

东吴保本混合型证券投资基金

[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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

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2013年4月17日核对了本报告中的财务指标、净值表现、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:东吴保本混合

基金主代码:582003

交易代码:582003

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:2012年8月13日

报告期末基金份额总额:564,713,098.83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，根据组合投资保险策略进行资产配置，保证本周期到期时本金安全，同时通过组合投资于债券实现基金资产的稳健增值。

业绩比较基准:银行三年定期存款收益率(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

基金保证人:中国银行股份有限公司

§ 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)

1.本期已实现收益 8,332,438.01

2.本期利润 13,254,342.27

3.加权平均基金份额本期利润 0.0219

4.期末基金份额净值 583,736,140.26

1.034

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.基金业绩比较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。

3.2.1 本基金净值表现

3.2.1 本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 1.21% 0.09% 1.05% 0.02% 1.12% 0.07%

过去三个月 2.17% 0.09% 1.05% 0.02% 1.12% 0.07%

注:比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)。

3.2.2 本基金同生效以来基金份额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

3.2.2 本基金同生效以来基金份额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