

东吴新产业精选混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

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

送出日期：二〇一六年三月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

根据基金管理人 2015 年 8 月 7 日刊登的《东吴基金关于旗下部分开放式基金变更基金名称、基金类别及修订基金合同相应条款的公告》，“东吴新产业精选股票型证券投资基金”自 2015 年 8 月 7 日起更名为“东吴新产业精选混合型证券投资基金”，基金类别“股票型基金”变更为“混合型基金”。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
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
报告期末基金份额总额	75,687,644.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	田青
	联系电话	021-50509888-8308	010-67595096
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	8,779,971.03	13,626,582.17	16,569,393.71
本期利润	25,889,506.06	11,870,576.12	16,938,600.52
加权平均基金份额本期利润	0.3673	0.2505	0.3033
本期基金份额净值增长率	60.31%	28.35%	33.01%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4962	0.4548	0.1505
期末基金资产净值	189,485,726.00	122,119,857.36	63,844,598.30
期末基金份额净值	2.504	1.562	1.217

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金于 2011 年 9 月 28 日成立。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

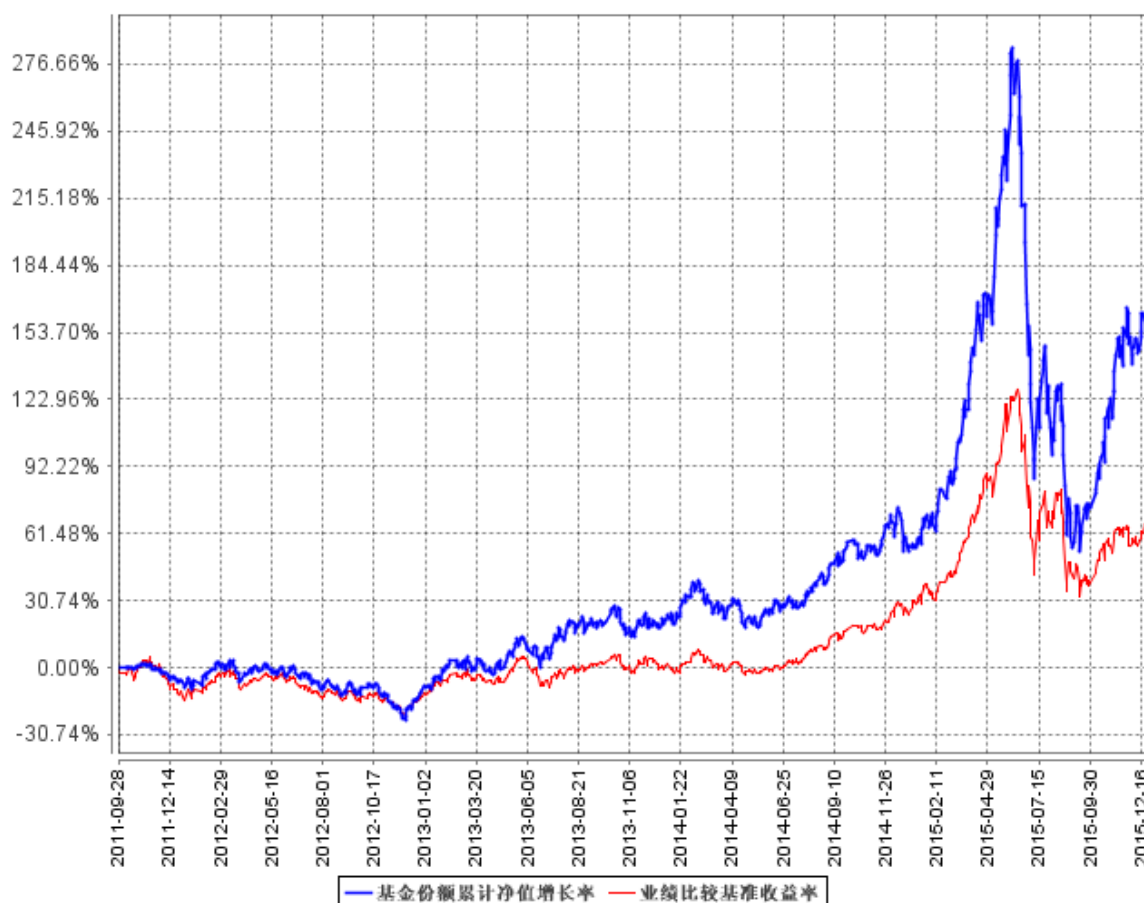
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	44.74%	2.59%	15.18%	1.50%	29.56%	1.09%
过去六个月	-2.57%	3.72%	-10.27%	2.46%	7.70%	1.26%
过去一年	60.31%	3.36%	27.52%	2.14%	32.79%	1.22%
过去三年	173.66%	2.29%	89.93%	1.50%	83.73%	0.79%
过去五年	-	-	-	-	-	-

自基金合同 生效起至今	150.40%	2.03%	61.43%	1.40%	88.97%	0.63%
----------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

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份额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

