



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

2012年10月8日

总第376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

- 也看反弹
- A股超跌反弹

东吴动态

- 东吴基金理财千家万户行走入华师大
- 东吴基金关于旗下东吴动力基金参加中国农业银行延长网上银行代理销售开放式基金申购费率五折优惠活动的公告
- 东吴货币 2012年中秋、国庆暂停大额申购和转换转入业务的公告

投资者教育

- 资产配置：投资理财必修课

常见问题

- 东吴基金直销柜台客户如何登陆网上交易系统？
- 通过银联划款手续费是多少？
- 东吴基金网上交易是否可以定投？

基金数据

○一周净值

基金名称	9月24日		9月25日		9月26日		9月27日		9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	0.6635	2.3835	0.6631	2.3831	0.6551	2.3751	0.6670	2.3870	0.6762	2.3962
东吴双动力	1.0885	1.6685	1.0888	1.6688	1.0775	1.6575	1.0991	1.6791	1.1154	1.6954
东吴轮动	0.6714	0.7514	0.6584	0.7384	0.6706	0.7506	0.6479	0.7279	0.6528	0.7328
东吴优信 A	1.0170	1.0290	1.0179	1.0299	1.0191	1.0311	1.0197	1.0317	1.0203	1.0323
东吴优信 C	1.0050	1.0170	1.0060	1.0180	1.0071	1.0191	1.0076	1.0196	1.0082	1.0202
东吴策略	0.8045	0.8745	0.8019	0.8719	0.7919	0.8619	0.8060	0.8760	0.8161	0.8861
东吴新经济	0.8510	0.8510	0.8500	0.8500	0.8430	0.8430	0.8650	0.8650	0.8770	0.8770
东吴新创业	0.8730	0.9330	0.8730	0.9330	0.8600	0.9200	0.8740	0.9340	0.8870	0.9470
东吴新兴产业	0.6320	0.6320	0.6280	0.6280	0.6170	0.6170	0.6290	0.6290	0.6400	0.6400
东吴增利 A	1.0110	1.0510	1.0120	1.0520	1.0150	1.0550	1.0150	1.0550	1.0160	1.0560
东吴增利 C	1.0060	1.0460	1.0060	1.0460	1.0090	1.049	1.0100	1.0500	1.0100	1.0500
东吴新产业	0.8900	0.8900	0.8890	0.8890	0.8780	0.8780	0.9000	0.9000	0.9120	0.9120
东吴 100	0.8200	0.8200	0.8170	0.8170	0.8060	0.8060	0.8320	0.8320	0.8490	0.8490
东吴保本	-	-	-	-	-	-	-	-	1.0000	1.0000

注：东吴保本尚在封闭期内，每周五公告一次净值。

基金名称	9月23日		9月24日		9月25日		9月26日		9月27日		9月28日	
	万份收益	7日年化收益率	万份收益	7日年化收益率	万份收益	7日年化收益率	万份收益	7日年化收益率	万份收益	7日年化收益率	万份收益	7日年化收益率
东吴货币 A	1.2188	4.456%	0.5357	4.473%	4.8120	4.302%	0.6435	4.377%	0.6551	4.485%	0.4700	4.441%
东吴货币 B	1.3500	4.698%	0.5948	4.712%	4.8692	4.537%	0.6984	4.606%	0.7106	4.712%	0.5073	4.657%

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	-2.56	2.56	1.03	-3.81	-1.69	-11.69	-10.08	0.18	167.26
东吴双动力	5.59	3.39	3.34	1.58	2.11	-2.81	-10.46	5.07	63.66
东吴轮动	-4.23	7.28	6.97	-2.79	-12.28	-25.91	-22.92	-6.85	-25.36
东吴优信 A	6.56	0.37	0.28	0.12	5.94	9.32	-1.23	0.34	3.24
东吴优信 C	6.31	0.36	0.24	0.01	5.75	8.97	-1.54	-0.02	-0.15
东吴策略	-3.19	2.2	0.36	-4.04	-4.29	-15.74	-18.02	-1.92	-12.63
东吴新经济	-7.39	4.65	1.62	-3.84	-7.1	-11.41	-9	-	-12.3
东吴货币 A	2.5	0.08	0.26	0.63	1.54	3.38	3.09	-	6.79
东吴货币 B	2.68	0.09	0.28	0.69	1.66	3.63	3.34	-	7.4
东吴新创业	6.48	2.19	0.57	2.78	3.02	-7.7	-6.87	-	-6.42
东吴新兴产业	-4.9	2.07	0.16	-6.3	-7.51	-19.5	-	-	-36
东吴增利 A	4.03	0.49	-0.1	-0.29	2.62	5.8	-	-	5.59
东吴增利 C	3.64	0.4	-0.2	-0.49	2.22	5.19	-	-	4.98
东吴新产业	-3.7	3.64	3.64	-4.1	-3.59	-8.8	-	-	-8.8
东吴 100	-	4.69	2.29	-7.52	-15.1	-	-	-	-15.1

