

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：二〇一三年七月十八日

§ 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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30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	486,912,415.84份

本基金主要通过投资组合保险策略的运用，在确保保本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。

本基金遵循保本增值的投资理念，根据恒定组合投资保险原理进行资产配置，保证保本期到期时本金安全，同时通过精选个股和券实现基金资产的稳健增长。

业绩比较基准 银行一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

基金保证人 中国投资担保有限公司

§ 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(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	11,234,346.06
2.本期利润	-3,481,009.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0065
4.期末基金份额净值	499,427,822.38
5.期末基金份额净值	1.026

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，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

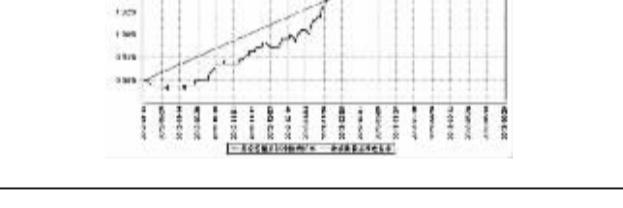
3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-②④	②-④⑤
过去三个月	-0.77%	0.18%	1.06%	0.01%	-1.83% 0.17%

注：比较基准=银行一年期定期存款收益率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来本基金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



东吴保本混合型证券投资基金

2013 第二季度报告

注:1.比较基准=银行三年定期存款收益率 税后)。

2.本基金于2012年8月13日成立,基金合同生效日起至披露日不满一年,按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)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 公司固定收益部总经理	2012年8月13日	-	13.5年 中工商银行上海营业部交易员,汉唐证券固定收益部债券研究员主管,航天科工财务公司债券投资部经理,平安信托投资有限公司投资经理,2011年7月加入东吴基金管理有限公司,现担任公司固定收益部总经理兼东吴优信基金经理,2012年1月加入东吴保本混合基金经理,东吴分级债券型投资基金基金经理。

注:1.丁蕙为本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合规性情况的说明

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向交易差价的分析,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、业绩评估等环节的操作和环节得到公平对待。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的规定,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向交易差价的分析,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、业绩评估等环节的操作和环节得到公平对待。

4.3.2 报告期内基金投资组合类别的交易

截至报告期末,本基金未发现存在不公平交易和利益输送的情况。

4.3.3 报告期内基金投资组合发生的重大关联交易

截至报告期末,本基金未发现存在不公平交易和利益输送的情况。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.5 报告期内基金投资组合发生的重大关联交易

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,制定了东吴达富优势成长型证券投资基金公平交易制度,并贯穿于整个投资管理过程,从投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督和稽核各个环节,确保公平对待旗下每一个投资组合。