

东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31日

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

重要提示
基金管理人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。

基金概况
基金名称:东吴进取策略混合
基金代码:580005
基金运作方式:契约型开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日)

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。

3.2 基金净值表现
阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

注:1.业绩比较基准=75%*沪深300指数+25%*中信标普全债指数
注:2.本基金合同生效以来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

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
阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

注:1.本基金于2009年4月6日成立,根据基金合同有关规定,本基金自成立之日起6个月内为建仓期,目前已完成建仓,产率回报符合基金合同的规定。

4.1 基金经理 钱基敏小组 简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 限 说明

基金经理 钱基敏小组 简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 限 说明

注:1.王刚女士为基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日期。
注:2.基金经理变更须经中国证监会核准,并经中国证监会于2009年12月25日登载于相关媒体。

4.3 公平交易专项说明
本报告期,本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,确保了公司管理的不相同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节得到公平对待。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2009年4季度,国内宏观经济政策持续宽松,其中出口增速复苏尤为强劲,12月同比增速达到17.7%,预期2010年上半年经济增速仍将维持向上趋势,美国在通胀数据超预期,显示其经济复苏态势较为稳健,预计美国短期内的通胀仍将维持高位,A股市场震荡走高,消费类、电子类等行业表现活跃。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

4.5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

4.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

4.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

4.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

4.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

4.5.4 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债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

4.5.4 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债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

4.5.5 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权证投资明细
无。

4.5.6 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
无。

4.5.7 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
无。

4.5.8 报告期末本基金投资的资产支持证券的投资情况
无。

4.5.9 投资组合报告附注
注:1.本基金报告期内未持有处于转股期的可转换债券品种。

4.5.10 投资组合报告附注的其他重要信息
无。

4.6 备查文件目录
1.中国证监会批准东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2.中国证监会批准东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金募集说明书;
3.东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

6.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

7.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

8.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

9.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

10.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

11.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

12.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

13.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

14.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

15.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

16.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

17.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

18.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

19.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

20.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

21.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

22.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

23.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

24.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

25.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

26.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

27.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

28.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

29.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

30.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

31.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

32.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

33.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

34.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

35.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

36.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

37.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

38.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

39.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

40.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

41.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

42.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

43.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

44.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

45.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

46.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

47.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

48.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

49.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

50.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

51.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

52.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

53.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

54.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

55.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

56.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

57.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

58.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

59.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

60.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

61.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

62.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

63.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

64.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

65.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

66.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

67.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

68.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

69.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

70.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

71.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

72.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

73.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

74.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

75.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

76.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

77.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

78.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

79.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

80.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

81.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

82.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

83.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

84.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

85.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

86.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

87.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

88.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

89.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

90.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

91.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

92.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

93.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

94.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

95.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

96.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

97.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

98.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

99.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

100.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

101.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

102.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

103.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

104.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

105.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

106.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

107.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

108.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

109.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

110.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

111.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

112.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

113.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

114.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

115.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

116.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

117.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

118.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

119.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

120.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

121.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

122.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

123.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

124.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

125.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

126.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

127.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

128.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

129.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

130.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

131.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

132.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

133.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

134.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

135.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

136.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

137.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

138.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

139.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

140.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

141.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

142.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

143.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

144.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

145.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

146.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

147.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

148.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

149.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

150.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

151.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

152.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

153.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

154.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

155.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

156.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

157.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

158.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

159.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

160.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

161.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

162.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

163.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

164.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

165.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

166.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

167.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

168.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

169.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

170.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

171.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

172.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

173.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

174.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

175.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

176.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

177.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

178.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

179.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

180.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

181.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

182.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

183.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

184.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

185.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

186.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;

187.报告期内本基金投资流通受限股票、资产支持证券、国债期货、股指期货、权证等品种的相关公告;

188.基金管理人投资业务资格批件、营业执照和公司章程;