

东吴保本混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

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:二〇一四年七月十八日

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法律责任。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应先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2014年4月1日起至6月30日止。

基金名称:东吴保本混合
基金代码:582003
基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日期:2012年8月13日
报告期末基金份额总额:288,966,628.09份

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

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)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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、处罚的情况

5.13 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 投资组合报告附注

5.17 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、处罚的情况

5.18 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.21 投资组合报告附注

5.22 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、处罚的情况

5.23 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

东吴鼎利分级债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十八日

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法律责任。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应先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2014年4月1日起至6月30日止。

基金名称:东吴鼎利分级债券
基金代码:168807
基金运作方式:契约式

基金合同生效日期:2013年6月6日
报告期末基金份额总额:748,669,378.87份

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

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)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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、处罚的情况

5.13 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 投资组合报告附注

5.17 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、处罚的情况

5.18 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.21 投资组合报告附注

5.22 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、处罚的情况

5.23 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

注:1.本基金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。

注: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 本基金报告期内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, 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

注:1.比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)

注:2.本基金于2012年10月13日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

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.比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)

注:2.本基金于2013年4月25日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

3.3 其他指标

Table with 2 columns: 基金名称, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

注:1.比较基准=1年期国债利率综合年化指数

注:2.本基金于2013年4月25日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

4.1 基金管理人(或基金经理)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理任期, 证券从业年限, 说明

注:1.丁蔚为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日;

注: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。

注:3.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:4.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:5.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:6.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:7.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:8.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:9.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:10.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:11.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:12.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:13.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:14.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

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:二〇一四年七月十八日

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法律责任。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应先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2014年4月1日起至6月30日止。

基金名称:东吴阿尔法灵活配置混合
基金代码:582005
基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日期:2014年3月19日
报告期末基金份额总额:402,438,032.23份

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

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
基金销售人:中国银行股份有限公司

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+中国债券综合指数收益率*35%

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

注:1.本基金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。

注: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 本基金报告期内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, 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

注:1.比较基准=中国债券综合年化指数

注:2.本基金于2013年4月25日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

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.比较基准=1年期国债利率综合年化指数

注:2.本基金于2013年4月25日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

4.1 基金管理人(或基金经理)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理任期, 证券从业年限, 说明

注:1.丁蔚为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日;

注: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。

注:3.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:4.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:5.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:6.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:7.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:8.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:9.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:10.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:11.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:12.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:13.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:14.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:15.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:16.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:17.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:18.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

注:19.基金经理对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

注:1.本基金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。

注: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 本基金报告期内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, 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

注:1.比较基准=中国债券综合年化指数

注:2.本基金于2013年4月25日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

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.比较基准=1年期国债利率综合年化指数

注:2.本基金于2013年4月25日成立,按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起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相关规定。

4.1 基金管理人(或基金经理)简介

Table with 5 columns: 姓名