

## 东吴保本混合型证券投资基金

## [2012] 第四季度报告

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:二〇一三年一月十九日

## § 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2013年1月17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2012年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东吴保本基金
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	652,671,994.29份

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，根据恒定组合投资策略原理进行资产配置，保证在本周期到期时本金安全，同时通过构造假定个股和券类实现基金资产的稳健增长。

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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 5,604,061.55

2.本期利润 8,528,880.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0118

4.期末基金资产净值 660,445,333.72

5.期末基金份额净值 1.012

注:1.本基金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，本期利润为期初至本期期末的公允价值变动收益。

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要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

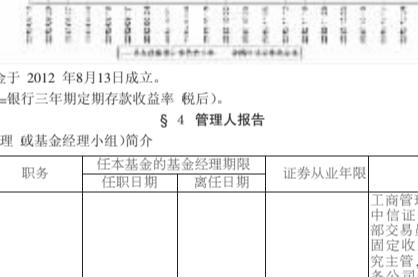
3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.20% 0.06% 1.07% 0.00% 0.13% 0.06%

注:比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)。

3.2.2 本基金合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



注:1.本基金于2012年8月13日成立。

2.比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
丁蕙	本基金的基金经理	2012年8月13日	-	13.5年 工商管理硕士，历任中信证券研究所研究员、中信证券研究所交易员、汉唐证券固定收益部债券研究主管、航天科工财务公司债券投资主管、平安资产管理公司投资经理；2011年7月加入东吴基金管理有限公司，现任东吴基金管理有限公司总经理助理、东吴基金管理有限公司债券投资总监、东吴基金管理有限公司基金经理、东吴保本混合基金基金经理。

注:1.丁蕙为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；

2.证券从业的定义从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规章及基金合同的规定及其有关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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，加强了对管理的不同投资组合向交易价格差的分析，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、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

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 报告期内本基金的评价策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.3 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.4 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.5 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.6 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.7 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.8 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.9 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.10 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.11 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.12 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.13 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.14 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.15 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.16 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.17 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.18 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.19 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.20 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.21 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.22 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.23 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.24 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.25 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.26 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.27 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.28 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.29 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.30 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.31 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.32 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.33 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.34 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.35 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.36 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.37 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.38 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.39 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.40 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.41 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.42 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.43 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.44 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.45 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.46 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.47 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.48 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.49 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.50 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.51 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.52 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.53 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.54 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.55 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.56 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.57 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.58 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.59 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.60 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.61 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.62 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.63 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.64 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.65 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.66 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.67 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.68 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.69 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.70 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.71 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.72 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.73 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.74 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.75 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.76 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.77 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.78 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.79 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.80 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.81 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.82 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.83 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.84 报告期内本基金的评价策略和运作分析

4.4.85 报告期内本基金的评价策略和运作