



东吴基金管理有限公司
Soochow Asset Management Co., Ltd.

地址：上海浦东新区源深路279号

邮编：200135

总机：021-50509888

传真：021-50509884

公司网址：www.scfund.com.cn

客服邮箱：service@scfund.com.cn

客服热线：400-821-0588

021-50509666

出版部门：东吴基金市场营销部

风险提示：

本刊所提供资讯仅供参考，本公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。在任何情况下本刊物中的信息或所表达的意见并不构成实际投资结果，也不构成任何对投资人的投资建议。投资有风险，敬请谨慎选择。

基金周报

2011年10月31日

总第331期

专业理财交给我们 美好生活还给自己

基金数据

- 一周净值
- 基金表现

东吴视点

- 基金经理手记：谨慎看反弹
- 市场综述：全球主要股指“涨”声一片

东吴动态

- 东吴动态
东吴基金旗下基金 2011 年第三季度报告
- 媒体报道
“东吴少帅”王少成：四季度股市筑底并出现行情概率偏大
东吴行业轮动发力领涨

常见问题

- 办理定期定投业务后，我如何了解目前的份额和每月的投资情况？
- 身份证号码已升级为 18 位，如何更新基金账户信息？
- 网上交易系统申购和赎回基金后如何进行“撤单”操作？

基金数据

○一周净值

基金名称	10月24日		10月25日		10月26日		10月27日		10月28日	
	单位净值	累计净值	单位净值	累计净值	单位净值	累计净值	单位净值	累计净值	单位净值	累计净值
东吴嘉禾	0.7289	2.4489	0.7453	2.4653	0.7549	2.4749	0.7532	2.4732	0.767	2.487
东吴双动力	1.1099	1.6899	1.1348	1.7148	1.1516	1.7316	1.148	1.728	1.1612	1.7412
东吴轮动	0.8466	0.9266	0.8743	0.9543	0.8793	0.9593	0.8803	0.9603	0.9113	0.9913
东吴优信 A	0.9509	0.9629	0.9516	0.9636	0.9542	0.9662	0.9519	0.9639	0.9545	0.9665
东吴优信 C	0.9424	0.9544	0.9431	0.9551	0.9457	0.9577	0.9435	0.9555	0.9461	0.9581
东吴策略	0.9053	0.9753	0.9236	0.9936	0.9332	1.0032	0.9295	0.9995	0.9515	1.0215
东吴新经济	0.951	0.951	0.967	0.967	0.986	0.986	0.983	0.983	1.005	1.005
东吴新创业	0.916	0.976	0.931	0.991	0.941	1.001	0.939	0.999	0.949	1.009
东吴新兴产业	0.746	0.746	0.766	0.766	0.775	0.775	0.773	0.773	0.789	0.789
东吴增利 A	-	-	-	-	-	-	-	-	1.007	1.007
东吴增利 C	-	-	-	-	-	-	-	-	1.006	1.006
东吴新产业	-	-	-	-	-	-	-	-	1.006	1.006

基金名称	10月23日		10月24日		10月25日		10月26日		10月27日		10月28日	
	7日年化收益率	每万份收益	7日年化收益率	每万份收益	7日年化收益率	每万份收益	7日年化收益率	每万份收益	7日年化收益率	每万份收益	7日年化收益率	每万份收益
东吴货币 A	2.898	1.4352	2.835	0.7862	3.176	0.8182	3.011	0.89	2.947	0.9274	3.076	0.9544
东吴货币 B	3.146	1.5667	3.083	0.8516	3.424	0.8826	3.26	0.9563	3.197	0.997	3.327	1.0231

