

东吴行业轮动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:华夏银行股份有限公司
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、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。
基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，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内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
根据基金管理人2015年8月7日刊登的《东吴行业轮动混合型证券投资基金招募说明书》，变更基金名称为“东吴行业轮动混合型证券投资基金”，基金类型由“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。投资人风险，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。
本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

东吴行业轮动混合

场内简称

东吴行业轮动

场内代码

580003

前缀交易代码

-

后缀交易代码

契约型开放式

基金合同生效日

2008年4月23日

报告期末基金份额总额

947,946,647.63份

基金投资目标

本基金为混合型基金，通过对行业轮动的操作的把握，侧重投资于预期高景气度的上市公司股票，从而实现基金资产的增值。

投资策略

本基金主要通过以下三个途径实现投资目标：一是通过行业轮动的操作，寻找行业景气度较高的行业，对不同行业的公司进行深入研究，从而选择出具有较好投资价值的上市公司股票，进而获取收益。

业绩比较基准

70%沪深300指数+25%“中信债基指数”

风险收益特征

本基金是一只主动管理的混合型基金，风险和预期收益均高于货币市场基金，低于股票型基金。

基金管理人

东吴基金管理有限公司

基金托管人

华夏银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益

-163,181,096.73

2.本期利润

-279,030,691.02

3.加权平均基金份额本期利润

-0.2768

4.期末基金资产净值

688,227,446.63

5.期末基金份额净值

0.6163

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)扣除相关税费后的余额，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。

3.2.3 基金的表决权代表

3.2.1 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3.1 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.2 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.3 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.4 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.5 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.6 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.7 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.8 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.9 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.10 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.11 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.12 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.13 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.14 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.15 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.16 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.17 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.18 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.19 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.20 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.21 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.22 本基金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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -31.16% 4.02% -20.03% 25.15% -10.26% 2.31%

注:比较基准=沪深300指数×25%+“中信债基指数”

3.2.3.23 本基金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