东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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
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,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。投资有风险,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

基金简称	东吴阿尔法灵活配置混合
场内简称	-
基金主代码	000531
交易代码	000531
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月19日
报告期末基金份额总额	83,960,725.80份
投资目标	本基金为混合型基金,坚持以大类资产轮动为主、金融衍生品对冲投资为辅的投资策略,在有效控制风险的前提下,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则,强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。在大类资产配置方面,通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需及具体行业发展情况,证券市场估值水平等方面问题的深入研究,分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益,通过公司数量化模型确定资产配置比例并动态地优化管理。
业绩比较基准	沪深300指数x65%+中国债券综合全价指数x35%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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	-75,889,660.22
2.本期利润	-30,746,112.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0379
4.期末基金资产净值	88,616,097.49
5.期末基金份额净值	1.055

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。

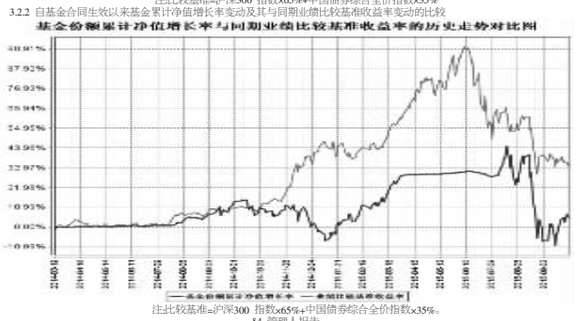
3.2 基金净值表现

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	-18.66%	3.71%	-18.06%	2.17%	-0.60%	1.54%

注:比较基准=沪深300 指数x65%+中国债券综合全价指数x35%

3.2.2 自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



注:比较基准=沪深300 指数x65%+中国债券综合全价指数x35%。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王立立	本基金基金经理、基金投资总部副总经理	2014年6月14日	-	5年	硕士,复旦大学世界经济专业。2010年7月至2010年12月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理,2011年1月至2012年7月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员,自2012年7月起加入东吴基金管理有限公司,曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理,现任基金投资总部副总经理,其中自2013年12月24日起担任东吴菁禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理,自2014年6月14日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2015年2月6日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、自2015年5月29日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理。

注:1,此处的任职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金所持有的锦富新材(300128)连续停牌,期间因赎回、净值波动等原因,本基金出现连续十个交易日以上投资于锦富新材(300128)的比例被动超过基金资产净值10%的情形,本基金管理人已在该股票复牌后,按照法律法规及基金合同的相关规定做出调整。除此之外,本基金管理人严格遵守《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规定,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,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,加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析,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、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,尽管国家队出手救市,但国内资本市场仍然出现大幅调整,上证综指下跌28.6%,创业板指数下跌27.1%。尤其是8月18日至8月26日,在证监会强势降杠杆叠加人民币贬值预期升温的冲击下,短短7个交易日内大盘跌去接近1000点,个股再次出现连续的跌停潮。至9月,市场在3000点附近得以稳固。

宏观经济继续低迷。8月份中国采购经理人指数PMI再次跌至50%荣枯线以下至49.7%,为2011年11月以来最低值,9月也仅为49.8%。最新公布的CPI仅为1.4%,显示通缩已经成为现实。

回顾6月份以来市场的断崖式下跌,杠杆无疑是最主要的因素之一。前期市场快速上涨,场外配资汹涌而在指数一度突破5000点,管理层开始降杠杆后,场内外配资出现连锁反应导致股票的大幅下跌。这一过程中,无论宏观经济层面,还是对未来的改革预期上,本质上都未发生明显变化。站在目前时点,管理层对场外配资的态度已经明确,降杠杆成为必然。场内融资也得到了一定程度的控制。从这一点来看,未来市场稳定向上的概率更大。

新趋势基金将继续保持成长股的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.969元,累计净值0.969元;本报告期份额净值增长率-3.10%,同期业绩比较基准收益率为-18.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体上我们对四季度市场持乐观态度。

股票永远都是经济的晴雨表。我国正在经历意义深远的转型和改革,尽管渐入深水区,但改革的决心依然没有丝毫动摇,这对市场的稳定起到了关键作用。短期看,三季报业绩预告逐渐出炉,大部分上市公司依然保持了较快增长,也为市场提供了向上的动力。

但市场活跃度较上半年可能有所下降,管理层对杠杆的强硬态度,导致最活跃的一批资金很难再次进入市场。因此寻找景气度确定性高、业绩增长有保障的标的成为下一阶段新趋势基金的重点工作内容之一。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内,未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§5 投资组合报告