基金数据

基金表现

基金名称	今年以来	最近一周	最近一月	最近三月	最近六月	最近一年	最近两年	最近三年	设立以来
	回报率(%)	回报率(%)	回报率(%)	回报率(%)	回报率(%)	回报率	年化回报率	年化回报率	总回报率(%)
东吴嘉禾	-15.99	6.56	0.17	-10.51	-7.51	-14.08	2.93	15.24	203.15
东吴双动力	-18.24	6.39	1.19	-10.65	-8.03	-17.39	4.54	10.95	70.39
东吴轮动	-21.81	10.02	-3.59	-17.21	-17.75	-26.96	0.28	14.49	-2.88
东吴优信 A	-9.22	0.55	2.27	-3.11	-5.35	-11.04	-2.79	-	-3.42
东吴优信 C	-9.41	0.55	2.26	-3.18	-5.51	-11.3	-3.14	-	-6.3
东吴策略	-21.43	5.85	-1.76	-13.47	-9.79	-21.66	0.19	-	1.86
东吴新经济	-12.68	6.35	1.52	-9.21	-6.25	-8.05	-	-	0.5
东吴货币 A	2.61	0.06	0.25	0.75	1.54	2.91	-	-	3.54
东吴货币 B	2.81	0.06	0.27	0.81	1.67	3.16	-	-	3.91
东吴新创业	-12.13	4.06	-1.25	-11.56	-4.91	-12.09	-	-	0.12
东吴新兴产业	-	7.49	-0.75	-14.24	-15.71	-	-	-	-21.1

数据来源：晨星基金网 cn.morningstar.com

基金简称	过去一周	过去一个月	过去三个月		过去六个月		今年以来		过去一年		过去两年(104周)		成立以来累计净值增长率(%)
	增长率(%)	增长率(%)	增长率(%)	排名	增长率(%)	排名	增长率(%)	排名	增长率(%)	排名	增长率(%)	排名	
东吴嘉禾	6.56%	1.39%	-9.49%	25	-8.52%	14	-15.99%	23	-15.01%	20	7.30%	10	207.92%
东吴双动力	6.39%	2.09%	-9.73%	138	-9.25%	66	-18.25%	147	-18.09%	123	11.64%	7	69.93%
东吴轮动	10.02%	-2.47%	-16.39%	243	-19.04%	233	-21.81%	187	-27.16%	202	0.68%	41	-2.86%
东吴优信 A	0.55%	2.17%	-2.83%	63	-5.60%	56	-9.22%	60	-10.94%	56	-5.25%	49	-3.42%
东吴优信 C	0.55%	2.16%	-2.90%	64	-5.77%	59	-9.41%	61	-11.20%	57	-5.94%	50	-6.30%
东吴策略	5.85%	-0.02%	-12.09%	52	-10.96%	38	-21.50%	45	-22.02%	42	1.92%	18	1.77%
东吴新经济	6.35%	2.87%	-9.30%	129	-6.69%	26	-12.68%	48	-8.39%	13	--	--	0.50%
东吴新创业	4.06%	-0.11%	-10.56%	167	-6.04%	19	-12.13%	44	-14.14%	63	--	--	0.20%
东吴新兴产业	7.49%	2.33%	-13.11%	82	-16.86%	--	-21.10%	--	--	--	--	--	-21.10%
东吴增利 A	0.30%	0.80%	0.70%	--	--	--	0.70%	--	--	--	--	--	0.70%
东吴增利 C	0.30%	0.80%	0.60%	--	--	--	0.60%	--	--	--	--	--	0.60%
东吴新产业	1.41%	0.60%	--	--	--	--	0.60%	--	--	--	--	--	0.60%

数据来源：中国银河证券研究所基金研究中心

东吴视点

○ 基金经理手记

谨慎看反弹

温总理在天津调研时首次明确政策微调，其实我们都可以预想到微调的范围和力度，不会太大，更不会太广，但是这番表态对于市场情绪起了重要的稳定作用，前段时间可谓市场最悲观的预期，外围的不确定性，通胀高位，经济下滑预期强烈，融资压力巨大，都对市场造成了很大的心理压力，情绪一旦稳定，发现情况有所改观，欧债危机初露曙光，通胀已处下降通道，经济情况虽然严峻，但仍可控制，任何事物都有两面性，观点的转变来自于心理和预期，目前的市场具备一轮反弹的基础，无论从信息的时间窗口，还是市场的整体估值，还是热点板块的活跃程度来看。

后市最关心的就是扩容的节奏，其实对于市场的基本面，经过了二三季度的不确定性，投资者基本已经有所预期，最乐观的预期也不足以支撑市场大幅反弹，相反，对于新股的发行节奏，还是存在很大的恐慌，目前的反弹随时可能在公布大规模的 IPO 后终止。我们整体还是保持谨慎的态度。

○ 市场综述

全球主要股指“涨”声一片

沪深两市本周在底部大幅反弹，市场交投热情有所增加。上证综指收报 2473.41 点，涨 156.14 点，涨幅 6.74%；深成指收报 10561.99 点，涨 864.78 点，涨幅 8.92%，中小板及创业板都大幅反弹，尤其是创业板涨幅达 9.19%。

