

东吴优信稳健债券型证券投资基金

[2013] 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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一三年四月二十一日

§ 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。

基金托管人对报告期内本基金运作遵守信情况的说明。

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。

报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 东吴优信稳健债券

基金主代码 582001

交易代码 582001

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2008年11月5日

报告期末基金份额总额 698,052,302.76份

投资目标 本基金是一只债券型基金，在控制风险和保持资产流动性的前提下，在创造高信用等级债券基础上，通过主动式管理量化分析寻求稳健、较高的投资收益。

投资策略 本基金的投资策略主要通过债券投资来实现。股票投资为辅的策略构建和调整投资组合。对于债券投资，本基金通过利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的判断，确定本基金债券组合的期限和期限结构配置。债券选择上，本基金根据债券信用风险特征，对债券评级、信用利差和税收差异等因素的分析，并考虑债券流动性和操作策略，选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金的投资目的是为债券投资者的利益补充，主要采取自下而上的债券精选具有估值优势的优质企业股票作为投资对象。

业绩比较基准 中信债全债指数

本基金主要投资于高信用级别的债券资产，债券资产占比在基金资产中的低风险品种，长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

基金管理人 东吴基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 东吴优信稳健债券 A 东吴优信稳健债券 C

下属两级基金的交易代码 582001 582001

报告期末下属两级基金的份额总额 477,297,900.46份 220,754,402.30份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)

东吴优信稳健债券 A 东吴优信稳健债券 C

1.本期已实现收益 8,375,056.33 2,924,676.15

2.本期利润 10,354,789.66 3,526,788.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.0207 0.0189

4.期末基金资产净值 502,647,570.83 229,267,294.73

5.期末基金份额净值 1.0531 1.0386

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，本期利息收入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将低于所列数字。

3.经中国证监会批准，本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类。

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

东吴优信稳健债券 A 1.0531 1.0386

注:1.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类。

2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类。

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.比较基准=中信债全债指数。

2.东吴优信稳健债券基金2008年11月5日成立。

3.经中国证监会批准，本基金于2009年6月15日分为A、C两类。

§ 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

丁蕙 本基金基金经理 固定收益部总经理 2011年9月28日 13.5年

王勇 本基金基金经理 2011年7月27日 17.5年

说明:王勇先生为本基金的前任基金经理，此处的任职日期为基金合同生效日。

2.本基金的基金经理的合同时从行业协会、银行业从业人员资格管理办法相关规定的。

3.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。

4.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。

报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§ 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 - -

2 固定收益投资 1,082,774,809.50 92.37

3 货币支持证券 1,082,774,809.50 92.37

4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 43,162,537.23 3.68

6 其他资产 46,222,422.53 3.94

7 合计 1,172,159,769.26 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金未按行业分类投资。

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

本基金未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组合的明细。

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

本基金未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组合的明细。

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十名资产支持证券投资明细

本基金未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组合的明细。

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权证及权证投资明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及权证投资组合的明细。

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十名贵金属投资明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合的明细。

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十名保险投资明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险投资组合的明细。

5.9 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.10 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债券投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合的明细。

5.11 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.12 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权证及权证投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及权证投资组合的明细。

5.13 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贵金属投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合的明细。

5.14 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保险投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险投资组合的明细。

5.15 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.16 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债券投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合的明细。

5.17 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.18 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权证及权证投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及权证投资组合的明细。

5.19 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贵金属投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合的明细。

5.20 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保险投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险投资组合的明细。

5.21 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.22 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债券投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合的明细。

5.23 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.24 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权证及权证投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及权证投资组合的明细。

5.25 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贵金属投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合的明细。

5.26 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保险投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险投资组合的明细。

5.27 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.28 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债券投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合的明细。

5.29 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.30 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权证及权证投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及权证投资组合的明细。

5.31 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贵金属投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合的明细。

5.32 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保险投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险投资组合的明细。

5.33 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.34 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债券投资组合的明细

本基金未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合的明细。

5.35 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组合的明细

本基金未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组合的明细。

5.36 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权证及权证投资组合的明细