

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

2015 半年度报告摘要

注: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。

1. 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	—	—
5	企业债券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	15,860,226.60	3.61
8	其他	—	—
9	合计	15,860,226.60	3.61

1.3 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

序号	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113007 吉视转债	33,620	4,165,181.80	3.57
2	128006 歌尔转债	25,210	4,002,843.80	3.44
3	113008 电气转债	21,670	3,923,136.80	3.37
4	113001 瀚润转债	27,030	3,769,063.20	3.23

1.4 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。

1.5 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

1.6 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

本基金本报告期末未持有权证。

1.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.7.1 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。

1.7.2 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。

1.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.8.1 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。

1.8.2 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。

1.8.3 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。

1.9 投资组合报告附注

1.9.1 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。

1.9.2 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。

1.9.3 期末其他资产项目构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	348,369.57
2	应收证券清算款	3,918,218.42
3	应收股利	—
4	应收利息	27,400.66
5	应收申购款	121,470.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,415,528.75

1.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113007	吉视转债	4,165,181.80	3.57
2	128006	歌尔转债	4,002,843.80	3.44
3	113001	瀚润转债	3,769,063.20	3.23

1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300008	上海医药	9,300,161.20	8.03	重大事项停牌
2	300023	瀚叶科技	8,308,064.19	7.13	重大事项停牌

1.9.6 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

由于舍内人员的疏忽,分项之和与合项之和可能存在尾差。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户内持有的基金份额	机构投资者持有份额	个人投资者持有份额
1	—	—	—
2	—	—	—
3	—	—	—
4	—	—	—
5	—	—	—
6	—	—	—
7	—	—	—
8	—	—	—
9	—	—	—
10	—	—	—
11	—	—	—
12	—	—	—
13	—	—	—
14	—	—	—
15	—	—	—
16	—	—	—
17	—	—	—
18	—	—	—
19	—	—	—
20	—	—	—
21	—	—	—
22	—	—	—
23	—	—	—
24	—	—	—
25	—	—	—
26	—	—	—
27	—	—	—
28	—	—	—
29	—	—	—
30	—	—	—
31	—	—	—
32	—	—	—
33	—	—	—
34	—	—	—
35	—	—	—
36	—	—	—
37	—	—	—
38	—	—	—
39	—	—	—
40	—	—	—
41	—	—	—
42	—	—	—
43	—	—	—
44	—	—	—
45	—	—	—
46	—	—	—
47	—	—	—
48	—	—	—
49	—	—	—
50	—	—	—
51	—	—	—
52	—	—	—
53	—	—	—
54	—	—	—
55	—	—	—
56	—	—	—
57	—	—	—
58	—	—	—
59	—	—	—
60	—	—	—
61	—	—	—
62	—	—	—
63	—	—	—
64	—	—	—
65	—	—	—
66	—	—	—
67	—	—	—
68	—	—	—
69	—	—	—
70	—	—	—
71	—	—	—
72	—	—	—
73	—	—	—
74	—	—	—
75	—	—	—
76	—	—	—
77	—	—	—
78	—	—	—
79	—	—	—
80	—	—	—
81	—	—	—
82	—	—	—
83	—	—	—
84	—	—	—
85	—	—	—
86	—	—	—
87	—	—	—
88	—	—	—
89	—	—	—
90	—	—	—
91	—	—	—
92	—	—	—
93	—	—	—
94	—	—	—
95	—	—	—
96	—	—	—
97	—	—	—
98	—	—	—
99	—	—	—
100	—	—	—

8.2 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.3 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.4 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.5 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.6 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.7 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.8 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.9 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.10 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.11 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.12 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.13 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.14 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.15 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.16 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.17 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.18 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.19 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.20 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.21 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.22 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.23 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.24 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.25 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.26 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.27 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.28 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.29 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.30 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.31 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.32 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.33 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.34 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.35 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.36 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额比例
东吴基金管理有限公司	5,134.22	0.0009%

8.37 期末基金管理人及基金托管人持有本基金基金份额的情况

基金管理人	基金管理人持有基金份额(份)	基金管理人持有基金份额占基金总份额
-------	----------------	-------------------