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(%)
1	权益投资	83,384,620.66	91.83
	其中:股票	83,384,620.66	91.83
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,093,081.04	7.81
7	其他资产	324,696.56	0.36
8	合计	90,802,398.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,386,949.86	74.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,444,164.80	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,815,126.00	11.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,992,272.00	3.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,746,108.00	1.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	83,384,620.66	94.10

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(%)
1	002407	多氟多	172,900	6,319,495.00	7.13
2	300261	雅本化学	479,800	5,954,318.00	6.72
3	300073	当升科技	239,200	4,784,000.00	5.40
4	300285	国瓷材料	152,328	4,722,168.00	5.33
5	300203	聚光科技	192,363	4,626,330.15	5.22
6	002405	四维图新	178,500	4,489,275.00	5.07
7	300168	万达信息	145,700	4,436,565.00	5.01
8	300038	梅泰诺	154,000	4,432,120.00	5.00
9	002488	金固股份	228,900	4,429,215.00	5.00
10	601799	星宇股份	194,400	4,245,696.00	4.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	244,018.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,028.66
5	应收申购款	78,649.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	324,696.56

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300168	万达信息	4,436,565.00	5.01	重大资产重组
2	300261	雅本化学	5,954,318.00	6.72	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,092,434,827.80
报告期期间基金总申购份额	8,663,371.53
减:报告期期间基金总赎回份额	4,017,137,473.53
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	83,960,725.80

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	15,491,092.18
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	15,491,092.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.45

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴阿尔法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、报告期内东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站:http//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 (021)50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司
2015年10月26日

东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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
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,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。投资有风险,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(基金合同生效日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴新趋势
场内简称	-
基金主代码	001322
交易代码	001322
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	1,156,336,057.89份
投资目标	本基金为混合型基金,主要投资于代表未来发展趋势的新能源、新技术、新生活产业中的优质上市公司,在控制风险、确保基金资产流动性的前提下,力争实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略,科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=沪深300指数x65%+中国债券综合全价指数x35%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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

注:为了更好地体现管理人与基金持有人利益一致的目的,基金管理人在基金管理中设置"价值线"作为管理费收取和风险控制的参考依据,从而更有效的发挥自身的专业研究与管理能力,最大程度实现基金持有人的财富保值增值目标。但本价值线增长轨迹并不代表基金净值增长曲线。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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	-31,769,150.73
2.本期利润	-41,808,990.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0308
4.期末基金资产净值	1,120,126,008.58
5.期末基金份额净值	0.969

3.2 基金净值表现

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	-3.10%	0.41%	-18.06%	2.17%	14.96%	-1.76%

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,截至本报告期末成立不满六个月,尚处于建仓期。

2、基金业绩比较基准=沪深300指数x65%+中国债券综合全价指数x35%。

3.2.2 自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

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,截至本报告期末成立不满六个月,尚处于建仓期。

2、基金业绩比较基准=沪深300指数x65%+中国债券综合全价指数x35%。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴斌	基金投资总部副总经理、本基金基金经理	2015年7月1日	-	8.5年	博士,中国人民大学金融学毕业。自2007年1月起加入东吴基金管理有限公司一直从事证券投资研究工作,曾任研究部宏观经济、金融工程研究员,产品策划部产品设计研究员,基金经理助理,现任基金投资总部副总经理,其中自2013年12月24日起担任东吴新产业混合型证券投资基金基金经理,自2014年11月6日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理,自2014年12月12日起担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理,自2015年5月27日起担任东吴移动互联混合型证券投资基金基金经理,自2015年7月1日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金基金经理。

注:1、戴斌为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《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规定,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,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,加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,尽管国家队出手救市,但国内资本市场仍然出现大幅调整,上证综指下跌28.6%,创业板指数下跌27.1%。尤其是8月18日至8月26日,在证监会强势降杠杆叠加人民币贬值预期升温的冲击下,短短7个交易日内大盘跌去接近1000点,个股再次出现连续的跌停潮。至9月,市场在3000点附近得以稳固。

宏观经济继续低迷。8月份中国采购经理人指数PMI再次跌至50%荣枯线以下至49.7%,为2011年11月以来最低值,9月也仅为49.8%。最新公布的CPI仅为1.4%,显示通缩已经成为现实。

