系统性风险的需求在上升。在以上因素的共同作用之下，股票市场出现冲高回落的走势，成长股回调明显，由于中证新兴指数基金所配置的板块偏向军工、新能源等新兴产业，整体表现偏弱。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。

#### 4.5 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 1.103 元，累计净值 1.103 元；本报告期份额净值增长率-0.81%，同期业绩比较基准收益率为-1.94%。

#### 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	111,721,373.88	93.25
	其中：股票	111,721,373.88	93.25
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	8,072,261.58	6.74
8	其他资产	10,874.86	0.01
9	合计	119,804,510.32	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	2,352,340.98	1.99
B	采矿业	2,229,326.64	1.88
C	制造业	79,227,518.44	66.87

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,086,408.00	0.92
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	21,249,434.45	17.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	2,274,464.74	1.92
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	1,109,112.57	0.94
S	综合	-	-
	合计	109,528,605.82	92.44

### 5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	1,962,014.68	1.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.03
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,511.65	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,583.84	0.09
J	金融业	60,148.00	0.05
K	房地产业	-	-
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	2,192,768.06	1.85

### 5.2.3 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

### 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	000538	云南白药	19,266	1,467,105.90	1.24
2	601727	上海电气	154,708	1,302,641.36	1.10
3	002252	上海莱士	55,240	1,275,491.60	1.08
4	600718	东软集团	63,234	1,243,180.44	1.05
5	600703	三安光电	92,019	1,232,134.41	1.04
6	000998	隆平高科	57,414	1,230,382.02	1.04
7	600309	万华化学	57,034	1,227,942.02	1.04
8	600038	中直股份	25,275	1,223,815.50	1.03
9	600406	国电南瑞	73,466	1,221,739.58	1.03
10	600518	康美药业	66,680	1,190,238.00	1.00

### 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	600875	东方电气	108,654	1,172,376.66	0.99
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.10
3	600996	贵广网络	5,416	101,766.64	0.09
4	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.06
5	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.06

## 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	8,794.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,583.60
5	应收申购款	496.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,874.86

### 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	601727	上海电气	1,302,641.36	1.10	重要事项停牌
2	600406	国电南瑞	1,221,739.58	1.03	重要事项停牌

#### 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

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	600875	东方电气	1,172,376.66	0.99	重要事项停牌

### 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	116,857,274.46
报告期期间基金总申购份额	682,900.26
减：报告期期间基金总赎回份额	10,096,571.44

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	107,443,603.28

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中证新兴产业指数证券投资基金设立的文件；
2. 《东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金合同》；
3. 《东吴中证新兴产业指数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. 报告期内东吴中证新兴产业指数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  
2017 年 1 月 21 日