

东吴基金

基金周报

2012年12月17日

总第386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

- 龙饮水 继续看好
- A股创3年来最大日涨幅

东吴动态

- 股基上演年末反击战 东吴轮动借势上扬 9%
- 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
- 东吴基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告

反洗钱专栏

- 警惕网络洗钱陷阱 增强反洗钱意识

常见问题

- 直销网上交易操作失败原因有哪些？
- 网上直销可以用不同的银行卡操作吗？
- 用不同银行卡买的份额赎回后资金能回到其中一张银行卡上吗？



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10日		12月11日		12月12日		12月13日		12月14日	
	单位净值	累计净值								
东吴嘉禾	0.6527	2.3727	0.6492	2.3692	0.6493	2.3693	0.6497	2.3697	0.6733	2.3933
东吴双动力	1.0510	1.6310	1.0463	1.6263	1.0480	1.6280	1.0423	1.6223	1.0760	1.6560
东吴轮动	0.6301	0.7101	0.6280	0.7080	0.6270	0.7070	0.6187	0.6987	0.6554	0.7354
东吴优信 A	1.0291	1.0411	1.0285	1.0405	1.0289	1.0409	1.0291	1.0411	1.0295	1.0415
东吴优信 C	1.0161	1.0281	1.0155	1.0275	1.0159	1.0279	1.0161	1.0281	1.0165	1.0285
东吴策略	0.7749	0.8449	0.7748	0.8448	0.7726	0.8426	0.7693	0.8393	0.7915	0.8615
东吴新经济	0.8730	0.8730	0.8670	0.8670	0.8680	0.8680	0.8660	0.8660	0.9000	0.9000
东吴新创业	0.8050	0.8650	0.8020	0.8620	0.8030	0.8630	0.7940	0.8540	0.8170	0.8770
东吴新兴产业	0.6010	0.6010	0.5980	0.5980	0.5970	0.5970	0.5900	0.5900	0.6130	0.6130
东吴增利 A	1.0200	1.0600	1.0200	1.0600	1.0200	1.0600	1.0200	1.0600	1.0200	1.0600
东吴增利 C	1.0140	1.0540	1.0130	1.0530	1.0130	1.0530	1.0130	1.0530	1.0140	1.0540
东吴新产业	0.8260	0.8260	0.8190	0.8190	0.8180	0.8180	0.8120	0.8120	0.8530	0.8530
东吴 100	0.8120	0.8120	0.8070	0.8070	0.8090	0.8090	0.8010	0.8010	0.8360	0.8360
东吴保本	1.0080	1.0080	1.0080	1.0080	1.0090	1.0090	1.0090	1.0090	1.0100	1.0100

基金名称	12月9日		12月10日		12月11日		12月12日		12月13日		12月14日	
	万份收益	7日年化收益率										
东吴货币 A	1.3127	2.847%	2.2382	3.616%	0.6021	3.598%	0.6835	3.634%	0.6984	3.280%	0.6267	3.265%
东吴货币 B	1.4439	3.105%	2.3058	3.876%	0.6709	3.854%	0.7503	3.888%	0.7660	3.533%	0.6937	3.518%

