

东吴 基金

基金周报

2012年12月10日

总第385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

- 反弹两步走
- A股大举反弹

东吴动态

- 东吴优信业绩居前
- 东吴基金“理财千家万户行”走进陆家嘴图书馆
- 东吴货币市场基金收益支付公告
- 东吴行业轮动更新招募说明书摘要
- 东吴行业轮动更新招募说明书

反洗钱专栏

- 警惕网络洗钱陷阱 增强反洗钱意识

常见问题

- 网上交易遇到出错提示，该如何处理？
- 什么是基金转换？
- 代销机构买的基金可以通过直销交易吗？



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。

基金数据

○ 一周净值

基金名称	12月3日		12月4日		12月5日		12月6日		12月7日	
	单位净值	累计净值								
东吴嘉禾	0.6219	2.3419	0.6266	2.3466	0.6439	2.3639	0.6416	2.3616	0.6472	2.3672
东吴双动力	1.0023	1.5823	1.0110	1.5910	1.0370	1.6170	1.0337	1.6137	1.0450	1.6250
东吴轮动	0.5782	0.6582	0.5876	0.6676	0.6146	0.6946	0.6119	0.6919	0.6251	0.7051
东吴优信 A	1.0288	1.0408	1.0289	1.0409	1.0289	1.0409	1.0292	1.0412	1.0292	1.0412
东吴优信 C	1.0159	1.0279	1.0160	1.0280	1.0160	1.0280	1.0162	1.0282	1.0162	1.0282
东吴策略	0.7323	0.8023	0.7360	0.8060	0.7542	0.8242	0.7515	0.8215	0.7649	0.8349
东吴新经济	0.8260	0.8260	0.8320	0.8320	0.8580	0.8580	0.8560	0.8560	0.8660	0.8660
东吴新创业	0.7570	0.8170	0.7650	0.8250	0.7880	0.8480	0.7840	0.8440	0.7960	0.8560
东吴新兴产业	0.5550	0.5550	0.5630	0.5630	0.5820	0.5820	0.5800	0.5800	0.5920	0.5920
东吴增利 A	1.0190	1.0590	1.0180	1.0580	1.0180	1.0580	1.0180	1.0580	1.0180	1.0580
东吴增利 C	1.0120	1.0520	1.0110	1.0510	1.0120	1.0520	1.0120	1.0520	1.0110	1.0510
东吴新产业	0.7630	0.7630	0.7760	0.7760	0.8060	0.8060	0.8060	0.8060	0.8180	0.8180
东吴 100	0.7560	0.7560	0.7650	0.7650	0.7920	0.7920	0.7900	0.7900	0.8020	0.8020
东吴保本	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080

基金名称	12月2日		12月3日		12月4日		12月5日		12月6日		12月7日	
	万份收益	7日年化收益率										
东吴货币 A	0.7706	2.192%	0.8099	1.944%	0.6359	1.986%	0.6161	2.044%	1.3543	2.513%	0.6556	2.557%
东吴货币 B	0.9017	2.428%	0.8756	2.179%	0.7110	2.229%	0.6876	2.291%	1.4227	2.765%	0.7228	2.813%

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	-6.74	3.54	-2.01	-5.5	-6.86	-12.35	-15.73	-6.56	155.8
东吴双动力	-1.08	2.26	-5.04	-5.94	-6.78	-8.96	-14.79	-3.87	53.33
东吴轮动	-14.51	5.59	-5.39	-8.57	-21.14	-22.9	-26.81	-14.6	-33.38
东吴优信 A	7.49	0.03	0.47	1.09	1.68	7.51	-0.82	0.35	4.14
东吴优信 C	7.15	0.01	0.42	0.98	1.48	7.15	-1.13	0	0.64
东吴策略	-9.26	3.3	-5.35	-7.41	-10.09	-16.59	-21.47	-9.19	-18.12
东吴新经济	-8.55	4.34	-0.8	-2.7	-6.38	-12.35	-13.22	-	-13.4
东吴货币 A	2.95	0.05	0.19	0.64	1.27	3.19	3.16	-	7.26
东吴货币 B	3.18	0.05	0.21	0.7	1.39	3.44	3.41	-	7.93
东吴新创业	-4.44	2.71	-8.08	-11.95	-9.55	-14.04	-14.54	-	-16.02
东吴新兴产业	-12.04	4.04	-6.18	-10.71	-16.97	-20.96	-	-	-40.8
东吴增利 A	4.24	0	0.39	0.3	0.47	4.24	-	-	5.8
东吴增利 C	3.74	-0.1	0.3	0.1	0.08	3.74	-	-	5.09
东吴新产业	-13.62	5.82	-6.08	-11.76	-14.79	-16.87	-	-	-18.2
东吴 100	-	3.89	-4.41	-6.64	-16.2	-	-	-	-19.8
东吴保本	-	-0.1	0.4	0.9	-	-	-	-	0.8

