

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  
报告送达日期:二〇一四年三月二十九日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本基金年度报告已三分之二以上独立董事签字确认，并予以公告。

基金持有人有权按照股份有限公司根据本基金合同规定，在2014年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本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财产，但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其摘要并认真考虑其未来表现。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 东吴增利债券

基金代码 588202

交易代码 588202

基金运作方式 约定定期开放基金合同生效后一年内封闭运作，基金合同生效满一年后转为开放式。

基金合同生效日 2011年7月27日

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

报告期末基金资产总额 47,889,559.87

基金份额总额 不定期

下属分级基金的基金简称 东吴增利债券A

下属分级基金的交易代码 588202

报告期末基金资产的份额总额 36,504,528.30份

单位:人民币元 11,385,031.570

2.2 基金产品说明

本基金具有低风险的特征，在本基金的运作过程中，通过大类资产配置追求稳健的投资收益。

投资目标 本基金严格遵守《基金法》和《基金合同》，坚持“稳健投资，力争实现基金资产的长期稳健增值”。

业绩比较基准 中国债券综合全价指数

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

姓名 基金管理人 基金托管人

名称 东吴基金管理有限公司 中信银行股份有限公司

地址 上海市浦东新区陆家嘴环路500号 徐汇区长乐路367号

联系人 张文明

信息披露负责人 联系电话 021-50509888-8308

电子邮箱 xjy@fundcm.com.cn

客户服务电话 021-50509666/400-821-0588

传真 021-50509888-8211

东吴基金管理人和基金托管人对本基金的管理费、托管费等费用的收取标准、费率和计算方法、支付时间和支付方式等进行了约定。

2.4 信息披露方式

基金份额净值以人民币元为单位在互联网网址 www.fundcm.com.cn 上披露。

基金份额净值公告发布后，基金管理人将通过办公场所

3.1 主要财务数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 财务数据

2013年 2012年 2011年

2011年7月27日(基金合同生效日)~2011年12月31日

2011年12月31日

东吴增利债券A 东吴增利债券C 东吴增利债券A 东吴增利债券C

本期已实现收益 3,065,492.81 604,749.32 11,980,091.59 7,253,027.80 2,888,510.12 1,675,143.22

本期利润 2,236,289.07 304,134.27 11,019,616.13 6,600,591.01 3,773,748.23 2,281,805.66

加权平均基金份额净值 0.0351 0.0191 0.0563 0.0822 0.0151 0.0133

本期基金份额变动率 1.37% 0.89% 4.65% 4.25% 1.50% 1.30%

3.1.2 数据指标

2013年末 2012年末 2011年末

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

3.1.3 资产负债表

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

3.1.4 利润表

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

3.1.5 所有者权益变动表

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

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，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润除期末持有的现金之外未分派利润中已包含分红的股息数。

3.本期末的资产负债率为0%，即期末总资产减去货币资金后的余额除以期末总资产后的百分比，该指标不包括持有人预期偿还的应付赎回款。

4.基金的分类

5.基金的金融资产

6.基金的金融负债

7.基金的净资产

8.本期利润

9.本期基金份额变动

10.本期基金份额变动率

11.本期代销机构

12.本期净买入正回购款项

13.本期净卖出逆回购款项

14.本期净买入正回购款项

15.本期净卖出逆回购款项

16.本期净买入正回购款项

17.本期净卖出逆回购款项

18.本期净买入正回购款项

19.本期净卖出逆回购款项

20.本期净买入正回购款项

21.本期净卖出逆回购款项

22.本期净买入正回购款项

23.本期净卖出逆回购款项

24.本期净买入正回购款项

25.本期净卖出逆回购款项

26.本期净买入正回购款项

27.本期净卖出逆回购款项

28.本期净买入正回购款项

29.本期净卖出逆回购款项

30.本期净买入正回购款项

31.本期净卖出逆回购款项

32.本期净买入正回购款项

33.本期净卖出逆回购款项

34.本期净买入正回购款项

35.本期净卖出逆回购款项

36.本期净买入正回购款项

37.本期净卖出逆回购款项

38.本期净买入正回购款项

39.本期净卖出逆回购款项

40.本期净买入正回购款项

41.本期净卖出逆回购款项

42.本期净买入正回购款项

43.本期净卖出逆回购款项

44.本期净买入正回购款项

45.本期净卖出逆回购款项

46.本期净买入正回购款项

47.本期净卖出逆回购款项

48.本期净买入正回购款项

49.本期净卖出逆回购款项

50.本期净买入正回购款项

51.本期净卖出逆回购款项

52.本期净买入正回购款项

53.本期净卖出逆回购款项

54.本期净买入正回购款项

55.本期净卖出逆回购款项

56.本期净买入正回购款项

57.本期净卖出逆回购款项

58.本期净买入正回购款项

59.本期净卖出逆回购款项

60.本期净买入正回购款项

61.本期净卖出逆回购款项

62.本期净买入正回购款项

63.本期净卖出逆回购款项

64.本期净买入正回购款项

65.本期净卖出逆回购款项

66.本期净买入正回购款项

67.本期净卖出逆回购款项

68.本期净买入正回购款项

69.本期净卖出逆回购款项

70.本期净买入正回购款项

71.本期净卖出逆回购款项

72.本期净买入正回购款项

73.本期净卖出逆回购款项

74.本期净买入正回购款项

75.本期净卖出逆回购款项

76.本期净买入正回购款项

77.本期净卖出逆回购款项

78.本期净买入正回购款项

79.本期净卖出逆回购款项

80.本期净买入正回购款项

81.本期净卖出逆回购款项

82.本期净买入正回购款项

83.本期净卖出逆回购款项

84.本期净买入正回购款项

85.本期净卖出逆回购款项

86.本期净买入正回购款项

87.本期净卖出逆回购款项

88.本期净买入正回购款项

89.本期净卖出逆回购款项

90.本期净买入正回购款项

91.本期净卖出逆回购款项

92.本期净买入正回购款项

93.本期净卖出逆回购款项

94.本期净买入正回购款项

95.本期净卖出逆回购款项

96.本期净买入正回购款项

97.本期净卖出逆回购款项

98.本期净买入正回购