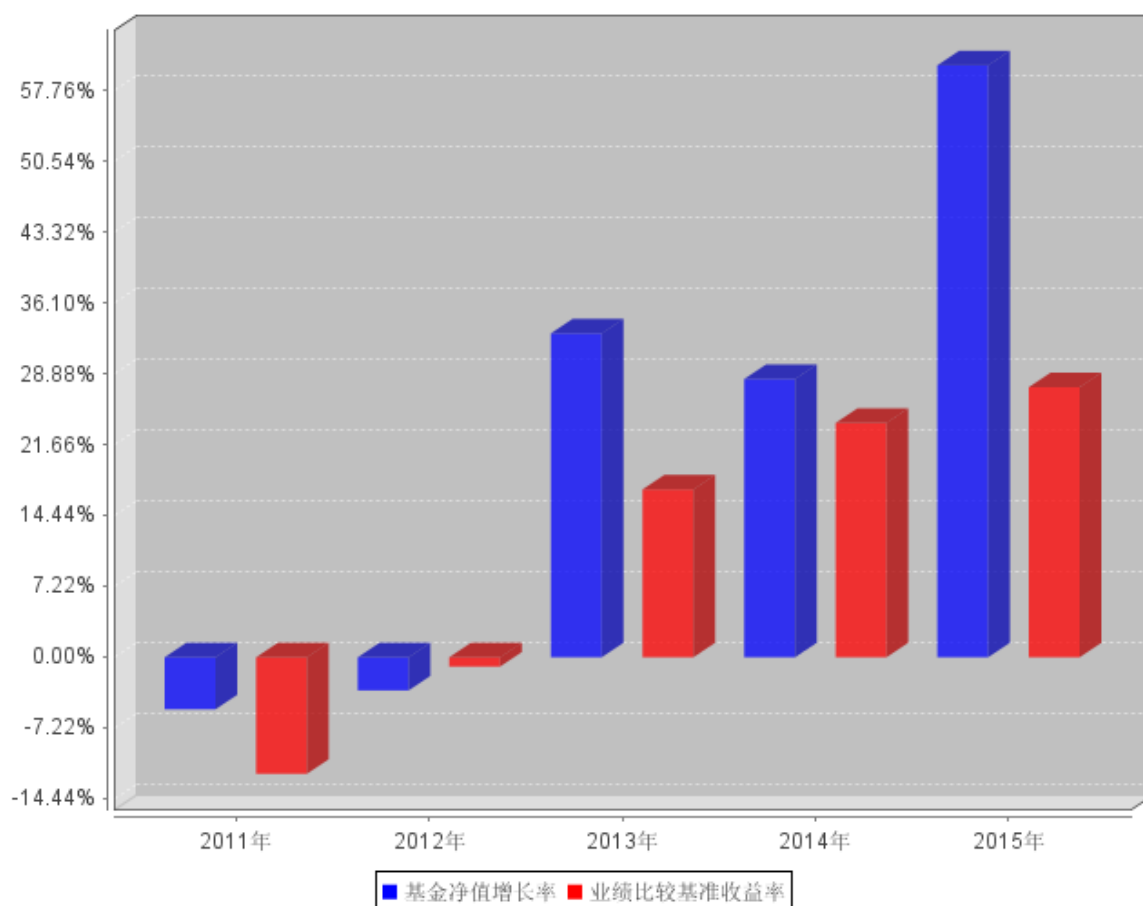


注：1. 比较基准= 75%*中证新兴产业指数收益率 +25%*中国债券综合全价指数收益率。

2. 本基金于 2011 年 9 月 28 日成立。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2011 年 9 月 28 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字【2003】82 号批准设立的证券投资基金管理公司，于 2004 年 9 月正式成立，注册资本人民币 1 亿元，公司股东为东吴证券股份有限公司（占 70%股份）、上海兰生（集团）有限公司（占 30%股份）。

公司经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。自 2005 年发行第一支基金以来，公司逐渐形成了高中低风险结合的完善产品线，并走出了一条独具特色

的新兴产业投资产品线。公司经过十多年的发展，资产管理规模超 400 亿元，发行公募产品 20 只，专户产品 20 只，子公司专项资产管理计划 124 个。公司一直坚持建立现代财富管理机构，促进公募、专户和专项三项业务齐头并进的发展战略方向，以服务实体经济为目标，加大创新力度，促进公司业务的多元化发展。

东吴基金拥有一支经验丰富而又充满活力的专业团队，平均年龄 33 岁，其中一半以上员工具有硕士及以上学历，具有 5 年以上基金、证券从业经历的占 70%，公司高管和主要投资管理人員的平均金融从业年限为 10 年，具有丰富的实践操作经验和管理经验。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有争、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”的远大理想，创造性地树立公司独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