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	3.54%	-0.31%	-5.50%	22	-6.81%	18	-6.74%	32	-11.33%	26	-28.76%	21	159.83%
东吴双动力	2.26%	-3.51%	-5.94%	128	-6.24%	106	-1.08%	80	-7.51%	97	-26.86%	90	52.93%
东吴轮动	5.59%	-1.62%	-8.57%	239	-20.33%	291	-14.51%	269	-22.60%	268	-45.57%	212	-33.37%
东吴优信 A	0.03%	0.41%	1.09%	19	0.67%	23	7.49%	13	7.62%	13	-1.22%	30	4.14%
东吴优信 C	0.01%	0.38%	0.98%	16	0.45%	15	7.15%	8	7.26%	9	-1.84%	20	0.64%
东吴策略	3.30%	-3.69%	-7.41%	47	-9.94%	48	-9.26%	44	-15.29%	50	-37.93%	48	-18.19%
东吴新经济	4.34%	1.64%	-2.70%	32	-5.25%	87	-8.55%	220	-11.72%	177	-24.63%	64	-13.40%
东吴新创业	2.71%	-6.90%	-11.95%	298	-9.03%	176	-4.44%	135	-13.29%	193	-26.84%	89	-15.95%
东吴新兴产业	4.04%	-3.90%	-10.71%	89	-16.62%	84	-12.04%	79	-19.89%	75	--	--	-40.80%
东吴增利 A	0.00%	0.39%	0.30%	48	0.19%	34	4.24%	39	4.34%	38	--	--	5.80%
东吴增利 C	-0.10%	0.40%	0.10%	31	-0.20%	23	3.74%	26	3.74%	26	--	--	5.09%
东吴新产业	5.82%	-2.85%	-11.76%	295	-14.97%	275	-13.62%	265	-16.10%	--	--	--	-18.20%
东吴 100	3.89%	-2.08%	-6.64%	15	-15.84%	20	-19.80%	--	--	--	--	--	-19.80%
东吴保本	-0.10%	0.30%	0.90%	--	--	--	0.80%	--	--	--	--	--	0.80%

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

反弹两步走

市场探底后展开反弹，原因主要有二，一是经济面信号的转好对投资者信心的加强；二是新领导层执政方针的一些积极变化。股市在前期的问题反应了经济层面的信息，但是反应的不仅仅是经济层面，对于体制的一些深层次的担心占据了主要的部分，市场在经济层面的下行后基于信心层面也有超额的杀跌，目前市场修复的主要是信心层面，对于估值层面给予恢复，这是第一步，而中央政治局会议对于经济政策的制定方针和执行重点则会成为后市市场逐步企稳的长期支撑，这是第二步，对于市场估值修复到一个新的中枢后，市场因为长期原因还是会维持震荡的走势。这是对行情的预判。

短期内，对于低估值的周期股和去库存差不多的品种给予关注，中长期在整体经济调整的阶段内还是关注具有核心价值的制造企业和医药企业。

○ 市场综述

A股大举反弹

沪指上周大举反弹。上周上证综指收盘于2061.79点，涨36.67点，全周涨幅4.12%；深证成指收盘于8189.68点，涨286.43点，全周涨幅2.61%；中小板指报3826.26点，涨148.05点，涨幅4.03%；创业板报637.49点，涨30.72点，涨幅5.06%。

12月03日周一股指早盘在地产和建材板块带动下短暂上冲后，遇7日线受阻震荡，随后酿酒、传媒、钢铁等多板块集体下挫，也宣告股指的反弹告一段落。午后2点左右，在煤炭板块带领下，股指快速回落，深成指跌超2%，一根长阴再创新低。12月04日周二两市早盘呈现低开低走格局，沪指上午最低1949.46点，宣告A股进入解放前。午后不久，板块百花齐放，钢铁、券商、汽车、军工等板块均出现快速上涨，而且衔接较好，股指在不同板块带动下呈现阶梯式上涨，强势延续至收盘。12月05日周三两市今日出现报复性反弹，个股板块全面开花，沪指放量长阳大涨近3%重返2000点，深成指最高涨幅4.45%，水泥、券商板块涨幅均超6%，12月06日周四市场呈现窄幅震荡走势，多空双方围绕20日均线附近展开拉锯，25日均线阻力明显，深沪两市量能同时减小，股指收十字星。12月

