

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

2013 第三季度报告

2013年9月30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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资并不构成对任何人的投资建议。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。

本报告中财务资料截止于2013年7月1日起至9月30日止。

基金简称:东吴进取策略混合 基金代码:580005

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

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2009年5月6日

报告期末基金份额总额:586,242,647.40份

投资目标:本基金为混合型基金,在有效控制风险并保持良好的流动性的前提下,以长期价值投资为对象,并对不同成长类型股票采取不同操作策略,追求超额收益。

投资策略:本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,确定基金资产在股票、债券、现金和衍生品上的投资比例。

业绩比较基准:65%*沪深300指数+35%*中债综合指数

风险收益特征:本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其风险和预期收益要低于股票型基金,高于货币型基金和债券型基金。

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

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)

1.本期已实现收益 2,085,419.42

2.本期利润 100,551,256.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.1656

4.期末基金资产净值 666,809,638.18

5.期末基金份额净值 1.1374

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 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 16.29% 1.26% 6.29% 0.94% 10.00% 0.32%

注:1.比较基准:65%*沪深300指数+35%*中债综合指数

2.比较基准:65%*沪深300指数+35%*中债综合指数

基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.东吴进取策略混合基金于2009年5月6日成立

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资并不构成对任何人的投资建议。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。

本报告中财务资料截止于2013年7月1日起至9月30日止。

基金简称:东吴进取策略混合 基金代码:580005

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

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2009年5月6日

报告期末基金份额总额:586,242,647.40份

投资目标:本基金为混合型基金,在有效控制风险并保持良好的流动性的前提下,以长期价值投资为对象,并对不同成长类型股票采取不同操作策略,追求超额收益。

投资策略:本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,确定基金资产在股票、债券、现金和衍生品上的投资比例。

业绩比较基准:65%*沪深300指数+35%*中债综合指数

风险收益特征:本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其风险和预期收益要低于股票型基金,高于货币型基金和债券型基金。

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

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)

1.本期已实现收益 2,085,419.42

2.本期利润 100,551,256.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.1656

4.期末基金资产净值 666,809,638.18

5.期末基金份额净值 1.1374

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 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 16.29% 1.26% 6.29% 0.94% 10.00% 0.32%

注:1.比较基准:65%*沪深300指数+35%*中债综合指数

2.比较基准:65%*沪深300指数+35%*中债综合指数

基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.东吴进取策略混合基金于2009年5月6日成立

东吴行业轮动股票型证券投资基金

2013 第三季度报告

2013年9月30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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资并不构成对任何人的投资建议。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。

本报告中财务资料截止于2013年7月1日起至9月30日止。

基金简称:东吴行业轮动股票 基金代码:580003

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

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2009年4月23日

报告期末基金份额总额:2,295,718,706.52份

投资目标:本基金为股票型基金,通过对行业轮动策略的把握,侧重投资于预期收益较高的行业,并重点投资于具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票,追求超额收益。

投资策略:本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,确定基金资产在股票、债券和现金上的投资比例。

业绩比较基准:75%*沪深300指数+25%*中债综合指数

风险收益特征:本基金是一只进行主动投资的股票型基金,其风险和预期收益要高于混合型基金,高于货币型基金和债券型基金。

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

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)

1.本期已实现收益 -181,295,179.66

2.本期利润 32,290,679.87

3.加权平均基金份额本期利润 0.0136

4.期末基金资产净值 1,362,538,103.36

5.期末基金份额净值 0.5934

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 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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.06% 1.89% 7.26% 1.08% -5.15% 0.81%

注:1.比较基准:75%*沪深300指数+25%*中债综合指数

2.比较基准:75%*沪深300指数+25%*中债综合指数

基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.东吴行业轮动股票基金于2009年4月23日成立

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。

基金管理人承诺