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	-2.98	4.03	5.32	-1.51	-6.38	-4.36	-15.45	-4.8	166.12
东吴双动力	1.86	2.97	-0.01	-3.44	-5.88	-1.01	-14.25	-2.63	57.87
东吴轮动	-10.37	4.85	4.5	-5.36	-16.51	-13.59	-26.22	-13.06	-30.15
东吴优信 A	7.52	0.03	0.21	1.29	0.95	7.86	-1.35	0.51	4.17
东吴优信 C	7.18	0.03	0.18	1.19	0.75	7.5	-1.66	0.15	0.67
东吴策略	-6.11	3.48	1	-3.69	-9.33	-8.19	-20.57	-7.85	-15.27
东吴新经济	-4.96	3.93	6.76	2.39	-4.05	-4.86	-12.92	-	-10
东吴货币 A	3.02	0.06	0.21	0.67	1.27	3.18	3.17	-	7.33
东吴货币 B	3.25	0.07	0.23	0.73	1.4	3.42	3.42	-	8
东吴新创业	-1.92	2.64	-2.85	-10.12	-8.82	-6.31	-14.67	-	-13.8
东吴新兴产业	-8.92	3.55	0	-7.96	-15.33	-12.55	-	-	-38.7
东吴增利 A	4.44	0.2	0.59	0.69	0.39	4.54	-	-	6.01
东吴增利 C	4.05	0.3	0.6	0.7	0.09	4.05	-	-	5.4
东吴新产业	-9.93	4.28	2.16	-7.38	-14.53	-12.51	-	-	-14.7
东吴 100	-	4.24	2.96	-2.9	-13.9	-	-	-	-16.4
东吴保本	-	0.2	0.4	1.1	-	-	-	-	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	4.03%	6.81%	-1.51%	18	-6.29%	15	-2.98%	28	-5.24%	26	-27.63%	21	170.30%
东吴双动力	2.97%	1.65%	-3.44%	168	-5.51%	101	1.86%	88	-1.16%	95	-25.67%	88	57.47%
东吴轮动	4.85%	7.43%	-5.36%	248	-16.83%	290	-10.37%	265	-12.11%	250	-45.26%	214	-30.14%
东吴优信 A	0.03%	0.18%	1.29%	34	0.93%	17	7.52%	16	7.68%	15	-2.13%	33	4.17%
东吴优信 C	0.03%	0.15%	1.19%	26	0.73%	12	7.18%	12	7.32%	11	-2.74%	22	0.67%
东吴策略	3.48%	2.43%	-3.69%	38	-9.22%	50	-6.11%	42	-9.01%	43	-36.75%	47	-15.34%
东吴新经济	3.93%	8.70%	2.39%	23	-4.76%	79	-4.96%	202	-5.86%	172	-23.86%	66	-10.00%
东吴新创业	2.64%	-0.97%	-10.12%	304	-8.41%	173	-1.92%	148	-5.88%	173	-26.79%	102	-13.74%
东吴新兴产业	3.55%	2.68%	-7.96%	93	-15.33%	86	-8.92%	79	-12.93%	78	--	--	-38.70%
东吴增利 A	0.20%	0.59%	0.69%	52	0.01%	40	4.44%	42	4.54%	41	--	--	6.01%
东吴增利 C	0.30%	0.60%	0.70%	30	-0.19%	26	4.05%	29	4.15%	28	--	--	5.40%
东吴新产业	4.28%	4.41%	-7.38%	291	-14.36%	280	-9.93%	259	-10.96%	--	--	--	-14.70%
东吴 100	4.24%	5.16%	-2.90%	15	-13.73%	18	-16.40%	--	--	--	--	--	-16.40%
东吴保本	0.20%	0.30%	1.10%	--	--	--	1.00%	--	--	--	--	--	1.00%

数据来源：中国银河证券研究所基金研究中心

专业理财交给我们 美好生活还给自己

电话：400-821-0588

网址：www.scfund.com.cn

公司地址：上海市浦东新区源深路279号

邮政编码：200135

东吴视点

○ 基金经理手记

龙饮水 继续看好

市场强势依旧，整理近一周后周五放出长阳，资金进场意愿强烈，特别是银行板块领涨的特点其实是对于市场估值的一个提升，银行定则大盘定，银行的估值稳定和提升对于股指具有特别的意义，放大的意义。对于反弹我们还是维持两步走的态势，第一步、提振信心，激发人气，修复市场估值体系；第二步、针对经济回暖弱周期，在基本面进行配置的尝试，早周期的一些品种值得关注。行情短期已抬头，调整就是龙饮水。

投资者关注的中央经济工作会议的定调也很重要，从新一届领导上任以来，继往开来，气象还是提振了一些，在针对开局之年的政策制定中，要想取得新意比较困难，但是在传统领域的表述与突破值得关注，特别要注意观察地产调控、新型城镇化的具体表述。

关注与国土建设投资相关的品种，水利、环保、水泥、建材值得继续关注。

○ 市场综述

A股创3年来最大日涨幅

A股上周创3年来最大日涨幅。上周上证综指收盘于2150.46点，涨88.84点，全周涨幅4.31%；深证成指收盘于8530.9点，涨341.22点，全周涨幅4.17%；中小板指报3962.54点，涨136.28点，涨幅3.56%；创业板报656.22点，涨18.73点，涨幅2.94%。

12月10日早盘延续上周涨势，两市小幅高开，沪指开盘即站上60日均线，但随着股指上涨，抛压及套牢盘压力显现，股指震荡整理。深成指早盘盘中受地产股急跌影响，一度翻绿后回升。午后受益中央一号文件成年底炒作热点的农业股持续活跃，带领大盘上扬，12月11日周二股指呈现冲高回落趋势，两市早盘双双低开，酿酒板块快速拉升至涨幅第一，沪指在六十日线上方震荡整理，深成指在五日线上方得到良好支撑。午后股指横盘整理后震荡上扬一度双双翻红，煤炭、有色、银行等权重板块相继拉升成为做多主力，临近尾盘股指再度走低。12月12日周三两市开盘涨跌不一，沪指低开0.05%，深成指高开0.01%。股指震荡上扬，盘中最高至2085.93点。但是由于市场