07日周五早盘股指延续6日调整小幅低开，开盘顺势下探后多头开始发力反攻，经过连续两波拉升直接突破30日线，随后股指略有整固，便再度强拉，一举攻至60日线下方。

国际股票市场方面，上周全周道指上涨约1.1%，纳指跌0.86%，标普500指数上涨约0.01%。上周欧洲主要股指上涨，英国富时100指数上周上涨0.83%，法国CAC 40指数上周累计上涨2.05%，德国DAX 30指数周累计上涨了1.35%。亚太地区股票市场方面，各主要股指则大多上涨，日经225指数上周下跌0.02%。香港恒指上周累计上涨0.68%，澳大利亚股票市场上周上涨约1.42%，而韩国股市上周则上涨约1.14%。

大宗商品方面，上周五美国12月份轻质原油报收于每桶85.93美元，在上周的交易中，纽约原油期货价格下跌了3.4%。今年1月份交割的北海布伦特原油期货报收于每桶107.17美元，在上周的交易中，北海布伦特原油期货价格下跌逾3.6%。纽约黄金期货价格报收于1705.05美元盎司，全周下跌了约0.4%。

12月03日至12月09日这段时间内，以下消息值得关注：

1、2012年11月份，全国居民消费价格总水平同比上涨2.0%。其中，城市上涨2.1%，农村上涨1.9%；食品价格上涨3.0%，非食品价格上涨1.6%；消费品价格上涨1.9%，服务项目价格上涨2.3%。1-11月平均，全国居民消费价格总水平比去年同期上涨2.7%。

2、中共中央政治局12月4日召开会议，审议中央政治局关于改进工作作风、密切联系群众的八项规定，分析研究2013年经济工作。中共中央总书记习近平主持会议。

3、上周，外汇管理局再次批准了包括卡塔尔控股、安大略省退休金等11家QFII机构的24.75亿美元的额度。截至目前，外汇局批准了144.03亿美元的QFII金额，是前9年批准额度的66.7%，这也就意味着目前已经有201家境外机构投资者获得QFII的资格，总额度也达到了300.43亿美元。

4、近日，电煤价格并轨方案已上报至国务院，并得到国务院批示。新方案提出以3年以上的中长期合同替代重点合同煤，电煤价格由供需双方自主协商确定，国家发改委将专门研究制定管理办法。

东吴动态

东吴优信业绩居前

2012-12-03 上海证券报

今年以来，“股债跷跷板”效应尽现，根据银河数据，截止11月28日，纳入统计的一级债券今年以来平均净值增长率为6.29%，二级债券平均增长率为4.94%。东吴优信稳健债券A类今年以来实现净值增长率为7.43%，位居所有同类型基金前列。尤其是7月份以来，东吴优信表现稳健，净值增长率更是靠前。

伴随着业绩的持续走强，债券类基金的规模也不断扩大，东吴优信近半年一直受到投资者的热捧。东吴基金固定收益部总经理兼优信基金经理丁蕙指出经历三季度债市短暂“变脸”，目前收益率曲线扁平，短期信用债信用利差已明显高于历史均值，债券整体收益率水平重回历史均值上方。不过临近年末，各机构买盘需求减退，同时面临年底资金压力，现阶段还是应保持中性。未来综合宏观层面和资金面状况，债券的投资机会仍然较好。东吴优信将采用“信用债+杠杆”操作策略，同时对低等级债的建仓应自下而上的筛选。因为银行存款的边际成本在不断往上走，再加上7天回购利率价格的刚性水平，4季度收益率下降空间有限。在供求关系上，由于国家大力推动直接融资，因此债券市场，特别是信用债市场供给较以往出现明显增加。因此，从当前时点来讲，市场在未来半年内有望取得较好的持有收益。

