

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

[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

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不直接在本基金、证券期货经营机构、私募基金管理人、其他金融产品担任董事、监事、高级管理人员,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、净值表现和投资组合报告。

基金管理人声明本基金不直接将收益分配给基金份额持有人,但不代表本基金一定盈利。

基金管理人承诺不以摊余成本法对本基金进行估值,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

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

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

场内简称

东吴进取

基金代码

5690006

交易代码

5690005

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2009年5月6日

报告期末基金资产总额

64,793,711.72份

投资目标

本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,以成长股为投资对象,并对不同成长类股票采取不同的操作策略,追求超额收益。

投资策略

本基金的投资策略上有所调整,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,对股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例进行动态调整。

本基金的投资策略主要体现为股票配置策略、债券配置策略、股票配置策略、债券配置策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。

业绩比较基准

60%×沪深300指数+30%×中证全债指数。

本基金一只进行主动管理的综合基金,其风险和预期收益要低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于中高风险,预期收益也略高于股票型基金。

基金管理人

东吴基金管理有限公司

§ 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 -4,360,010.18

2.本期利润 -13,246,560.50

3.加权平均基金份额本期利润 -0.02020

4.期末基金份额净值 0.97464 0.9941

5.期末基金份额净值 1.0001

注:1.本期已实现收益指基金收入扣除各项费用后的余额,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.上期基金的业绩指标不包括个人买卖或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 本基金报告期的净值增长率为及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:比较基准=60%×沪深300指数+30%×中证全债指数

3.2.2 本基金合同生效以来以其基金资产净值增长率及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:比较基准=60%×沪深300指数+30%×中证全债指数

3.2.2 本基金报告期的净值增长率为及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:比较基准=60%×沪深300指数+30%×中证全债指数