

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

2013 第三季度报告

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:二〇一三年十月二十三日

重要提示
基金管理人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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或未来收益。

基金的投资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。
本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金主代码, 交易代码, etc. 东吴进取策略混合 580005 580005

本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,以成长作为投资方向,并对不同成长类型股票采取不同操作策略,追求超额收益。

本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场趋势的综合分析,对基金资产在股票、债券、现金和衍生工具之间的投资比例进行灵活配置。

本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其风险和预期收益要低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于风险较高,预期收益也较高的基金品种。

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元
1.本期已实现收益 20,852,419.42
2.本期利润 100,551,356.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.1656
4.期末基金资产净值 666,809,638.18
5.期末基金份额净值 1.1374

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.本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

Table with 5 columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④

注:1.东吴进取策略混合于2009年5月6日成立。
2.比较基准=65%\*沪深300指数+35%\*中信标普全债指数。

4.1 基金经理 魏斌基金经理小组 简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理起止日期, 证券从业年限

注:1.此处的任职日期和离任日期指公司对对外公告之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

注:1.如果本报告期间发生转入及红利再投资,则总申购份额中包含该业务;
2.如果本报告期间发生转出及赎回,则总赎回份额中包含该业务。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.4 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

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十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(元), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

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五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.7.1 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。

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有期权。

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.11 报告期末持有的资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.12 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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(元), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.15 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。

5.16 投资组合报告附注的其他重要事项

5.16.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.17 基金投资的前十名股票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。

5.18 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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(元), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.19 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.20 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.20.1 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。

5.21 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.21.1 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。

5.22 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.22.1 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有期权。

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

5.24 报告期末持有的资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)

2013 第三季度报告

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:二〇一三年十月二十三日

重要提示
基金管理人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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或未来收益。

基金的投资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。
本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金主代码, 交易代码, etc. 东吴深证100指数增强LOF 105806 105806

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,通过量化模型对标的指数的成分股进行积极投资,追求超越标的指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场趋势的综合分析,对基金资产在股票、债券、现金和衍生工具之间的投资比例进行灵活配置。

本基金是一只进行主动投资的股票型基金,其风险和预期收益要高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于风险较高,预期收益也较高的基金品种。

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元
1.本期已实现收益 -5,987,903.04
2.本期利润 9,857,195.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0228
4.期末基金资产净值 90,884,109.53
5.期末基金份额净值 0.904

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.本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

Table with 5 columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

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:1.本基金业绩比较基准=95%\*深证100价格指数收益率+5%\*商业银行活期存款利率(税后)。
2.本基金于2012年3月9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,建仓期结束时本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 魏斌基金经理小组 简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理起止日期, 证券从业年限

注:1.此处的任职日期和离任日期指公司对对外公告之日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

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,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内本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
三季度,在库存存量的推动下,经济数据出现超预期上升,无论是上游原材料或下游消费品,地产,都出现超预期增长,整体经济好于市场预期。由于深证100指数权重股中,金融和地产等权重股表现较好,带动深证100指数表现较好,超越沪深300。报告期内,本基金主要采用自下而上选股策略,在行业内部精选个股,严格控制仓位,在日常的操作中积极应对市场波动,并在个股选择上进行了适度超配,力争获得超额收益。

截至本报告期末,本基金资产净值90,904元,累计净值904元;本报告期份额净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为9.18%。

4.4.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

4.4.2.1 报告期内基金业绩比较基准执行情况
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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 公平交易专项说明

4.4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

4.4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,在库存存量的推动下,经济数据出现超预期上升,无论是上游原材料或下游消费品,地产,都出现超预期增长,整体经济好于市场预期。由于深证100指数权重股中,金融和地产等权重股表现较好,带动深证100指数表现较好,超越沪深300。报告期内,本基金主要采用自下而上选股策略,在行业内部精选个股,严格控制仓位,在日常的操作中积极应对市场波动,并在个股选择上进行了适度超配,力争获得超额收益。

截至本报告期末,本基金资产净值90,904元,累计净值904元;本报告期份额净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为9.18%。

4.4.4.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

4.4.4.2.1 报告期内基金业绩比较基准执行情况
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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