2015 年，公司顺应东吴证券互联网财富管理战略，以财富管理多元化、业务拓展平台化、营销服务网络化、运营管理规范化为抓手，认真部署、合理统筹各项工作，推动东吴基金转型创新上新台阶，整体经营情况实现较好的发展势头，公司营业收入与利润总额连续三年创了新高。目前公司各项产品线日臻完善，现代财富管理公司初现雏形：公司公募、专户、专项三业并举，产品线覆盖股票、债券、平台融资类资管计划等多个领域；投资范围横跨一级市场、一级半市场、二级市场；服务客户既包括投资理财领域也包括政府、企业等实体经济领域。由此公司业务结构也日趋多元化，成功向现代财富管理公司不断迈进。下一步，公司将秉承“三满意一放心”的经营理念，继续以市场为导向、以客户为中心，强化服务意识，拓展发展空间，全面提高公司的核心竞争力，谱写向现代财富管理公司转型的新篇章。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴斌	基金投资总部副总经理、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，现任基金投资总部副总经理，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。
刘元海	本基金基金经理	2011 年 10 月 26 日	2015 年 5 月 29 日	11 年	博士，同济大学毕业。2004 年 2 月 15 日至 2015 年 6 月 30 日就职于东吴基金管理有限公司，历任研究策划部研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理等职。

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，因本基金持有的股票瑞康医药(002589)、金证股份(600446)连续停牌，期间本

基金出现大额赎回，本基金出现连续十个交易日以上分别投资于瑞康医药(002589)、金证股份(600446)的比例超过基金资产净值 10%的情况，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理的设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析未发现异常情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年宏观经济依然在寻底过程中。各单月增速数据看，新增固定资产投资增速全年都徘徊

在 20%以内，其中房地产投资增速更是一路下降为个位数，12 月增速仅为 1%；社会消费品零售总额尽管依然有两位数增长，但较往年也下了一个台阶，全年基本在 10%附近徘徊；贸易依然保持顺差，但增速较往年也有明显回落。三驾马车的疲弱造成宏观经济短期难有表现。

这一背景下，货币政策保持了宽松态势。年内央行多次降息降准，并通过公开市场操作等方式向市场注入流动性，降低了实体资金价格。目前看，这一趋势并未发生改变。

资本市场发生了剧烈波动。年初大盘蓝筹与中小创比翼齐飞，至二季度成长股疯涨，到 6 月份市场剧烈调整，至 9 月份市场阶段性见底企稳反弹。全年看，A 股震荡剧烈，走势惊心动魄。成长股表现依然优于蓝筹股，概念板块中，上半年互联网金融一枝独秀，下半年传媒、新能源汽车崛起，国企改革、迪斯尼等也有阶段性表现。

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，重点关注医疗服务、传媒、消费电子、互联网等行业。

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 2.504 元，累计净值 2.504 元；本报告期份额净值增长率 60.31%，同期业绩比较基准收益率为 27.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体上我们对 2016 年市场持谨慎乐观态度。

尽管市场在新年伊始就出现明显下跌，个股跌幅更是惊人，但往后看，不确定性正在逐步消失。海外市场逐步稳定，货币政策继续收紧的概率不大；国内看，货币政策依然处于宽松周期，且宏观经济层面的托底政策正在加码，尤其对房地产行业的刺激已经明确，这将对整体经济的企稳起到至关重要的作用。供给侧改革的力度也明显加大，也为经济见底回升奠定了基础。

结构性上看，尽管由于估值较高、行业政策制约等不利因素尚存，但随着市场调整，尤其是成长股的风险已经得到相当程度的释放。站在全年维度看，目前已经是布局优质成长股的良好时机。

新产业精选基金将坚持自下而上的选股策略，坚持选择能够代表未来发展方向的优质成长股进行布局。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司运营总监、基金会计、产品策划人员、监察稽核人员、基金投资部负责人等组成，同时，相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。产品策划相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营总监、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；监察稽核业务相关人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了天衡审字（2016）00682 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴新产业精选混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	12,170,914.74	9,138,485.49
结算备付金	1,557,864.66	527,996.78
存出保证金	262,800.64	71,010.96
交易性金融资产	178,720,506.68	113,841,435.23
其中：股票投资	178,720,506.68	113,841,435.23
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,499,281.44	9,294,975.43
应收利息	4,164.95	2,305.83
应收股利	-	-
应收申购款	163,868.78	142,153.68
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	197,379,401.89	133,018,363.40
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	4,308,579.12	8,795,442.60
应付赎回款	2,310,971.18	1,211,619.86
应付管理人报酬	253,817.91	147,891.81
应付托管费	42,302.99	24,648.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	729,368.73	374,782.43
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	248,635.96	344,120.73
负债合计	7,893,675.89	10,898,506.04
所有者权益：		
实收基金	75,687,644.82	78,177,962.93
未分配利润	113,798,081.18	43,941,894.43
所有者权益合计	189,485,726.00	122,119,857.36
负债和所有者权益总计	197,379,401.89	133,018,363.40

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.504 元，基金份额总额 75,687,644.82 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴新产业精选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	33,509,263.26	15,081,748.65
1. 利息收入	151,306.77	85,200.67
其中：存款利息收入	149,289.18	69,254.25
债券利息收入	2,017.59	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	15,946.42
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,231,752.65	16,669,698.41
其中：股票投资收益	19,362,461.08	16,361,318.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,451,056.49	-

