

东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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代表其未来表现。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2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:东吴新趋势

基金主代码:001322

交易代码:001322

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年7月1日

报告期基金份额总额:737,696,598.49份

本基金为混合型基金，主要投资于代表未来发展趋势的新经济、新技术、新生活、新产业的优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，力求实现基金净值的持续稳定地超越业绩比较基准。

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金在综合运用基金管理人研究投资策略、采取避险策略和资产配置策略的基础上，精选具有成长性的股票，同时适当配置债券、货币市场工具和权证等固定收益品种，力争在控制风险的前提下，实现基金持有人的财富保值增值目标。但本价格线增长趋势并不代表本基金净值增长和长曲线。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -61,910,182.23

2.本期利润 -107,336,020.83

3.加权平均基金份额利润 -0.2631

4.期末基金份额净值 590,606,542.68

5.期末基金份额净值 -0.2631

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.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。

3.2.1 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立，截至本报告期末已完成建仓，本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

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

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立，截至本报告期末已完成建仓，本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

戴斌 权益投资部总经理,本基金基金经理 2015年7月1日 - 9年

本基金基金经理,本基金持有人严格遵守《证券投资基金法》,中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人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,加强了对所管理的不同投资组合向同一交易对象的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究、分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金管理费收入和支出分析

本基金报告期内,未出现连续二十个工作日出现基金持有人人数或基金资产净值低于5千万元情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -61,910,182.23

2.本期利润 -107,336,020.83

3.加权平均基金份额利润 -0.2631

4.期末基金份额净值 590,606,542.68

5.期末基金份额净值 -0.2631

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.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。

3.2.1 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

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

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

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.3 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.4 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.5 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.6 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.7 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.8 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.9 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.10 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.11 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.12 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.13 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -24.07% 2.86% 1.58% -15.24% 1.27%

注:1.东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金于2015年7月1日成立,截至本报告期末已完成建仓,本基金各项资产配置比例符合合同规定。

2.基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

3.2.14 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-