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	2.56%	3.00%	-4.76%	24	-1.13%	21	-2.56%	30	-10.61%	25	-19.30%	19	171.47%
东吴双动力	3.39%	4.65%	0.49%	15	2.89%	78	5.59%	47	-1.93%	56	-20.59%	120	63.23%
东吴轮动	7.28%	10.60%	-4.47%	166	-9.73%	281	-4.23%	223	-25.05%	257	-41.27%	207	-25.35%
东吴优信 A	0.37%	0.27%	0.08%	16	5.44%	11	6.56%	24	9.22%	28	-2.59%	43	3.24%
东吴优信 C	0.36%	0.24%	-0.03%	20	5.25%	15	6.31%	25	8.87%	31	-3.20%	45	-0.15%
东吴策略	2.20%	2.23%	-5.28%	45	-3.91%	47	-3.19%	41	-14.25%	50	-32.99%	47	-12.71%
东吴新经济	4.65%	1.86%	-5.50%	214	-6.10%	253	-7.39%	260	-10.24%	182	-17.34%	77	-12.30%
东吴新创业	2.19%	1.95%	1.26%	11	4.23%	62	6.48%	33	-6.63%	120	-14.63%	53	-6.34%
东吴新兴产业	2.07%	1.91%	-7.38%	94	-5.74%	69	-4.90%	106	-16.99%	91	--	--	-36.00%
东吴增利 A	0.49%	0.00%	-0.20%	25	2.52%	57	4.03%	58	5.70%	--	--	--	5.59%
东吴增利 C	0.40%	-0.20%	-0.39%	37	2.22%	69	3.64%	68	5.19%	--	--	--	4.98%
东吴新产业	3.64%	4.11%	-5.59%	219	-3.29%	210	-3.70%	213	-8.80%	--	--	--	-8.80%
东吴 100	4.69%	4.43%	-8.51%	23	-15.18%	--	-15.10%	--	--	--	--	--	-15.10%
东吴保本	0.10%	0.10%	--	--	--	--	-0.00%	--	--	--	--	--	-0.00%

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

也看反弹

长假前终于反弹，且成因复杂，破位 2000 点短期应该是个具有标志意义的情况，从整个市场运行的环境来看，目前最关键的因素是经济，最核心的因素却不仅仅是经济决定的，在转型的大背景下，不能仅仅从经济增速的缓急来理解市场应该具有的合理走势。A 股跌势不休，目前的市场其实已经在做出取舍，做出对于未来的判断，有观点认为，市场跌无可跌，因为市盈率，因为经济底部等等。我觉得应辩证来看，确实，从服务经济，服务政治的角度，在目前的点位，股市确实不太像话，太不像话，但是沉痾难治，既然决定了要根治，就必须付出相应的代价，经济的转型不仅仅是选择新方向，更要涅槃，市场的差异化还会越来越明显，特别是在估值结构上，跟随战略转型的变化，行业差异会加大。股票的选择在目前的阶段自上而下的大逻辑出现分歧，更为适合的是根据战略布点自下而上精选细分行业中龙头品种，特别是技术创新和消费升级中的新龙头。

短期内，市场的氛围会比较和谐，各方面的导向，数据等配套也会支持市场的反弹，但是人气品种的涣散基本也预示着反弹的高度，关注非银行金融的稳健配置价值，适当仓位参与反弹，谨防低点的确认。

○ 市场综述

A 股超跌反弹

A 股上周超跌反弹。上周上证综指收盘于 2086.17 点，涨 59.48 点，全周涨幅 2.93%；深证成指收盘于 8679.22 点，涨 477.69 点，全周涨幅 5.82%；中小板指报 4264.83 点，涨 128.35 点，涨幅 3.10%；创业板报 689.64 点，跌 1.50 点，跌幅 0.22%。

9 月 24 日周一两市早盘双双低开，股指低位震荡，沪指探低至 2005.26 点，11 点后股指上扬，午后保持窄幅震荡，最终沪深两市以红盘收涨。9 月 25 日周二沪深两市低开，上证指数开盘报 2028.63 点，跌 0.22%，成交额为 1.67 亿元；深成指开盘报 8296.95 点，跌 0.17%，成交额为 2.10 亿元。其后股指在 5 日均线下方窄幅震荡，沪指收阳十字星。9 月 26 日周三两市早盘涨跌不一，股指在受消息刺激的核电、券商、内贸、军工船舶等板块带动下一度上涨，但因周边日经 225、港股大跌，股指震荡回落整理，煤炭、金融等板块一度震荡回升提振股指，但交投缩减严重，股指震荡下探整理，午后，煤炭、金融等下行拖累沪指下行，跌破 2000 点，创出 2009 年 3 月以来的新低。盘面无一板块上涨。9 月 27 日午后，原本“奄奄一息”的 A 股突然“起死回生”，金融、资源两大板块如同两个车轮，带领 A 股