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	320,348.06	308,379.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	17,109,535.03	-1,756,006.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,016,668.81	82,855.62
减：二、费用	7,619,757.20	3,211,172.53
1. 管理人报酬	2,476,948.74	986,500.86
2. 托管费	412,824.86	164,416.79
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,361,665.02	1,698,072.90
5. 利息支出	9,790.97	-
其中：卖出回购金融资产支出	9,790.97	-
6. 其他费用	358,527.61	362,181.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	25,889,506.06	11,870,576.12
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	25,889,506.06	11,870,576.12

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新产业精选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	78,177,962.93	43,941,894.43	122,119,857.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,889,506.06	25,889,506.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,490,318.11	43,966,680.69	41,476,362.58
其中：1. 基金申购款	331,381,232.28	550,719,726.79	882,100,959.07
2. 基金赎回款	-333,871,550.39	-506,753,046.10	-840,624,596.49

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	75,687,644.82	113,798,081.18	189,485,726.00
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	52,466,949.37	11,377,648.93	63,844,598.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,870,576.12	11,870,576.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	25,711,013.56	20,693,669.38	46,404,682.94
其中：1. 基金申购款	80,959,605.23	45,104,048.89	126,063,654.12
2. 基金赎回款	-55,248,591.67	-24,410,379.51	-79,658,971.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	78,177,962.93	43,941,894.43	122,119,857.36

注：本基金于 2011 年 9 月 28 日成立。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王炯</u>	<u>吕晖</u>	<u>沈静</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴新产业精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1021 号《关于同意东吴新产业精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于 2011 年 9 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 281,594,106.37 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为东吴基金管理有限公司，基金

托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，东吴基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 7 日起，将“东吴新产业精选股票型证券投资基金”更名为“东吴新产业精选混合型证券投资基金”，基金类别“股票型基金”变更为“混合型基金”。

本基金为混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于股票资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准= 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如报表日有成交价，应当以当日收盘价作为公允价值。活跃市场中的报价是指易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格。如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应当以最近交易日收盘价作为公允价值；如报表日无成交价、且最近交易日后

经济环境发生了重大变化的，应当在谨慎原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定公允价值。

(2) 金融工具不存在活跃市场的，本公司采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考计量日市场参与者在主要市场或最有利市场中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具当前的公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
- (3) 本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；
- (4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- (5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
- (7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (a) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的

同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知，本基金自 2015 年 3 月 24 日起，对交易所市场上上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券品种以外的固定收益品种估值时，由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。本基金对该会计估计变更采用未来适用法，经测算新估值标准实施日的相关调整对前一估值日基金资产净值的影响未超过 0.5%。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置

试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份 有限公司	1,776,436,820.54	61.06%	749,521,803.02	65.61%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东吴证券股份 有限公司	24,523,560.54	23.95%	-	-

本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东吴证券股份 有限公司	41,299,000.00	40.89%	60,000,000.00	95.24%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东吴证券股份 有限公司	1,597,149.97	60.91%	590,687.07	80.99%

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份 有限公司	667,054.25	65.32%	184,582.25	49.25%

注：1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

2、股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金比率是公允，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	2,476,948.74	986,500.86
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,012,237.26	394,498.61

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	412,824.86	164,416.79

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金管理人本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	12,170,914.74	125,563.05	9,138,485.49	60,467.21

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2015 年 12 月 21 日	重大资产重组	24.43	-	-	527,080	8,829,569.13	12,876,564.40	-

300242	明家科技	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	49.96	2016 年 1 月 22 日	44.96	113,109	4,428,892.69	5,650,925.64	-
300336	新文化	2015 年 12 月 24 日	重大资产重组	42.00	-	-	93,500	3,924,213.00	3,927,000.00	-
002235	安妮股份	2015 年 7 月 2 日	重大资产重组	24.60	2016 年 1 月 12 日	32.00	38,309	933,013.71	942,401.40	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	178,720,506.68	90.55
	其中：股票	178,720,506.68	90.55
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	13,728,779.40	6.96
7	其他各项资产	4,930,115.81	2.50
8	合计	197,379,401.89	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	87,056,877.27	45.94
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	17,296,180.68	9.13
G	交通运输、仓储和邮政业	969,789.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,600,891.48	14.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,776,692.27	10.44
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	3,043,455.00	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,004,281.88	1.06
R	文化、体育和娱乐业	21,972,339.10	11.60
S	综合	-	-
	合计	178,720,506.68	94.32

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300299	富春通信	366,364	17,244,753.48	9.10
2	002329	皇氏集团	585,558	16,337,068.20	8.62
3	603601	再升科技	393,112	15,999,658.40	8.44
4	000002	万科A	527,080	12,876,564.40	6.80
5	600892	宝诚股份	126,101	11,001,051.24	5.81
6	600556	慧球科技	352,791	9,550,052.37	5.04
7	300031	宝通科技	264,813	8,315,128.20	4.39