10月24日周一 A 股早盘高开后震荡走低，午后大幅攀升，结束四个交易日连续下跌的态势，个股普涨，金融服务与信息服务板块领跑，券商股攻势强劲。周二 A 股早盘低开高走，午后大幅攀升，沪深指数收盘均站上 10 日均线，连续两日大涨，个股均表现活跃，信息设备板块走势强劲，有色金属及房地产这类强周期股票开始领涨。周三 A 股早盘低开高走，午后冲高回落。上证综指收盘站上 30 日均线，信息设备及信息服务板块连续成为近日焦点，涨幅居首，房地产板块继续走强。周四上证综指高开后，全天围绕 2440 点附近震荡，收盘微涨，个股仍然处于活跃状态。由于受到国务院决定明年起在上海试点增值税利好消息影响，公用事业、交通运输板块走强。10月28日周五上证综指受外盘普涨影响大幅高开，全天保持高位震荡，采掘、房地产及有色金属权重板块领涨。

国际票市仍然处于反弹通道中，欧美股市强于亚太地区。美国标普 500 指数本周涨幅 3.78%，英国富时 100、法国 CAC40 及德国 DAX 指数分别上涨了 3.89%、5.59%及 6.28%。亚太地区主要市场本周反弹力度也比较强劲，包括

日本、韩国、澳大利亚及印度主要股指都大幅反弹。香港恒指前期受 A 股的牵制一直较弱，本周在 A 股的提振之下大涨 9.23%。在美元的持续下挫中，国际大宗商品市场反弹继续，CRB 商品指数本周涨 3.74%，除了农产品外，金属、能化、工业品板块的品种都大幅上攻。本周美国 NYMEX 原油期货主力合约本周上涨 6.97%至 93.49 美元/桶；COMEX 黄金期货主力 12 月合约涨 6.56%至 1743.5 美元/盎司。

10 月 24 日至 10 月 30 日这段时间内，以下消息值得关注：

1、 国家统计局 10 月 24 日在其网站公布 10 月 11 日至 20 日 50 个城市主要食品平均价格变动情况显示，在监测的 29 种主要食品价格中有 18 种环比下滑。

2、 希腊首都雅典 10 月 25 日举行 24 小时罢工，再次抗议政府削减公共部门岗位和薪资的计划。

3、 截至 10 月 28 日，已公布三季报的 1910 家公司中，1736 家实现盈利，占比 90.89%。可比的 1901 家公司总利润较去年同期总额增加了 19.9%，增幅显著。

4、 广东省财政厅 10 月 27 日晚间公布，计划在今年 11 月底前完成 69 亿债券发行工作。这意味着广东省成为地方债自主发行试点启动后，首个划定地方自行发债具体时间表的地区。

5、 国内航空公司已经收到通知，自 11 月 1 日零时起，国内航空煤油出厂价将从 10 月份的 7501 元/吨下调至 7277 元/吨，航空公司从中航油采购航油的综合成本亦从 10 月份的 7503 元/吨下调至 7279 元/吨，下调幅度 224 元/吨。

6、 新疆自治区地税局有关负责人上周透露，新疆将根据国税总局要求，继续暂按 5%的税率征收原油天然气资源税。



东吴动态

○ 东吴动态

东吴基金旗下基金 2011 年第三季度报告

东吴嘉禾基金 2011 年第三季度报告

东吴双动力基金 2011 年第三季度报告

东吴轮动基金 2011 年第三季度报告

东吴优信基金 2011 年第三季度报告

东吴策略基金 2011 年第三季度报告

东吴新经济基金 2011 年第三季度报告

东吴货币基金 2011 年第三季度报告

东吴新创业基金 2011 年第三季度报告

东吴中证新兴产业基金 2011 年第三季度报告

东吴增利基金 2011 年第三季度报告

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1、客户服务热线：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

2、公司网址：www.scfund.com.cn

○ 媒体报道

东吴基金总裁徐建平：基金业最大问题是治理机制

新浪财经 2011-10-24

新浪财经讯 新浪金麒麟论坛今日在北京柏悦酒店召开，本次论坛主题是：中国经济的全球机会。东吴基金管理有限公司总裁徐建平(微博)表示，困扰基金市场、行业发展的最突出的问题还是人才问题，就是治理机制问题。