从历史数据上看，四季度通常是债市较好的布局期，次年一季度则是较好的收益期。

东吴基金“理财千家万户行”走进陆家嘴图书馆

为更好地帮助投资者在弱市中提高理财意识以及普及投资者教育知识，东吴基金“理财千家万户行”系列活动于11月29日走入陆家嘴图书馆，为广大读者和周边居民带来了一场别开生面的理财知识讲座，东吴基金理财中心主管史爱柱先生为大家讲解如何规划个人财务、如何活用日常闲钱等专业知识，受到广大读者和居民的欢迎，反响良好。

东吴基金理财中心主管史爱柱指出，每位投资者在投资理财前均需要了解自身情况，比如退休居民投资债券型基金，具有收益稳定、流动性好等特点，特别适合退休居民投资。在讲座中，史爱柱先生在现场深入浅出地分享了个人理财规划周期理论、“72定律”理论、美林投资时钟理论等与个人理财相关的理论，现场投资者交流踊跃，反响积极，并有8位投资者现场预约开户办理基金定投、货币基金等理财产品。

据悉，自今年年初以来，东吴基金“理财千家户行”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，通过一系列创意活动，始终致力于帮助投资人树立正确的理财观念。此次走进图书馆，就是希望帮助图书爱好者们树立起正确的理财观念，为其带来长远价值。



东吴动态

东吴货币市场基金收益支付公告

东吴行业轮动股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

东吴行业轮动股票型证券投资基金更新招募说明书

(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)



反洗钱专栏

警惕网络洗钱陷阱

THE PEOPLE'S BANK OF CHINA



中国人民银行
THE PEOPLE'S BANK OF CHINA

空壳公司的网银结算服务

1



1. 李某、王某等人用个人或他人身份证注册成立空壳公司，开立企业网银结算账户和自然人结算账户。

2. 李某、王某通过网上银行，为2000余家公司、企业提供套现，金额逾50亿元，以虚构交易等方式向信用卡持卡人直接支付现金近16亿元。



2

3



3. 李某、王某还非法从事资金支付结算业务，获取非法利益284万余元。

4. 李某、王某等10人犯非法经营罪，分别判处有期徒刑1年至5年，并处相应罚金。



4

警惕网络洗钱陷阱

AML

中国金融出版社



警惕网络洗钱陷阱

THE PEOPLE'S BANK OF CHINA

AML

警惕网络洗钱陷阱

网络诈骗的集资通道

1

××公司经营房地产、生态农业开发等项目，收益可观。现筹集项目开发资金，每月5%—10%的回报，本金两年后随时可退还。



1. 李某在网络上发布高息借款信息，谎称经营各种高收益项目。李某常在第一笔借款后按时偿还本金和高额利息，在获取他人信任之后，即以各种理由拒绝兑现借款承诺。

2. 赵某在明知李某进行网络诈骗的情况下，仍然将自己的账户交给李某使用，用于接收各种受骗款。



我不会亏待你的！

3



3. 赵某用银行账户的钱代李某购买别墅、商铺和住宅。

这罪名比一人一个，还真不“亏待”我啊！

4. 案发后，李某因非法吸收公众存款罪被判入狱，赵某也因洗钱罪获刑。



4

老乡熟人的网上洗钱圈套

1



1. 香港人程某以好处费为诱饵，指使沈某回老家组织他人办理多张信用卡。

妈，填了这个表就有钱挣。

2. 沈某通过其兄沈A找老乡熟人共办理信用卡280余张。



3



3. 程某和沈某通过各种网上支付和交易进行洗钱，涉及账户交易达120亿元。

4. 某地人民法院依法对被告人沈A、沈某和程某（香港）进行宣判。



4



常见问题

Q：网上交易遇到出错提示，该如何处理？

A：您只需要把出错的页面复制截图发送邮件或传真给我们，邮件地址：services@scfund.com.cn，传真号码 021-50509884，注明：出错时间和您的基金账号 - 姓名 - 联系方式，我们会根据截图为您提供诊断，助您顺利下单。

Q：什么是基金转换？

A：基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有的某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额

Q：代销机构买的基金可以通过直销交易吗？

A：代销机构购买的份额只能通过代销机构进行交易，如果您希望通过直销网上交易操作，可以办理份额转托管。

○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	邹国英		
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	唐祝益		
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	<p>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。</p> <p>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。</p>		
销售机构	<p>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</p>		



○ 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	周健		
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	周健		
投资对象	<p>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%。</p> <p>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。</p>		
投资目标	<p>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。</p>		
比较基准	<p>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</p>		
操作策略	<p>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增长所带来的投资收益。</p>		
销售机构	<p>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</p>		



○ 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。		