回顾6月份以来市场的断崖式下跌,杠杆无疑是最主要的因素之一。前期市场快速上涨,场外配资汹涌而在指数一度突破5000点,管理层开始降杠杆后,场内外配资出现连锁反应导致股票的大幅下跌。这一过程中,无论宏观经济层面,还是对未来的改革预期上,本质上都未发生明显变化。站在目前时点,管理层对场外配资的态度已经明确,降杠杆成为必然。场内融资也得到了一定程度的控制。从这一点来看,未来市场稳定向上的概率更大。

新趋势基金将继续保持成长股的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.186元,累计净值1.186元;本报告期份额净值增长率0.42%,同期业绩比较基准收益率为-9.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体上我们对四季度市场持乐观态度。

股票永远都是经济的晴雨表。我国正在经历意义深远的转型和改革,尽管渐入深水区,但改革的决心依然没有丝毫动摇,这对市场的稳定起到了关键作用。短期看,三季报业绩预告逐渐出炉,大部分上市公司依然保持了较快增长,也为市场提供了向上的动力。

但市场活跃度较上半年可能有所下降,管理层对杠杆的强硬态度,导致最活跃的一批资金很难再次进入市场。因此寻找景气度确定性高、业绩增长有保障的标的成为下一阶段配置优化基金的重点工作内容之一。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内,未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§5 投资组合报告

转型后:

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(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	30,479,156.87	62.13
	其中:债券	30,479,156.87	62.13
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	7,000,000.00	14.27
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,279,176.26	20.95
7	其他资产	1,298,407.42	2.65
8	合计	49,056,740.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,267,156.87	25.06
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,212,000.00	49.34
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,479,156.87	74.40

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(%)
1	1282401	12闽润MTN1	200,000	20,212,000.00	49.34
2	1280359	12西矿集团债	100,000	10,266,000.00	25.06
3	112076	12雅致02	10	1,054.40	0.00
4	112148	12汇电债	1	102.47	0.00

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	102,861.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	172,623.36
5	应收申购款	12,763.685.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,039,170.35

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300168	万达信息	53,678,569.35	4.79	重大资产重组
2	600446	金证股份	29,199,840.00	2.61	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年7月1日)基金份额总额	1,509,002,981.31
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	19,939,486.10
减:报告期期间基金总赎回份额	372,606,409.52
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,156,336,057.89

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴新趋势价值线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、报告期内东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站:http//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 (021)50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司
2015年10月26日

东吴配置优化混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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
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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

东吴配置优化混合型证券投资基金根据《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》的约定由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来,东吴保本混合型证券投资基金于2012年8月13日生效,该基金保本周期期限三年,自该基金基金合同生效日期至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日,即本基金于2015年8月13日到期。由于不符合保本基金存续条件,根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,在保本周期届满后,选择期截止日的次日,即2015年8月19日起东吴保本混合型证券投资基金转型为"东吴配置优化混合型证券投资基金",就前述基金变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同的约定履行相关备案手续。

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。投资有风险,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8月19日(基金合同生效日)起至9月30日止(注:东吴保本混合型证券投资基金报告期自2015年7月1日起至2015年8月18日止)。

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	东吴配置优化混合
场内简称	-
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月19日
报告期末基金份额总额	34,536,111.49份
投资目标	本基金主要投资于具有持续竞争优势的企业,追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金在严格风险控制的基础上,追求稳健收益。
业绩比较基准	60%*沪深300指数+40%*中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。
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

转型前:

基金简称	东吴保本混合
场内简称	-
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月13日
报告期末基金份额总额	60,942,614.53份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险策略的运作,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳健增长。
投资策略	本基金遵循保本增值的投资理念,根据恒定组合投资保险策略原理进行资产配置,保证保本周期到期时本金安全,同时通过精选个股和个券实现基金资产的稳健增长。
业绩比较基准	银行三年期定期存款收益率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	转型后	
	报告期(2015年8月19日 - 2015年9月30日)	
1.本期已实现收益	690,720.44	
2.本期利润	219,718.03	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0049	
4.期末基金资产净值	40,964,341.03	
5.期末基金份额净值	1.186	

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。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	转型前			
	报告期(2015年7月1日 - 2015年8月18日)			
1.本期已实现收益	2,496,868.57			
2.本期利润	565,004.47			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042			
4.期末基金资产净值	72,002,808.38			
5.期末基金份额净值	1.181			

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、所列数据截止到2015年8月18日。

3.2 基金净值表现(转型后)

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	0.42%	0.04%	-9.