4.4.4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,在库存存量的推动下,经济数据出现超预期上升,无论是上游原材料或下游消费品,地产,都出现超预期增长,整体经济好于市场预期。由于深证100指数权重股中,金融和地产等权重股表现较好,带动深证100指数表现较好,超越沪深300。报告期内,本基金主要采用自下而上选股策略,在行业内部精选个股,严格控制仓位,在日常的操作中积极应对市场波动,并在个股选择上进行了适度超配,力争获得超额收益。

截至本报告期末,本基金资产净值90,904元,累计净值904元;本报告期份额净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为9.18%。

4.4.4.4.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

4.4.4.4.2.1 报告期内基金业绩比较基准执行情况
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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4.4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

4.4.4.4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.4.4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.4.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,在库存存量的推动下,经济数据出现超预期上升,无论是上游原材料或下游消费品,地产,都出现超预期增长,整体经济好于市场预期。由于深证100指数权重股中,金融和地产等权重股表现较好,带动深证100指数表现较好,超越沪深300。报告期内,本基金主要采用自下而上选股策略,在行业内部精选个股,严格控制仓位,在日常的操作中积极应对市场波动,并在个股选择上进行了适度超配,力争获得超额收益。

截至本报告期末,本基金资产净值90,904元,累计净值904元;本报告期份额净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为9.18%。

4.4.4.4.4.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

4.4.4.4.4.2.1 报告期内基金业绩比较基准执行情况
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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4.4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4.4.4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

4.4.4.4.4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.4.4.4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.4.4.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,在库存存量的推动下,经济数据出现超预期上升,无论是上游原材料或下游消费品,地产,都出现超预期增长,整体经济好于市场预期。由于深证100指数权重股中,金融和地产等权重股表现较好,带动深证100指数表现较好,超越沪深300。报告期内,本基金主要采用自下而上选股策略,在行业内部精选个股,严格控制仓位,在日常的操作中积极应对市场波动,并在个股选择上进行了适度超配,力争获得超额收益。

截至本报告期末,本基金资产净值90,904元,累计净值904元;本报告期份额净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为9.18%。

4.4.4.4.4.4.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

4.4.4.4.4.4.2.1 报告期内基金业绩比较基准执行情况
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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4.4.4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4.4.4.4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

4.4.4.4.4.4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.4.4.4.4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.4.4.4.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,在库存存量的推动下,经济数据出现超预期上升,无论是上游原材料或下游消费品,地产,都出现超预期增长,整体经济好于市场预期。由于深证100指数权重股中,金融和地产等权重股表现较好,带动深证100指数表现较好,超越沪深300。报告期内,本基金主要采用自下而上选股策略,在行业内部精选个股,严格控制仓位,在日常的操作中积极应对市场波动,并在个股选择上进行了适度超配,力争获得超额收益。

截至本报告期末,本基金资产净值90,904元,累计净值904元;本报告期份额净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为9.18%。

4.4.4.4.4.4.4.2 报告期内基金业绩比较基准执行情况

4.4.4.4.4.4.4.2.1 报告期内基金业绩比较基准执行情况
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约定及其他有关法律法规,恪守诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业判断,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.4.4.4.4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4.4.4.4.4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格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,加强对所有投资组合的公平交易行为的监控,确保各投资组合的公平交易。

本报告期内,本基金管理人未发现异常交易行为。

东吴新兴产业精选股票型证券投资基金

2013 第三季度报告

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:二〇一三年十月二十三日

重要提示
基金管理人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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或未来收益。

基金的投资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。
本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金主代码, 交易代码, etc. 东吴新兴产业精选股票 580008 580008

本基金为股票型基金,主要投资于新兴产业上市公司,分享新兴产业所带来的投资机会,追求超越市场的收益。

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、政策和证券市场趋势的综合分析,对基金资产在股票、债券、现金和衍生工具之间的投资比例进行灵活配置。

本基金是一只进行主动投资的股票型基金,其风险和预期收益要高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于风险较高,预期收益也较高的基金品种。

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元
1.本期已实现收益 4,280,453.70
2.本期利润 8,931,983.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.1665
4.期末基金资产净值 65,502,842.30
5.期末基金份额净值 1.213

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.本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

Table with 5 columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④

注:1.此处在行业归属上采用中国证监会对上市公司对外公告之行业分类标准。

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:1.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。
2.本基金于2011年10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,建仓期结束时本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