滚滚前进。截至13:50,沪指放量大涨冲上2060点上方,涨幅近3%。深证成指涨幅超过3%,创业板指、中小板指也都出现放量大涨,大有吞没昨天阴线的趋势。9月28日周五两市早盘未能延续昨日涨势,双双低开,虽然开盘金融指标股小幅回调,但其后股指震荡上扬,沪指接连站上20、30日均线。午后铁路运输股开始活跃领涨,股指一度震荡整理,2点后股指再度震荡上扬,板块全面上涨。

国际股票市场方面,上周全周道指下跌约0.97%,纳指跌2.01%,标普500指数下跌约1.56%。上周欧洲主要股指大幅下跌,英国富时100指数上周下跌2.1%,法国CAC 40指数上周累计下跌5.02%,德国DAX 30指数周累计下跌了2.56%。亚太地区股票市场方面,各主要股指则涨跌不一,日经225指数上周下跌逾2.72%。香港恒指上周累计上涨1.1%,澳大利亚股票市场上周上涨约0.45%,而韩国股市上周则下跌约0.03%。

大宗商品方面,上周五美国12月份轻质原油报收于每桶92.22美元,在上周的交易中,纽约原油期货价格下跌了1.07%。12月份交割的北海布伦特原油期货报收于每桶111.42美元,在上周的交易中,北海布伦特原油期货价格上涨逾0.89%。纽约黄金期货价格报收于1776美元每盎司,全周下跌了约0.11%。

9月24日至9月30日这段时间内,以下消息值得关注:

1、25日,中国证监会副主席姜洋在第三届中国西部金融论坛上表示,证监会将深入贯彻落实西部大开发“十二五”规划的要求,从国家战略高度出发,更加积极主动采取有力措施,支持西部地区大力发展资本市场。

2、继25日周二单日2900亿元逆回购后,27日央行再度开闸,实施了14天与28天两个期限共计1800亿元的逆回购。央行在一周内累计向市场注资4700亿元,超过一次准备金率下调所释放的流动性。

3、国务院总理温家宝26日主持召开国务院常务会议,研究加快发展服务业。会议指出,发展服务业是我国产业结构优化升级的战略重点。“十二五”时期,要着力提高服务业比重,提高服务业水平,提高公共服务质量和效率,提高服务业吸纳就业能力。

4、国家统计局27日发布的数据显示,今年1~8月,全国规模以上工业企业实现利润30597亿元,同比下降3.1%。8月当月实现利润3812亿元,同比下降6.2%。

东吴动态

东吴基金理财千家万户行走入华师大

上海证券报

9月27日，东吴基金东吴基金“理财千家万户行”系列活动走进华东师范大学，为广大MBA学生及客户举办一场别开生面的投资理财交流会，东吴基金首席理财师钱巍先生为大家讲解了理财知识及当前理财形势。

东吴基金首席理财师钱巍指出，每位投资者在投资基金前，必须对证券市场和基金投资的风险有正确充分的认识以后再制定适合自己的基金理财计划。钱巍先生针对“基金的分类”、“不同风险基金与适合人群”、“公募基金与价值投资”等几大热点问题，与在场观众进行了比较深入的沟通，同时结合一些投资实例，让大家更加形象地、理性地认识基金投资。

此次走入高校活动为投资者提供了一次全面了解投资理财市场的机会，力争为大家的投资保驾护航。部分现场朋友在报告会后与钱巍先生进一步沟通投资理财知识。

自今年年初以来，东吴基金“理财千家乡行”系列活动，先后走入社区、企业、会所等，普及投资理财基础知识，东吴基金投资理财之旅形成了自身特色。

东吴动态

- 东吴基金关于旗下东吴动力基金参加中国农业银行延长网上银行代理销售开放式基金申购费率五折优惠活动的公告
- 东吴货币 2012 年中秋、国庆暂停大额申购和转换转入业务的公告

(详情请查看东吴基金官方网站 www.scfund.com.cn 或拨打公司客服热线 400-821-0588)

投资者教育

资产配置：投资理财必修课

很多人以为资产配置是有钱人的事，离老百姓的日常生活很远，其实不然。美国投资大师布林森研究指出：“投资组合的报酬有93.6%决定于投资者如何进行资产配置”。对于个人和家庭来说，资产配置都是理财的必修课。有效的资产配置能够帮助投资者规避投资风险，获得良好的收益，顺利实现理财目标。