量能欠缺，两市股指双双冲高回落。午后大盘继续呈现震荡整理格局，沪指在 2070 点上下展开拉锯。受市场对美联储推出第四轮量化宽松措施的预期影响，黄金概念股爆发。有色、石油、券商等权重股表现活跃，环保股纷纷崛起，共同拉动股指上涨迅速翻红。12月13日周四两市开盘后持续走弱，沪指跌破 89 日及 5 日均线，成交量持续萎缩。午后大盘一直维持横盘震荡状态，直至 14:27 左右，大盘出现快速下探，板块个股跌幅普遍扩大，沪指勉强维持在 60 日线之上。12月14日周五股指早盘双双高开，随后券商、保险、银行等板块相继拉升，沪指震荡上行突破五日线后站上 2100 点大关。之后股指继续上行，市场做多热情全面爆发，临近午盘各板块全线飘红。午后股指持续震荡走高，沪指大涨超 4%创 09 年 10 月以来最大单日涨幅，

国际股票市场方面，上周全周道指上涨约 0.01%，纳指跌 0.03%，标普 500 指数下跌约 0.01%。上周欧洲主要股指上涨，英国富时 100 指数上周上涨 0.23%，法国 CAC 40 指数上周累计上涨 1.11%，德国 DAX 30 指数周累计上涨了 1.02%。亚太地区股票市场方面，各主要股指则大多上涨，日经 225 指数上周上涨 2.62%。香港恒指上周累计上涨 1.91%，澳大利亚股票市场上周上涨约 1.09%，而韩国股市上周则上涨约 2.04%。

大宗商品方面，上周五美国明年 1 月份轻质原油报收于每桶 86.73 美元，在上周的交易中，纽约原油期货价格上涨了 0.5%。今年 1 月份交割的北海布伦特原油期货报收于每桶 109.15 美元，在上周的交易中，北海布伦特原油期货价格上涨逾 1.8%。纽约黄金期货价格报收于 1697 美元盎司，全周下跌了约 0.5%。

12月10日至12月16日这段时间内，以下消息值得关注：

1、一年一度的中央经济工作会议 15 日上午在北京开幕。这次会议将分析国际国内经济社会发展形势，总结 2012 年经济工作，对 2013 年经济工作作出部署。2013 年是全面深入贯彻落实党的十八大精神的开局之年，是实施“十二五”规划承前启后的关键一年，是为全面建成小康社会奠定坚实基础的重要一年，做好经济工作意义十分重大。

2、12 日，美联储宣布在 9 月的 QE3 继续实施的基础上，于年末扭转操作 (OT) 结束之后推出 QE4。具体的方式是在每月 400 亿美元的进度购买抵押贷款支持证券 (MBS) 的基础上，再从明年 1 月起每月增加购买长期国债 450 亿美元，届时相当于每月购买 850 亿美元的债券。

3、央行、国税总局、住建部等部委相关负责人均在各种场合谈过房产税改革推进问题。截至目前，40 个重点城市个人住房信息系统已完成联网，全国 30 多个省区市和计划单列市的地税官员正开展为期 6 个月的房产税税基评估集训，而湖南、湖北已经开展和完成前期测试工作。

4、美国 11 月工业产出增幅超预期，创下近两年来最高增幅。生产在飓风桑迪影响消退后反弹。美联储周五称，上月美国工业产出增长 1.1%，10 月工业产出经调整后为萎缩 0.7%。

东吴动态

股基上演年末反击战东吴轮动借势上扬 9%

12月14日 南方日报

自12月4日击穿1950点后,连日来A股市场出现了强势反弹。截止12月10日,沪指5个交易日上涨127点,涨幅达6.33%。同期股票型基金净值收益也一改今年以来的低迷之势,向上攻势凌厉。Wind数据显示,截止12月10日,336只普通股票型基金自12月4日以来平均上涨5.40%,其中,东吴行业轮动5个交易日上涨8.97%,涨幅在同类336只产品中排名第4。

