

东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 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:二〇一五年十月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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、完整性和及时性承担法律责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年10月21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信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告附录财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:东吴阿尔法灵活配置混合

场内简称:东吴阿尔法

基金代码:000531

交易代码:000531

基金份额代码:

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014年3月19日

基金份额净值:0.907,125.809

投资目标:本基金为混合型基金，坚持以大类资产轮动为主，金融衍生品对冲投资为辅的策略，在有效控制风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的资本增值。

投资策略:本基金将充分考虑宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供求及具体行业发展趋势、股票市场估值水平等方面的情况深入研究、分析股票投资品种，通过公司数量模型定期调整股票比例并动态地优化配置。

业绩比较基准:沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

风险收益特征:本基金是一只主动管理的债券配置混合基金，其预期风险和预期收益介于股票型基金和债券型基金之间，属于中等风险收益的产品。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -75,899,600.22

2.本期利润 -30,746,112.63

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0379

4.期末基金份额净值 0.9116,097.49

5.期末基金份额总额 1,065

注:1.本期已实现收益为本基金本期收入、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申购基金所产生的费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

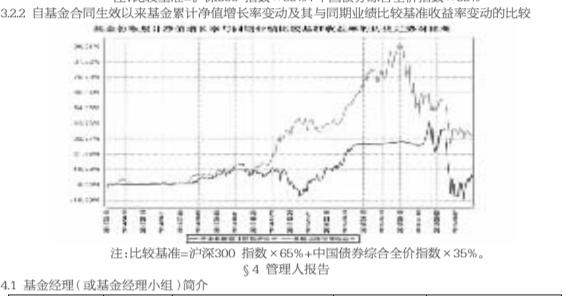
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

主要财务指标 净值增长率为① 增幅偏离率为② 基准收益率为③ 准收益率为④

①-③ ②-④

注:比较基准=沪深300 指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.2 自基金成立以来本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:本基金成立以来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

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(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

王立立 基金经理、基金经理 总经理 2014年6月14日 - 5年

注:1.此处的任职日期为公司对外公告之日;
2.证券从业人员的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的规定;

3.报告期内，本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4.报告期内本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

5.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

6.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

7.基金管理人持有的前十名股票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的情形。

8.基金管理人持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股股票库。

9.1 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 244,018.79

2 受托管理费 -

3 受托存款 -

4 收取利息 2,020.00

5 吸收存款 76,649.11

6 其他资产 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 324,690.66

注:1.此处的金额为公司对外公告之日;

2.证券从业人员的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的规定;

3.报告期内，本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4.报告期内本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

5.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

6.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

7.基金管理人持有的前十名股票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的情形。

8.基金管理人持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股股票库。

9.12 其他情况说明

1.中国证监会准予本基金募集的基金合同文本由基金管理人和基金托管人签署，自基金合同成立之日起生效，基金合同的成立日为基金合同成立之日。

2.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

3.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

5.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

6.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

7.基金管理人持有的前十名股票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的情形。

8.基金管理人持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股股票库。

9.13 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期(2015年7月1日至9月30日)

2.2 基金产品概况

基金品种:混合型基金

交易代码:001126

基金份额净值:0.906

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年6月16日

报告期末基金份额总额:303,276,647.00

报告期末基金净值:0.9017

注:本基金基金净值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。

本报告期已实现收益指基金收入减去各种费用后的余额，即为本期公允价值变动收益。

2.3 基金净值表现

2.3.1 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

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -181,671,278.00

2.本期利润 -180,323,946.03

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0268

4.期末基金份额净值 0.90276,647.00

5.期末基金份额净值 -0.0017

注:本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。

本报告附录财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 离任日期 说明

王立立 基金经理、基金经理 总经理 2014年6月14日 - 5年

注:1.此处的任职日期为公司对外公告之日;

2.证券从业人员的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的规定;

3.报告期内，本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4.报告期内本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

5.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

6.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

7.基金管理人持有的前十名股票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的情形。

8.基金管理人持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股股票库。

9.14 备查文件目录

1.中国证监会准予本基金募集的基金合同文本由基金管理人和基金托管人签署，自基金合同成立之日起生效，基金合同的成立日为基金合同成立之日。

2.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

3.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

5.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

6.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

7.基金管理人持有的前十名股票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的情形。

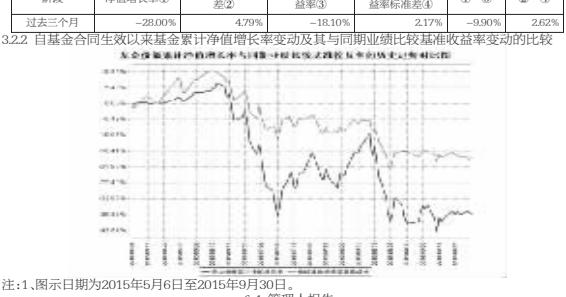
8.基金管理人持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股股票库。

9.15 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 6 开放式基金份额变动

2.3.2 基金合同生效以来本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:本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。

本报告附录财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 离任日期 说明

王立立 基金经理、基金经理 总经理 2014年6月14日 - 5年

注:1.此处的任职日期为公司对外公告之日;

2.证券从业人员的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的规定;

3.报告期内，本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4.报告期内本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

5.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

6.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

7.基金管理人持有的前十名股票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的情形。

8.基金管理人持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股股票库。

9.16 备查文件目录

1.中国证监会准予本基金募集的基金合同文本由基金管理人和基金托管人签署，自基金合同成立之日起生效，基金合同的成立日为基金合同成立之日。

2.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

3.本基金持有的前十名股票没有处于禁售期的可转换债券明细;

4