8	300073	当升科技	186,780	7,252,667.40	3.83
9	603108	润达医疗	61,368	6,295,129.44	3.32
10	002739	万达院线	47,800	5,736,000.00	3.03

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 www.scfund.com.cn 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300244	迪安诊断	53,287,126.56	43.64
2	600446	金证股份	35,766,439.08	29.29
3	300347	泰格医药	34,192,048.98	28.00
4	002217	合力泰	29,883,989.80	24.47
5	600571	信雅达	28,477,721.00	23.32
6	002488	金固股份	27,224,852.73	22.29
7	300299	富春通信	24,363,712.24	19.95
8	002407	多氟多	21,944,502.52	17.97
9	600118	中国卫星	21,351,471.15	17.48
10	300041	回天新材	20,633,581.80	16.90
11	002115	三维通信	20,457,119.38	16.75
12	300059	东方财富	17,898,568.38	14.66
13	300178	腾邦国际	17,419,369.76	14.26
14	300027	华谊兄弟	17,281,741.00	14.15
15	002329	皇氏集团	16,632,768.33	13.62
16	002739	万达院线	16,590,771.72	13.59
17	300339	润和软件	16,296,852.74	13.34
18	603601	再升科技	16,159,541.64	13.23
19	000592	平潭发展	15,650,179.00	12.82
20	000524	岭南控股	15,627,645.07	12.80
21	300088	长信科技	15,540,547.00	12.73
22	002108	沧州明珠	15,283,022.76	12.51
23	300183	东软载波	14,981,759.14	12.27
24	600663	陆家嘴	14,663,208.05	12.01
25	000712	锦龙股份	14,396,337.38	11.79

26	601799	星宇股份	13,963,583.20	11.43
27	300168	万达信息	13,530,131.45	11.08
28	600388	龙净环保	13,398,299.81	10.97
29	000768	中航飞机	13,021,414.00	10.66
30	300273	和佳股份	12,978,245.90	10.63
31	300073	当升科技	12,940,125.25	10.60
32	002284	亚太股份	12,895,634.00	10.56
33	300031	宝通科技	12,764,723.00	10.45
34	000002	万 科A	12,452,507.36	10.20
35	300458	全志科技	12,389,453.92	10.15
36	300133	华策影视	12,274,710.94	10.05
37	300113	顺网科技	11,958,167.00	9.79
38	600893	中航动力	11,439,219.64	9.37
39	002462	嘉事堂	11,140,307.54	9.12
40	002364	中恒电气	10,863,595.22	8.90
41	601628	中国人寿	10,691,617.08	8.76
42	300251	光线传媒	10,674,494.49	8.74
43	002354	天神娱乐	10,537,072.20	8.63
44	000558	莱茵体育	10,426,573.05	8.54
45	300104	乐视网	10,360,274.80	8.48
46	002223	鱼跃医疗	10,328,687.28	8.46
47	002007	华兰生物	10,283,499.72	8.42
48	002030	达安基因	10,172,665.59	8.33
49	002004	华邦健康	10,121,181.00	8.29
50	002456	欧菲光	10,084,911.00	8.26
51	000547	航天发展	9,811,533.58	8.03
52	002589	瑞康医药	9,810,353.42	8.03
53	002649	博彦科技	9,808,858.71	8.03
54	600892	宝诚股份	9,745,649.15	7.98
55	300486	东杰智能	9,420,972.92	7.71
56	002460	赣锋锂业	9,274,919.20	7.59
57	600594	益佰制药	9,242,081.29	7.57
58	600038	中直股份	8,974,052.85	7.35
59	600556	慧球科技	8,821,813.80	7.22
60	000732	泰禾集团	8,746,610.97	7.16
61	300115	长盈精密	8,744,411.17	7.16

62	600340	华夏幸福	8,563,058.12	7.01
63	601377	兴业证券	8,395,069.98	6.87
64	002395	双象股份	8,296,884.93	6.79
65	300043	互动娱乐	8,107,155.46	6.64
66	002235	安妮股份	8,071,497.70	6.61
67	300075	数字政通	7,986,637.00	6.54
68	300033	同花顺	7,793,449.67	6.38
69	300326	凯利泰	7,685,499.00	6.29
70	600079	人福医药	7,603,029.00	6.23
71	300364	中文在线	7,437,851.51	6.09
72	600588	用友网络	7,303,184.00	5.98
73	300367	东方网力	7,110,154.31	5.82
74	000559	万向钱潮	7,004,413.00	5.74
75	002348	高乐股份	6,997,619.82	5.73
76	603108	润达医疗	6,971,071.00	5.71
77	300327	中颖电子	6,954,249.76	5.69
78	300203	聚光科技	6,653,930.35	5.45
79	300248	新开普	6,548,734.79	5.36
80	000166	申万宏源	6,387,995.00	5.23
81	002318	久立特材	6,238,336.12	5.11
82	002405	四维图新	6,099,588.42	4.99
83	601021	春秋航空	6,001,818.19	4.91
84	300144	宋城演艺	5,966,580.12	4.89
85	002363	隆基机械	5,947,376.00	4.87
86	600565	迪马股份	5,929,313.00	4.86
87	600270	外运发展	5,816,891.95	4.76
88	601998	中信银行	5,686,695.27	4.66
89	600343	航天动力	5,680,139.88	4.65
90	600645	中源协和	5,627,398.32	4.61
91	600033	福建高速	5,595,713.20	4.58
92	002285	世联行	5,583,381.00	4.57
93	300146	汤臣倍健	5,517,941.00	4.52
94	600416	湘电股份	5,495,505.00	4.50
95	000802	北京文化	5,492,938.41	4.50
96	600519	贵州茅台	5,321,130.73	4.36
97	300054	鼎龙股份	5,270,777.58	4.32

