

东吴新产业精选股票型证券投资基金 2014 年第 3 季度报告

2014 年 9 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：二〇一四年十月二十七日

§ 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 2014 年 10 月 22 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 2014 年 7 月 1 日起至 9 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	44,454,827.16 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预期风险较高、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（2014 年 7 月 1 日 — 2014 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	2,418,142.02
2. 本期利润	12,185,321.67
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2761
4. 期末基金资产净值	70,113,893.49
5. 期末基金份额净值	1.577

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

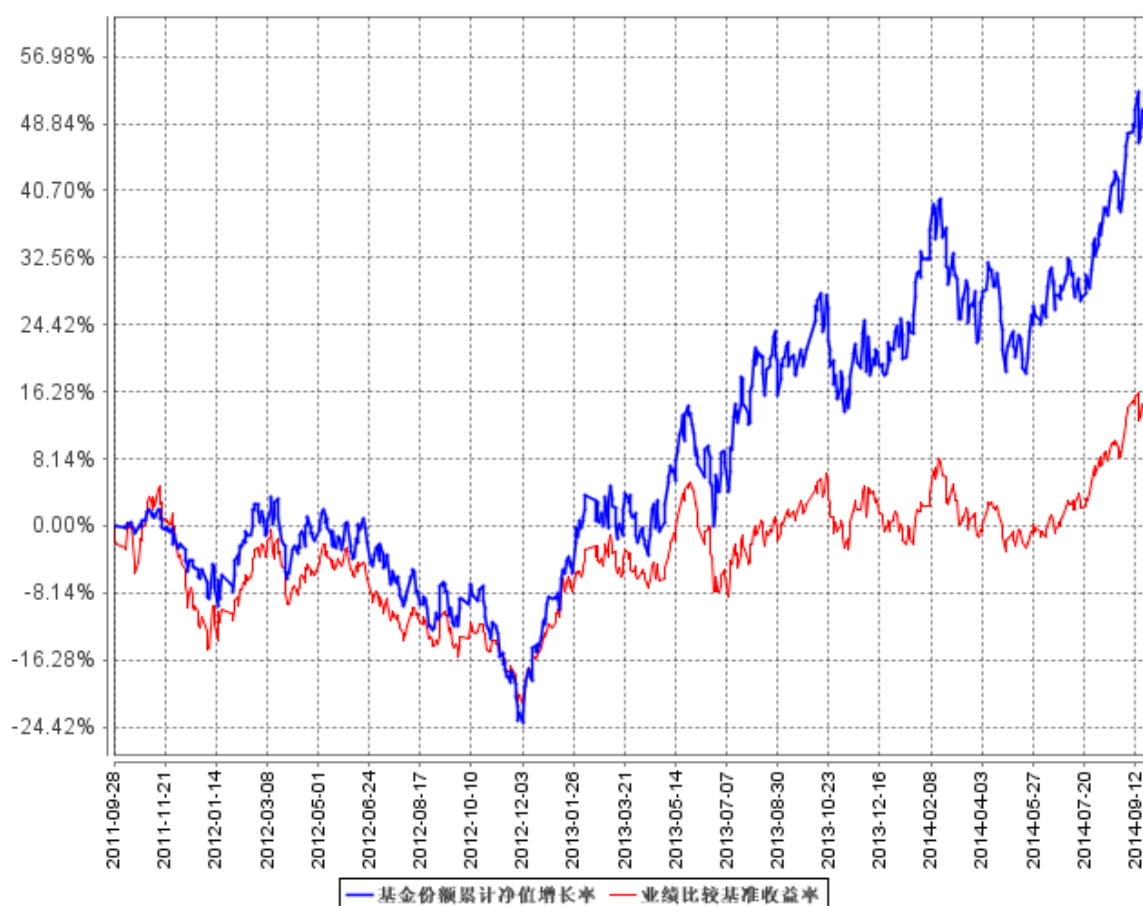
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	21.40%	1.10%	15.27%	0.75%	6.13%	0.35%

