

## 东吴优信稳健债券型证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

基金管理人:东吴基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16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2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基本产品概况

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 2006年11月5日

报告期末基金份额总额 481,841,014.35份

投资目标 本基金属于债券型基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,精选高信用等级债券基础上通过主动管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。

投资策略 本基金是一只债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅的理财产品和稳健投资组合,为债券基金投资,本基金通过对利率走势的判断和债券收益率的分析,主要采用债券投资为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为债券投资的有益补充,主要采取以下策略:选择具有估值优势的优秀企业股票作为投资对象。

业绩比较基准 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

2013年2季度债市遭遇了“债市监管”之“钱荒风暴”。尽管基本面依然有利,经济数据进一步下滑,通胀无忧。但社会融资总量增速加快,使得“金融热,经济冷”的矛盾症状。“资金空转”、“资本空转”成为热点,套利行为和同质负债过高使得央行加强理性的清理。4月资金监管理财第一次大幅调整,之后反弹,但5月对境外资本外流的监管加强后,外汇占款增长带来首次大幅调整,之后反弹。但5月对境外资本外流的监管加强后,外汇占款增长带来首次大幅调整,之后反弹。各种流动性负面因素在6月底集中爆发,带来债市首次大幅调整。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新债市面对经济下行的警惕性已经明朗,经济基本面无忧。三季度债市走向仍然被流动性支配。目前央行货币政策目标已不仅围绕经济与通胀的基本因素,同时还有引导市场预期对流动性的宽松预期以应对危机的意图,我们认为央行未来对流动性更多的将是被动应对,而不会主动引导宽松,资金中枢比上半年提高。未来资金面的紧平衡将成为常态。上半年流动性的宽松将侧重于利差和信用风险的累积。因此我们对三季度流动性与信用环境谨慎乐观的态度。

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 - -

其中:股票 - -

2 固定收益投资 666,723,383.06 93.51

其中:债券 666,723,383.06 93.51

3 货币衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 33,559,151.36 4.71

6 其他资产 12,704,716.31 1.78

7 合计 712,987,250.73 100.00

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

本基金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

本基金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名的前五名债券投资明细

本基金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名的前十名资产支持证券投资投资明细

本基金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名的前五名权证及权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名保险投资明细

本基金报告期末未持有保险投资。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名基金投资明细

本基金报告期末未持有基金投资。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及权证投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名保险投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本基金于2011年2月1日成立。

5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十