徐建平：总体上来讲我觉得基金行业确实面临一些困难，但是也不用那么悲观，基金业现在确实面临一些困难，但是这些困难可能跟整个市场的发展阶段，跟整个市场的周期，当然也跟我们自身的行业发展阶段有关。

应该说从比较长的时间来看，困扰这个市场、行业发展的，我觉得最突出的问题还是人才问题，就是治理机制问题。为什么这么说呢？应该说最近一段时间相对有所好转，但是整体上来讲基金业人才的流动和流失还是过于频繁，这个对于整个行业的发展也是不利的。这中间我觉得最本质的问题，实际上是一个公司治理问题，就是说我们这个行业有两大特点。

第一大特点，它是一个双重的委托代理机制，第二个是人才的重要性非常突出，恰恰体现了人才的重要性。但是我们在治理机制当中对于人才长效制度的安排，相应的比较缺失一些，所以可能会造成这么一些问题。所以我觉得应该要建立一种真正以人为本的，以人为中心的治理机制，这可能有利于公司或者行业的长期健康发展。

东吴行业轮动发力领涨

证券时报 2011-10-31

截至10月28日，上证综指单周涨幅达5.77%，东吴行业轮动以10.02%的单周涨幅位居所有开放式标准股票型基金首位。从新近披露的三季报来看，资源类个股的重配，促进了该基金的大幅上涨。三季度东吴行业轮动加仓3.65个点，而资源类个股比重从26.52%加至29.82%。对于四季度市场走势，东吴行业轮动基金经理任壮表示，中长期来看结构性机会将逐步出现。未来投资策略上，任壮坚持认为，全球经济复苏下的流动性过剩，把握货币调控的节奏与时点依然是影响当前市场的主要投资逻辑。在投资品种上，继续坚持“能源+资源+金融”的方向，关注煤炭、有色、金融等大资源型品种，以及新能源、新材料等新兴产业的投资机会。

常见问题

Q：办理定期定投业务后，我如何了解目前的份额和每月的投资情况？

A：投资者办理定期定投业务后，可以通过以下方式查询基金交易明细及基金份额信息：

- (1) 登陆东吴基金网站 www.scfund.com.cn 的“帐户查询系统”及拨打客户服务热线 021-50509666 进行查询
- (2) 东吴基金于每季度结束后 15 个工作日内邮寄交易明细对帐单，投资者收到后可以查询，或者通过“帐户查询系统”订阅电子对帐单，以电子邮件方式发送至投资者电子邮箱。
- (3) 投资者也可以通过代销银行机构查询基金信息。

Q：身份证号码已升级为 18 位，如何更新基金账户信息？

A：若 15 位身份证有效期已到，请投资者抓紧办理新一代身份证的信息更新，确保投资者资料的真实，有效性。

东吴基金直销客户更新身份证号码，需在东吴基金网站下载《开放式基金账户信息调整表》填写完毕后附上身份证复印件，邮寄至东吴基金客户中心，我们收到后会及时办理更新工作；东吴基金代销机构客户更新身份证号码，需带好身份证等相关证件至代销机构办理。

Q：网上交易系统申购和赎回基金后如何进行“撤单”操作？

A：投资者在网上交易系统申购和赎回基金后，可于当日 15：00 点之前进行撤单操作。在网上交易系统的“网上直销”栏目下方，点击“当日申请”标记，即可查询到当日申购和赎回基金的交易记录，点击当日交易记录左下方的“撤单”标记，即可撤单成功。



○ 东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金

基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金经理	唐祝益		
比较基准	65%* (60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数) +35%*中信全债指数		
投资范围	法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具。其中 30-95%的基金资产投资股票，投资债券资产不高于基金资产的 60%，现金类资产最低比例为 5%。		
投资目标	分享中国经济的成长，中低风险水平获得中长期较高收益		
选股方式	三重比较优势选股模型		
操作策略	周期持有、波段操作		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴价值成长双动力股票型证券投资基金

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
基金经理	王少成		
投资理念	把握价值成长动力、风格动态配置、追求超额收益		
比较基准	75%*新华富时 A600 指数+25%*中信标普全债指数		
投资范围	股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，现金以及到期日在一年以内债券等短期金融工具资产比例合计不低于基金资产净值的 5%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。		
风险收益特征	进行主动投资的股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、收益较高的基金产品。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴行业轮动股票型证券投资基金