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

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. 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

2. 本基金于 2011 年 9 月 28 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		
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	—	10 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、基金经理助理等职务；现担任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	-	7.5 年	硕士，英国格拉斯哥大学经济、银行与金融学专业毕业。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，现担任东吴新产业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

2014 年三季度，国内经济呈现见底企稳态势。

9 月份中采 PMI 指数为 51.1，汇丰指数为 50.2，均与 8 月份持平。考虑到 8 月份经济出现再次探底，其中 8 月固定资产投资完成额累计同比增长仅为 16.5%，远低于预期；规模以上工业增加值累计同比增速为 8.5%，单月同比仅为 6.9%，更是与 08 年金融危机时期相当。两相比较，数据至少反映了经济已经有企稳迹象。

好在整体流动性依然充裕，资金价格始终维持在低位，尤其是真实利率下降明显。

但市场似乎比经济本身更乐观。期间上证综指上涨了 15.4%，创业板指数上涨 9.69%。市场对改革的预期尤其强烈，个股热点纷呈。

二季度新产业精选基金继续坚持以成长股为导向的投资思路，集中配置了高景气度消费电子、油气、软件等行业，并坚持自下而上精选个股，取得了较为明显的收益。

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 1.577 元，累计净值 1.577 元；本报告期份额净值增长率 21.4%，同期业绩比较基准收益率为 15.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对四季度的市场表现我们依然报相对乐观的态度。转型阶段，市场的核心矛盾将从盈利增速向改革力度转移，背后的核心是效率提升。传统依靠地产拉动的经济模式，其出清过程一定是刚性的，这就需要改革来破旧立新。传统垄断行业向民营资本的放开，新产业的蓬勃发展，都将对整体经济的效率提升产生根本性影响。这一主线之下，宏观数据向下，企业盈利低迷，政策放松落空等都不再是市场关注的核心。

新产业精选基金始终坚持自下而上选股的投资策略，在坚定看好的智能家居、油气、移动互联网、军工上进行布局，同时将择机在医药生物和计算机板块进行加仓。

§ 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	66,460,547.86	92.48
	其中：股票	66,460,547.86	92.48
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	4,455,043.00	6.20
7	其他资产	947,440.67	1.32
8	合计	71,863,031.53	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	37,142,094.70	52.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,704,380.00	3.86
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,907,229.00	4.15
G	交通运输、仓储和邮政业	1,379,074.00	1.97
H	住宿和餐饮业	3,931,829.77	5.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,445,375.21	22.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,356,652.00	3.36
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	593,913.18	0.85
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	66,460,547.86	94.79

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	300183	东软载波	121,917	6,599,367.21	9.41
2	002309	中利科技	248,253	5,632,860.57	8.03
3	600446	金证股份	127,000	5,236,210.00	7.47
4	300309	吉艾科技	165,290	4,160,349.30	5.93
5	002649	博彦科技	97,800	3,609,798.00	5.15

6	002131	利欧股份	148,400	3,392,424.00	4.84
7	002489	浙江永强	231,613	3,207,840.05	4.58
8	002306	中科云网	284,299	3,192,677.77	4.55
9	300337	银邦股份	166,000	2,994,640.00	4.27
10	600175	美都控股	447,266	2,907,229.00	4.15

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	66,639.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,347.39
5	应收申购款	879,453.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	947,440.67

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

本基金本报告期末前十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	45,117,376.57
报告期期间基金总申购份额	10,528,666.18
减：报告期期间基金总赎回份额	11,191,215.59
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	44,454,827.16

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

2014 年 9 月 17 日《东吴基金管理有限公司关于股权变更的公告》，经东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]855 号文批复同意，本公司原股东江阴澄星实业集团有限公司将其持有的本公司 21%股权转让给东吴证券股份有限公司。

§ 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
2014 年 10 月 27 日