

东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2012 年第 4 季度报告

2012 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：二〇一三年一月十九日

§ 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 2013 年 1 月 17 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 2012 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
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	1,680,187,679.37 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（ 2012 年 10 月 1 日 - 2012 年 12 月 31 日 ）
1. 本期已实现收益	-41,419,365.70
2. 本期利润	24,628,900.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0142
4. 期末基金资产净值	1,099,638,574.88
5. 期末基金份额净值	0.654

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

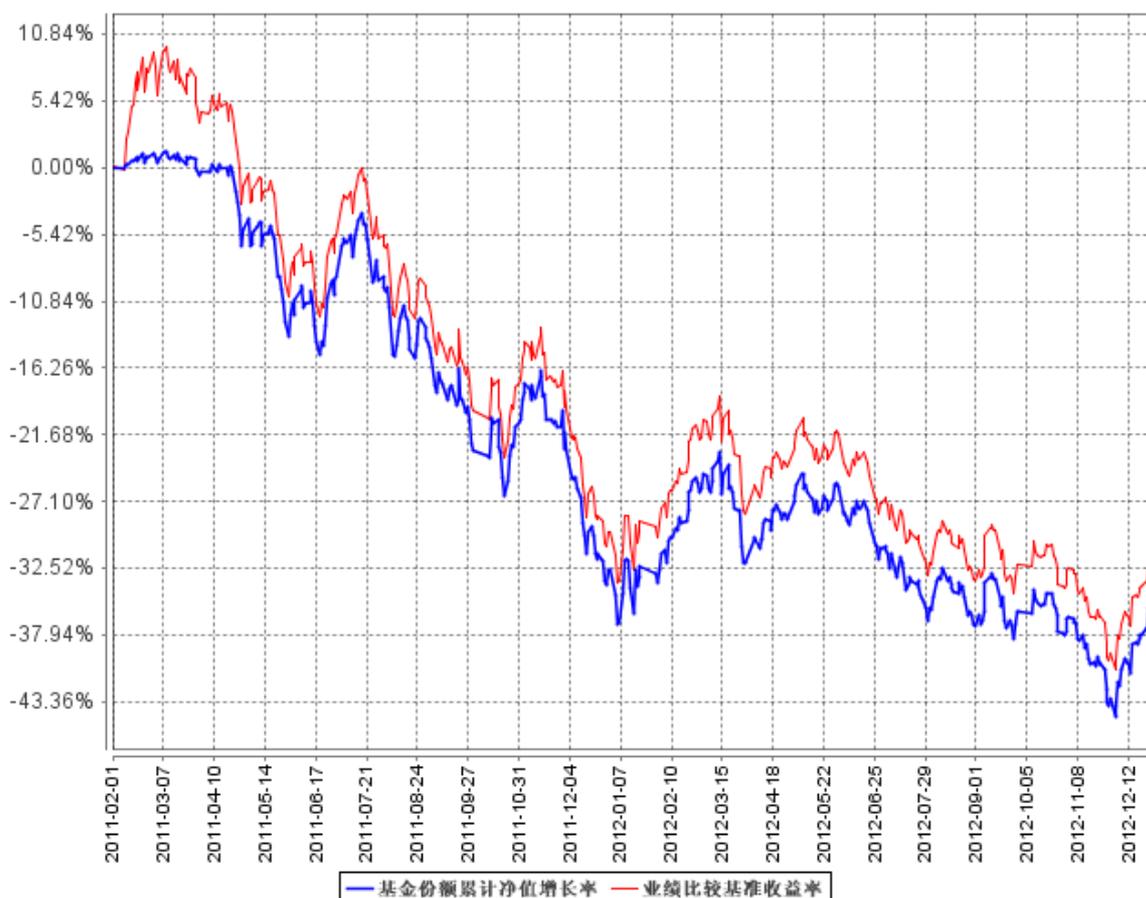
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	2.19%	1.29%	2.67%	1.29%	-0.48%	0.00%

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：1、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。

2、本基金于 2011 年 2 月 1 日成立。

§ 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	-	5.5 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，现担任东吴中证新兴产业指数基金经理、东吴新创业股票基金基金经理。
王少成	本基金的基金经理	2011 年 2 月 1 日	2012 年 12 月 1 日	9 年	硕士，复旦大学毕业。曾任上海融昌资产管理公司研究员、中原证券自营部投资经理、信诚基金管理有限公

					司研究员、研究总监助理等职。2009 年 6 月加入东吴基金管理有限公司，曾担任公司投资管理部副总经理、东吴双动力股票基金基金经理、东吴新创业股票基金基金经理、东吴中证新兴指数基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、王少成先生为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金合同生效日。

