

基金管理人:东吴基金管理有限公司  
托管人:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:二〇一三年三月二十六日

## § 1 重要提示及目录

本基金的基金管理人、董事会、监事会在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。年度报告书经三分之二以上独立董事签署。

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资产，但不保证基金一定盈利。

本基金投资于股票市场的风险较大，投资人购买基金时应充分考虑自身的风险承受能力，审慎决策，并自行承担投资风险。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书、基金合同和基金产品说明书。

本年度报告摘要披露自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金报告期自2012年8月13日起至2012年12月31止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

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

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

报告期末基金份额总额:652,671,994.29份

基金合同存续期间:不定期

## 2.2 基金产品说明

本基金将主要通过投资组合保险策略的运用，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力图实现基金的稳健增值。

1. 资产配置策略

本基金将把资产的大部分分配给保本资产与保本资产两大类资产，以追求保本资产与保本资产的长期稳定增长。同时，根据保本资产的收益情况，适当增加股票等风险资产的配置比例。

2. 债券投资策略

债券投资方面，对于本基金的保本资产部分，本基金主要投资对象为商业银行和银行间债券市场的债券。

本基金将长期坚持“低风险、低波动率”的投资风格，精选具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票作为投资对象，力争最大限度获取基金资产增值。

4. 权证投资策略

本基金权证投资将以下价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

5. 行业轮动定期存款收益(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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 东吴基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

姓名 吕晖 李芳菲

信息披露负责人 联系电话 021-50509888-8206 010-66060069

电子邮件 lvhui@scfund.com.cn lifangfei@china.com

客户服务电话 021-50509666/400-821-0588 95995

传真 021-50509888-8211 010-63201816

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 www.scfund.com.cn

基金年度报告备置地点 基金管理人及托管人办公处

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年8月13日(基金合同生效日)-2012年12月31日 2011年 2010年

本期已实现收益 6,939,365.27 - -

本期利润 8,690,398.11 - -

加权平均基金份额本期利润 0.0117 - -

本期基金份额净值增长率 1.20% - -

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供分配基金份额利润 0.0094 - -

期末基金资产净值 660,445,333.72 - -

期末基金份额净值 1.012 - -

3.2.1 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 份额净值增长率① 份额净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 准备基准收益率④ ①-③ ②-④

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

自基金合同生效日起至今 1.20% 0.05% 1.64% 0.00% -0.44% 0.05%

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，基金合同生效起至披露时点不满一年。按基金合同规定，本基金基金合同生效日起6个月内为试用期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，基金合同生效起至披露时点不满一年。按基金合同规定，本基金基金合同生效日起6个月内为试用期。

3.过去三年基金的定期份额变动情况

本基金自成立以来未发生赎回。

4. 管理人报告

4.1 基金管理人及其基本情况

东吴基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2003]82号批准设立的证券投资基金基金管理公司，于2004年9月正式成立，注册资本人民币1亿元，由东吴证券控股有限公司、上海兰生集团有限公司、江阴市华西企业集团有限公司共同发起设立。

东吴基金管理人以其人为本，市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点的经营理念，遵循“诚信、专业、创新、稳健”的核心价值观，树立了“做有价值的创造者、市场的革新者和企业的思想家”的远大理想。

东吴基金管理人以其为本，市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点的经营理念，遵循“诚信、专业、创新、稳健”的核心价值观，树立了“做有价值的创造者、市场的革新者和企业的思想家”的远大理想。

东吴基金管理人以其为本，市场为导向，