从统计数据来看,本次反弹中,地产、金融、金属、建筑等周期性板块涨幅居前,因而带动一些蓝筹风格基金净值大幅上涨。以东吴行业轮动为例,根据三季报显示,该基金前十大重仓股主要为煤炭、有色金属等周期性品种,其涨幅全部在7%以上,其中,盘江股份、潞安环能涨幅分别达18.39%和15.60%,对基金净值上涨形成有力的支撑。值得关注的是,基础市场板块的分化使得股票基金净值收益存在较大差异。观察发现,在本轮股票型基金“高歌猛进”中,仍有5只产品涨幅不足1%,错失市场反弹良机。

业内人士分析认为,近期A股市场的反弹,一方面是受到政策预期等因素的推动,另一方面也是对经济企稳的正面反应。经过长时间低位震荡,包括基建、金属等在内的市场周期性板块具备了一定的估值以及价格等方面的优势。本轮反弹既是对市场蓝筹股投资价值的认同,也是市场资金风险偏好下降,经济回落驱动下的价值投资回归,因而对于地产、金属、建筑等周期性品种的配置使得基金业绩收益颇多。

海通证券数据显示,今年前三季度,股票型基金年内平均亏损6.96%,仅好于指数型产品。而记者查询Wind数据则发现,截止12月10日,年内普通股票型基金亏损幅度已收窄至2.98%,优于指数型产品的基础上,还超越了混合型产品。

业内人士指出,从基本面来看,目前经济数据出现企稳信号,投资者对于未来经济继续走好的预期再度提升,而经济的企稳将有助于市场估值的相对稳定。短期来看,市场延续反弹是大概率事件,不过,中长期仍持观望态度。配置方面,可以继续优选低估值、业绩改善的周期蓝筹股以及受益于全球货币流动性宽松和经济复苏的资源类品种。

东吴优信业绩居前

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。



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

基金周报

2012年12月17日

总第386期

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。

专业理财交给我们 美好生活还给自己

电话：400-821-0588

网址：www.scfund.com.cn

公司地址：上海市浦东新区源深路279号

邮政编码：200135

东吴动态

东吴基金管理有限公司关于提请投资者

及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告

新《中华人民共和国居民身份证法》已于2012年1月1日起开始实施，根据新《中华人民共和国居民身份证法》第二十三条规定，依照《中华人民共和国居民身份证条例》领取的居民身份证（即第一代身份证），自2013年1月1日起停止使用。

根据2007年8月1日实施的《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》的相关规定：“在与客户的业务关系存续期间，金融机构应当采取持续的客户身份识别措施，关注客户及其日常经营活动、金融交易情况，及时提示客户更新资料信息。客户先前提交的身份证件或者身份证明文件已过有效期的，客户没有在合理期限内更新且没有提出合理理由的，金融机构应中止为客户办理业务。”

东吴基金管理有限公司（以下简称“我公司”）提醒基金份额持有人，如果您的身份证件或者身份证明文件已经过期，请及时到开立基金账户的机构办理身份证件或者身份证明文件信息更新，以免影响交易。

投资者可拨打我公司客户服务热线400-821-0588（免长途费）、021-50509666或登陆我公司网站 www.scfund.com.cn 获取相关信息。

特此通知。

东吴基金管理有限公司

2012年12月17日



反洗钱专栏

警惕网络洗钱陷阱

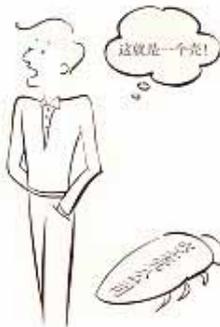
THE PEOPLE'S BANK OF CHINA



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。



3

我不会亏待你的！



3. 赵某用银行账户的钱代李某购买别墅、商铺和住宅。

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。

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：直销网上交易操作失败原因有哪些？

A：请确认交易时候是否出现以下问题：1. 是否有撤单 2. 是否出现错误提示 3. 系统运行是否有页面无跳转的提示。如果出现以上原因，您的交易就无法成功，已提交的申请资金会在 T+3 或 4 个工作日左右退回您的账户。

Q：网上直销可以用不同的银行卡操作吗？

A：网上直销客户请登录网上交易，在“我的基金”选择“增开其他银行卡”按步骤操作即可。同一家银行只能绑定一张银行卡。

Q：用不同银行卡买的份额赎回后资金能回到其中一张银行卡上吗

A：不能，使用哪张银行卡认/申购基金份额，赎回份额后资金就必须回到原登记的账户，除非银行卡挂失，凭银行出具的挂失证明原件方可办理份额对应的银行卡调整。

○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	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增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。		