什么是资产配置？简而言之，资产配置是指投资者把资产按一定比例分配在不同种类的资产上，如股票、债券、房地产等，在获取理想回报之余，把风险减至最低。一般来说，资产的类别有两种：一是实物资产，如房产、黄金、艺术品等；二是金融资产，如股票、基金、债券、银行存款等。

不同类别的资产各有特点，其收益率与风险一般呈现正相关性。以基金为例，股票型基金风格进取，预期收益高，风险也较大；混合型基金既买债券又买股票，总体风险收益特征适中；债券型基金兼具一定收益性和稳健性，风险和收益预期低于股票型基金和混合型基金；而货币市场基金流动性和安全性最高，但是收益性略低。投资者在投资之前，必须将这些基金品种加以区别，并根据其风险收益特征进行匹配投资。

如何进行资产配置呢？根据国外经验，最简单有效的资产配置原则是“投资100法则”，用100减去投资者的年龄就是适合投资高风险理财产品的比例。而偏保守的投资者可以将“100法则”改为“80法则”，即用80减去年龄得到应投资高风险理财产品的比例。

以基金投资为例，25岁刚入职场的年轻人，可以将闲置资产中的75%投入股票型基金或混合型基金中，剩余的25%投资在债券型基金、货币基金等稳健型品种，争取实现资产快速增值。而对于50岁的中年人来说，偏股型基金的投资比例就应降到50%，稳健类资产的投资比例相应上升。简而言之，家庭理财随年龄的增长应逐渐降低股票类资产的比例而增加固定收益类资产的比例。

有句谚语说“不要将鸡蛋放在一个篮子里”。在当前通胀高企和市场震荡的大背景下，把所有资产全都储蓄显然不是上佳之策，资产配置必不可少。在此，提醒投资者在资产配置时有必要注意两个原则：

第一，进行资产配置时，要全面考虑家庭的长期、远期和近期需求，不仅风险水平的配置要高低有别，而且投资期限的配置要长短搭配好，做好流动性、收益性和安全性的综合管理。

第二，定期检查，适时调整。随着家庭财务状况的变化、理财目标的完成与修改及经济周期的变动，投资者也应该定期检查自己的投资状况，审视投资组合的收益情况，及时进行动态调整。



常见问题

Q：东吴基金直销柜台客户如何登陆网上交易系统？

A：柜台交易的直销客户，请使用基金账号登陆，登陆密码为开户身份证件号码后8位，交易密码与柜台交易密码一致，请登陆后修改密码。

Q：通过银联划款手续费用是多少？

A：划款手续是外扣法，即如果您申购1000-5000元的基金，账户中必须有 $x+2$ 元；如果您申购5001-50000元的基金，账户中必须有 $x+3$ 元；如果您申购50001-100000元的基金，帐户内必须有 $x+5$ 元；如果您申购100001元的基金，账户中必须有 $x+8$ 元。具体划款手续费率请参见银联网站或东吴基金网站“交易费率”部分。

Q：东吴基金网上交易是否可以定投？

A：本公司网上交易系统暂无基金定投业务，开通直销定投时我们会发布公告，请您留意东吴基金网站首页公告。目前您可以选择通过代销机构办理定投业务。



○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、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、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、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	丁蕙		
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、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	唐祝益		
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、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	邹国英		
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、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、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	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 周健		
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、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、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		



○ 东吴新兴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、刘元海		
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、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		



○ 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

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	唐祝益、刘元海		
投资对象	本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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	本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。		
比较基准	95%*深证 100 价格指数收益率 +5%*商业银行活期存款利率（税后）		
投资策略	本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证 100 价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。		
销售机构	本基金通过场外、场内两种方式公开发售，场外发售机构包括本公司直销中心和代销机构，其中直销机构是指东吴基金管理有限公司直销中心，代销机构是指中国建设银行、中信银行、中国工商银行、中国农业银行、交通银行、华夏银行、招商银行、民生银行、深发展银行、宁波银行、平安银行、温州银行、东吴证券、海通证券、中国银河证券、申银万国证券、中信建投证券、广发证券、国信证券、湘财证券、国联证券、国泰君安证券、金元证券、安信证券、华泰证券、中航证券、财富证券、中信万通证券、光大证券、渤海证券、中银国际证券、招商证券、齐鲁证券、恒泰证券、南京证券、东海证券、中投证券、爱建证券、天相投顾、华宝证券、平安证券、长江证券、华福证券、宏源证券、信达证券、华安证券、上海证券、广州证券、厦门证券、中信证券、五矿证券、天源证券、财富里昂证券等。场内发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位。		