98	002104	恒宝股份	5,121,109.52	4.19
99	002669	康达新材	5,053,268.00	4.14
100	601888	中国国旅	5,032,956.00	4.12
101	002343	禾欣股份	5,007,250.50	4.10
102	002584	西陇科学	4,899,496.60	4.01
103	600175	美都能源	4,859,048.94	3.98
104	000738	中航动控	4,759,890.81	3.90
105	002542	中化岩土	4,608,804.00	3.77
106	300242	明家科技	4,428,892.69	3.63
107	300058	蓝色光标	4,222,768.98	3.46
108	603368	柳州医药	4,143,796.90	3.39
109	000601	韶能股份	3,967,471.00	3.25
110	002124	天邦股份	3,950,067.00	3.23
111	000566	海南海药	3,929,998.00	3.22
112	300336	新文化	3,924,213.00	3.21
113	000538	云南白药	3,908,007.00	3.20
114	000062	深圳华强	3,855,889.00	3.16
115	600745	中茵股份	3,837,786.23	3.14
116	600585	海螺水泥	3,806,283.38	3.12
117	300190	维尔利	3,776,298.10	3.09
118	300172	中电环保	3,672,721.12	3.01
119	000024	招商地产	3,592,073.24	2.94
120	002152	广电运通	3,554,836.00	2.91
121	601599	鹿港科技	3,553,757.00	2.91
122	600017	日照港	3,478,826.00	2.85
123	600885	宏发股份	3,411,210.00	2.79
124	002131	利欧股份	3,334,327.35	2.73
125	600016	民生银行	3,333,214.00	2.73
126	300356	光一科技	3,322,565.40	2.72
127	300182	捷成股份	3,312,481.31	2.71
128	300325	德威新材	3,299,287.90	2.70
129	300369	绿盟科技	3,290,810.20	2.69
130	300003	乐普医疗	3,282,363.00	2.69
131	600005	武钢股份	3,262,953.60	2.67
132	300359	全通教育	3,252,037.00	2.66
133	600410	华胜天成	3,184,986.09	2.61

134	000671	阳光城	3,030,241.20	2.48
135	601688	华泰证券	2,980,882.00	2.44
136	002179	中航光电	2,941,148.00	2.41
137	000888	峨眉山A	2,907,875.00	2.38
138	600030	中信证券	2,905,063.00	2.38
139	002475	立讯精密	2,850,053.38	2.33
140	002153	石基信息	2,800,778.10	2.29
141	001979	招商蛇口	2,778,319.50	2.28
142	300199	翰宇药业	2,708,100.00	2.22
143	300380	安硕信息	2,695,768.21	2.21
144	600737	中粮屯河	2,578,616.00	2.11
145	300038	梅泰诺	2,559,455.05	2.10
146	601633	长城汽车	2,543,612.00	2.08
147	300078	思创医惠	2,521,130.00	2.06
148	002454	松芝股份	2,478,421.20	2.03
149	600115	东方航空	2,472,112.00	2.02
150	002433	太安堂	2,448,395.01	2.00

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300244	迪安诊断	54,000,176.19	44.22
2	600446	金证股份	39,327,208.25	32.20
3	300347	泰格医药	32,564,492.03	26.67
4	002115	三维通信	30,229,030.25	24.75
5	002217	合力泰	26,100,513.95	21.37
6	600571	信雅达	24,930,260.44	20.41
7	300178	腾邦国际	22,128,385.24	18.12
8	002407	多氟多	21,319,210.76	17.46
9	300088	长信科技	21,035,518.27	17.23
10	002488	金固股份	20,880,308.42	17.10
11	300183	东软载波	20,602,230.53	16.87
12	300339	润和软件	19,493,193.99	15.96
13	300059	东方财富	18,642,629.28	15.27