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合规守信情况的说明

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

四季度，无论是微观还是宏观层面，数据都显示经济进入温和复苏阶段，工业企业收入和利润已经实现三个月的同比改善，其中利润率持续回升是不可忽视的积极信号。地产销售和投资继续强劲反弹，社会消费品零售增速也保持坚挺，出口增速逐步企稳，进口有望反弹。年末期间发改委批复了较多项目，反映基建投资继续受到政策面支持，而近期召开的中央经济工作会议也重申了当前的宏观政策基调，预计 2013 年整体信贷增长将会对投资以及名义 GDP 的增长起到积极的拉动作用。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。

4.4.2 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 0.654 元，累计净值 0.654 元；本报告期份额净值增长率 2.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议提出的主要任务中，第一条就是加强和改善宏观调控，促进经济持续健康发展，要求的是尊重经济规律、有质量、有效益、可持续的速度，在不断转变经济发展方式、不断优化经济结构中实现增长，其关键就是深化产业结构战略性调整，着力增强创新驱动发展新动力。虽然国际金融危机对经济造成较大负面影响，但是政府有意借助其倒逼机制，化解体内产能过剩的矛盾，这就是危中之机。所以政策大方向上仍然是要围绕经济结构转型，这会是未来市场持久的主题。

所谓经济结构转型，就是要使经济中各个结构向着一个更合理更协调的方向发展，包括产业结构、分配结构、劳动力结构等等。实现转型的途径就是依靠市场机制，将资源配置到生产率、回报率等综合效用最高的区域、产业和行业中。简单从行业层面看，目前中国在传统行业上产能过剩，在新兴产业上投入不足，投资效用低下，这正是经济结构失衡的主要表现，转型的趋势不可阻挡。在较长的经济转型阶段，新兴产业相关的上市公司将会持续快速发展，包括新能源、新技术以及相关的现代服务业。中证新兴产业指数正是基于以上转型思路优选出的主题策略指数，具备长期投资价值。

作为被动投资的基金，本基金将继续坚持指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，积极应对申购赎回、成分股调整等因素对指数跟踪带来的冲击，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

§ 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	1,038,374,390.49	91.57
	其中：股票	1,038,374,390.49	91.57
2	固定收益投资	29,968,000.00	2.64
	其中：债券	29,968,000.00	2.64
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

5	银行存款和结算备付金合计	43,596,678.05	3.84
6	其他资产	21,987,539.52	1.94
7	合计	1,133,926,608.06	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	21,261,920.40	1.93
B	采掘业	21,775,204.67	1.98
C	制造业	721,048,188.37	65.57
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	54,166,048.32	4.93
C5	电子	50,887,491.31	4.63
C6	金属、非金属	115,348,358.29	10.49
C7	机械、设备、仪表	324,660,672.94	29.52
C8	医药、生物制品	166,408,154.56	15.13
C99	其他制造业	9,577,462.95	0.87
D	电力、煤气及水的生产和供应业	20,288,882.88	1.85
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	154,526,752.23	14.05
H	批发和零售贸易	3,127,989.59	0.28
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	23,383,160.42	2.13
L	传播与文化产业	10,107,331.90	0.92
M	综合类	12,904,892.73	1.17
	合计	988,424,323.19	89.89

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	-	-
C	制造业	27,687,466.90	2.52
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	13,535,817.52	1.23
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	7,115,280.95	0.65
C8	医药、生物制品	7,036,368.43	0.64
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,298,317.60	1.39
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,964,282.80	0.63
	合计	49,950,067.30	4.54

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	000826	桑德环境	552,812	12,709,147.88	1.16
2	002230	科大讯飞	406,481	12,316,374.30	1.12
3	600867	通化东宝	1,283,793	12,196,033.50	1.11
4	600104	上汽集团	685,437	12,091,108.68	1.10
5	000625	长安汽车	1,802,558	11,987,010.70	1.09
6	002038	双鹭药业	299,165	11,834,967.40	1.08
7	600031	三一重工	1,113,788	11,795,014.92	1.07
8	600517	置信电气	852,512	11,764,665.60	1.07
9	000063	中兴通讯	1,192,106	11,623,033.50	1.06
10	600436	片仔癀	106,674	11,618,932.08	1.06

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	002405	四维图新	656,865	7,705,026.45	0.70
2	002465	海格通信	263,199	7,593,291.15	0.69
3	600582	天地科技	626,897	7,115,280.95	0.65
4	600535	天士力	127,309	7,036,368.43	0.64
5	600366	宁波韵升	439,886	6,980,990.82	0.63

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	29,968,000.00	2.73
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	29,968,000.00	2.73

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1001079	10 央行票据 79	200,000	19,964,000.00	1.82
2	1001099	10 央行票据 99	100,000	10,004,000.00	0.91

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末没有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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	21,737,857.45
3	应收股利	-
4	应收利息	210,914.46
5	应收申购款	38,767.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,987,539.52

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 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。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	1,734,361,049.71
本报告期基金总申购份额	38,036,436.61

减:本报告期基金总赎回份额	92,209,806.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,680,187,679.37

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 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

8.3 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
2013年1月19日