基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	华夏银行股份有限公司
基金经理	任壮		
投资对象	法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具。其中股票投资比例为 60%-95%，债券投资比例为 0-35%，现金类资产最低为 5%，权证投资比例 0-3%。		
投资目标	通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。		
选股方式	东吴行业轮动识别模型 及 三重优势标准选股		
比较基准	75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数		
操作策略	行业轮动		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴优信稳健债券投资基金

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
基金经理	徐嵩 韦勇		
投资对象	主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种，债券投资比例为 80%-95%，股票投资比例为 0-20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。		
投资目标	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，通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。		
比较基准	中信标普全债指数		
操作策略	主要投资于高信用级别、投资价值高的债券资产，属证券投资基金中的低风险品种，长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

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
基金经理	朱昆鹏		
投资对象	投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。		
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。		
比较基准	65%*沪深 300 指数+35%*中信标普全债指数。		
操作策略	采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。在股票投资策略上，本基金根据上市公司成长特征，将上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴新经济股票型证券投资基金

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
基金经理	吴圣涛		
投资对象	股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，现金以及到期日在一年以内债券等短期金融工具资产比例合计不低于基金资产净值的 5%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。		
投资目标	通过投资于引领经济发展未来方向的新兴产业的上市公司，享受新经济发展带来的高成长和高收益。重点投资其中具有成长优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。		
比较基准	75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数		
操作策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，根据自上而下对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，在遵循前述本基金资产配置总体比例限制范围内，确定基金资产在股票、债券、现金和其他金融工具上的具体投资比例。根据科学技术和产业的发展趋势对与新经济相关创新技术、典型产业进行识别。随后自下而上地精选代表新经济的典型上市公司和与新经济密切相关的上市公司，针对两类公司的不同特征，充分考虑公司的成长性，运用东吴基金企业竞争优势评价体系进行评价，构建股票池。投资其中具有成长优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。 本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴货币市场证券投资基金

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
基金经理	韦勇		
投资对象	现金；通知存款；短期融资券；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。		
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理及量化分析，为投资者提供较稳定的收益。		
比较基准	同期七天通知存款利率（税后）		
操作策略	采取积极的投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测；在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例；在此框架之下，通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴新创业股票型证券投资基金

基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金经理	吴圣涛、王少成		
投资对象	股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金为股票型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于创业型股票的比例不低于股票资产的 80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资的创业型股票包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。		
投资目标	主要投资于市场中的创业型股票，包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。通过精选具有合理价值的高成长创业型股票，追求超越市场的收益。		
比较基准	$(\text{中信标普 200 指数} \times 50\% + \text{中信标普小盘指数} \times 50\%) \times 75\% + \text{中信标普全债指数} \times 25\%$		
操作策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。运用本公司自行开发的东吴 GARP 策略选股模型，精选具有成长优势与估值优势的创业型上市公司股票。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、长江证券、安信证券、国元证券、渤海证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴中证新兴产业指数型证券投资基金

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
基金经理	王少成		
投资对象	本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，中证新兴产业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在 10 个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。		
投资目标	本基金采用指数化投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。		
比较基准	基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率 +5%*银行同业存款利率		
操作策略	本基金通过采用指数化投资策略，选择中证新兴产业指数作为跟踪基准，按照指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，为投资者获取新兴产业高速成长所带来的投资收益。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、邮政储蓄银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、湘财证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、东方证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴增利债券型证券投资基金

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
基金经理	韦勇		
投资对象	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。		
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过主动式管理及量化分析追求稳健的投资收益。		
比较基准	中国债券综合全价指数。		
投资策略	本基金在严格控制风险的基础上，坚持稳健配置策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、深发展银行、民生银行、华夏银行、平安银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、长江证券、安信证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		



○ 东吴新产业精选股票型证券投资基金

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
基金经理	任壮		
投资对象	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。		
投资目标	本基金为股票型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。		
比较基准	75%*中证新兴产业指数 + 25%*中国债券综合全价指数		
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。		
销售机构	工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、民生银行、华夏银行、宁波银行、温州银行、烟台银行、天相投顾、国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、长江证券、安信证券、湘财证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、信达证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、国联证券、平安证券、华安证券、财富证券、东海证券、中银国际、恒泰证券、宏源证券、齐鲁证券、金元证券、中航证券、广发华福证券、五矿证券、中投证券、天源证券、华宝证券、爱建证券、厦门证券、东吴基金管理有限公司直销中心		