14	300172	中电环保	18,571,427.21	15.21
15	600118	中国卫星	18,106,093.76	14.83
16	300027	华谊兄弟	17,876,745.87	14.64
17	002364	中恒电气	16,535,937.74	13.54
18	300299	富春通信	15,480,193.92	12.68
19	002649	博彦科技	15,257,153.45	12.49
20	000524	岭南控股	15,232,018.87	12.47
21	002108	沧州明珠	15,145,676.16	12.40
22	000712	锦龙股份	15,116,437.84	12.38
23	600388	龙净环保	15,084,940.32	12.35
24	300041	回天新材	13,494,601.44	11.05
25	000732	泰禾集团	13,467,353.61	11.03
26	002589	瑞康医药	12,931,396.83	10.59
27	300133	华策影视	12,827,005.76	10.50
28	000768	中航飞机	12,246,775.00	10.03
29	002462	嘉事堂	12,031,721.10	9.85
30	300273	和佳股份	11,982,489.14	9.81
31	002739	万达院线	11,876,133.12	9.72
32	300168	万达信息	11,538,262.04	9.45
33	600893	中航动力	11,290,223.46	9.25
34	002030	达安基因	11,208,918.38	9.18
35	000592	平潭发展	11,202,177.70	9.17
36	002004	华邦健康	10,702,738.04	8.76
37	002354	天神娱乐	10,686,265.07	8.75
38	300327	中颖电子	10,511,781.03	8.61
39	300251	光线传媒	10,469,434.81	8.57
40	002007	华兰生物	10,432,312.68	8.54
41	300075	数字政通	10,429,736.17	8.54
42	002456	欧菲光	10,325,060.00	8.45
43	601628	中国人寿	10,031,282.00	8.21
44	600594	益佰制药	9,981,819.00	8.17
45	002395	双象股份	9,978,814.78	8.17
46	300458	全志科技	9,833,053.69	8.05
47	300303	聚飞光电	9,770,504.12	8.00
48	002284	亚太股份	9,762,077.48	7.99
49	000547	航天发展	9,619,268.84	7.88
50	300104	乐视网	9,528,898.80	7.80
51	002223	鱼跃医疗	9,431,513.43	7.72

52	600663	陆家嘴	9,410,120.00	7.71
53	002460	赣锋锂业	9,302,814.70	7.62
54	601799	星宇股份	9,057,348.77	7.42
55	002235	安妮股份	9,002,931.69	7.37
56	300115	长盈精密	8,939,862.00	7.32
57	601377	兴业证券	8,814,566.85	7.22
58	000558	莱茵体育	8,743,037.07	7.16
59	600340	华夏幸福	8,584,746.35	7.03
60	300248	新开普	8,515,061.31	6.97
61	300073	当升科技	8,152,724.61	6.68
62	300033	同花顺	7,979,948.57	6.53
63	601166	兴业银行	7,828,012.00	6.41
64	600038	中直股份	7,755,751.80	6.35
65	300203	聚光科技	7,656,462.23	6.27
66	300043	互动娱乐	7,628,978.00	6.25
67	002348	高乐股份	7,227,522.68	5.92
68	300486	东杰智能	7,223,485.15	5.92
69	600079	人福医药	7,210,751.52	5.90
70	600565	迪马股份	7,143,662.60	5.85
71	000559	万向钱潮	7,034,372.00	5.76
72	600016	民生银行	6,647,762.00	5.44
73	000166	申万宏源	6,568,571.81	5.38
74	002309	中利科技	6,565,219.96	5.38
75	300113	顺网科技	6,550,358.00	5.36
76	002329	皇氏集团	6,415,371.96	5.25
77	300144	宋城演艺	6,383,973.48	5.23
78	600588	用友网络	6,337,442.90	5.19
79	002363	隆基机械	6,047,469.70	4.95
80	600343	航天动力	5,928,153.00	4.85
81	300146	汤臣倍健	5,909,072.00	4.84
82	601021	春秋航空	5,860,682.75	4.80
83	300253	卫宁软件	5,850,405.86	4.79
84	300054	鼎龙股份	5,843,716.53	4.79
85	300031	宝通科技	5,823,198.96	4.77
86	300326	凯利泰	5,649,893.00	4.63
87	300159	新研股份	5,577,889.60	4.57
88	600270	外运发展	5,558,257.08	4.55
89	002669	康达新材	5,552,891.82	4.55

90	002318	久立特材	5,299,930.82	4.34
91	002584	西陇科学	5,276,191.63	4.32
92	300265	通光线缆	5,234,110.49	4.29
93	601998	中信银行	5,226,155.56	4.28
94	600030	中信证券	5,159,461.24	4.22
95	002285	世联行	5,130,799.82	4.20
96	600048	保利地产	5,003,184.14	4.10
97	600519	贵州茅台	5,000,895.00	4.10
98	002405	四维图新	4,995,424.19	4.09
99	000024	招商地产	4,856,006.10	3.98
100	600645	中源协和	4,782,560.07	3.92
101	002542	中化岩土	4,688,758.72	3.84
102	600175	美都能源	4,633,161.00	3.79
103	000738	中航动控	4,606,111.49	3.77
104	000783	长江证券	4,596,980.64	3.76
105	300367	东方网力	4,384,368.30	3.59
106	603368	柳州医药	4,354,764.43	3.57
107	002124	天邦股份	4,319,524.00	3.54
108	601888	中国国旅	4,051,724.59	3.32
109	300058	蓝色光标	4,012,131.80	3.29
110	002153	石基信息	3,915,748.00	3.21
111	600284	浦东建设	3,887,093.12	3.18
112	000566	海南海药	3,876,530.99	3.17
113	000538	云南白药	3,860,543.04	3.16
114	600033	福建高速	3,767,848.50	3.09
115	300190	维尔利	3,710,402.00	3.04
116	600885	宏发股份	3,708,370.85	3.04
117	600900	长江电力	3,651,797.98	2.99
118	000002	万科A	3,622,077.00	2.97
119	600416	湘电股份	3,594,275.00	2.94
120	600585	海螺水泥	3,584,714.56	2.94
121	600089	特变电工	3,524,778.76	2.89
122	600150	中国船舶	3,515,370.44	2.88
123	000601	韶能股份	3,432,113.82	2.81
124	300182	捷成股份	3,413,179.66	2.79
125	002131	利欧股份	3,404,882.00	2.79
126	300070	碧水源	3,383,866.64	2.77
127	300369	绿盟科技	3,367,700.50	2.76

128	300003	乐普医疗	3,342,199.95	2.74
129	300325	德威新材	3,271,844.67	2.68
130	002185	华天科技	3,269,137.00	2.68
131	600410	华胜天成	3,198,671.00	2.62
132	600005	武钢股份	3,179,888.92	2.60
133	002152	广电运通	3,164,549.00	2.59
134	002104	恒宝股份	3,140,290.82	2.57
135	300230	永利股份	3,122,964.10	2.56
136	601688	华泰证券	3,012,878.00	2.47
137	002179	中航光电	2,970,509.00	2.43
138	002433	太安堂	2,920,775.60	2.39
139	002221	东华能源	2,910,032.80	2.38
140	002475	立讯精密	2,879,730.00	2.36
141	600115	东方航空	2,861,100.00	2.34
142	603601	再升科技	2,840,435.27	2.33
143	000062	深圳华强	2,806,068.00	2.30
144	300380	安硕信息	2,678,618.90	2.19
145	600730	中国高科	2,670,147.00	2.19
146	600017	日照港	2,647,562.00	2.17
147	000671	阳光城	2,642,764.82	2.16
148	600998	九州通	2,553,993.00	2.09
149	300356	光一科技	2,543,382.00	2.08
150	600804	鹏博士	2,480,855.36	2.03

注：本项的“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,471,623,678.53
卖出股票收入（成交）总额	1,443,216,603.19

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	262,800.64
2	应收证券清算款	4,499,281.44

3	应收股利	-
4	应收利息	4,164.95
5	应收申购款	163,868.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,930,115.81

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万 科 A	12,876,564.40	6.80	重大资产重组

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,333	10,321.51	0.00	0.00%	75,687,644.82	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	29,265.35	0.0387%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2011 年 9 月 28 日 ）基金份额总额	281,594,106.37
本报告期期初基金份额总额	78,177,962.93
本报告期基金总申购份额	331,381,232.28
减:本报告期基金总赎回份额	333,871,550.39
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	75,687,644.82

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。

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 6 月 23 日东吴基金管理有限公司召开 2015 年第一次临时股东会，会议经过审议，全体股东一致通过如下决议：

（1）同意金燕萍女士辞去第二届董事会董事、副董事长职务；同意戴继雄先生辞去公司第二届董事会董事职务；

（2）同意张平先生辞去公司第二届董事会独立董事、第二届董事会风险控股委员会委员职务；

（3）选举陈辉峰先生、全卓伟女士担任公司第二届董事会董事，任期与公司第二届董事会

一致；

(4) 选举袁勇志先生担任第二届董事会独立董事，任期与公司第二届董事会一致。

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2012 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 60000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(1) 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，中国证监会以及上海证监局对公司原基金经理魏立波涉嫌违规从事股票交易进行了调查，上海证监局于 2015 年 1 月 23 日对公司作出了采取责令整改措施的决定。公司对此高度重视，及时制定整改计划和整改方案，认真进行改进，逐一落实各项整改要求。

2015 年 7 月，中国证监会以及上海证监局对公司进行内部控制现场检查后，作出了责令改正措施的决定。公司对此高度重视，及时制定整改计划和整改方案，认真进行内控整改，逐一落实各项整改要求。截止本报告期末，公司已按照监管机关的要求完成了整改工作。

(2) 本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

东吴证券	2	1,776,436,820.54	61.06%	1,597,149.97	60.91%	-
兴业证券	1	470,796,235.41	16.18%	433,578.36	16.53%	-
中银国际	1	439,700,685.45	15.11%	389,091.13	14.84%	-
国信证券	1	216,377,832.52	7.44%	196,990.15	7.51%	-
平安证券	1	5,972,068.80	0.21%	5,437.08	0.21%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 2 个交易单元为恒泰证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	24,523,560.54	23.95%	41,299,000.00	40.89%	-	-
兴业证券	61,592,897.90	60.16%	14,700,000.00	14.55%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	16,269,378.20	15.89%	45,000,000.00	44.55%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

东吴基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日