



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17日

总第329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：窗口期 多观察
- 市场综述：全球市场反弹持续

东吴动态

○ 东吴动态

东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中信银行网上银行、移动银行延长基金申购费率优惠的公告

东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理变更公告

○ 媒体报道

东吴基金陈宪：9月CPI或高于6%

徐建平：四季度CPI将明显回落

东吴基金四季度策略：欧债隐忧未除，控制仓位谨慎投资

常见问题

- 东吴增利债券型证券投资基金的封闭期为多久？
- 什么是非交易过户？
- 我通过东吴基金网站首页的“在线咨询”栏目留言，为什么看不到客服人员的回复？

基金数据

○ 一周净值

基金名称	10月10日		10月11日		10月12日		10月13日		10月14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	0.749	2.469	0.7363	2.4563	0.7568	2.4768	0.764	2.484	0.7614	2.4814
东吴双动力	1.1325	1.7125	1.1202	1.7002	1.1484	1.7284	1.16	1.74	1.1562	1.7362
东吴轮动	0.9213	1.0013	0.8874	0.9674	0.9131	0.9931	0.9141	0.9941	0.9161	0.9961
东吴优信 A	0.9341	0.9461	0.9338	0.9458	0.938	0.95	0.9416	0.9536	0.9424	0.9544
东吴优信 C	0.9259	0.9379	0.9256	0.9376	0.9297	0.9417	0.9333	0.9453	0.9342	0.9462
东吴策略	0.9401	1.0101	0.9307	1.0007	0.9528	1.0228	0.9637	1.0337	0.9597	1.0297
东吴新经济	0.973	0.973	0.971	0.971	1.001	1.001	1.007	1.007	1.006	1.006
东吴新创业	0.948	1.008	0.935	0.995	0.956	1.016	0.965	1.025	0.964	1.024
东吴新兴产业	0.766	0.766	0.764	0.764	0.788	0.788	0.797	0.797	0.792	0.792
东吴增利 A	-	-	-	-	-	-	-	-	1.002	1.002
东吴增利 C	-	-	-	-	-	-	-	-	1.001	1.001
东吴新产业	-	-	-	-	-	-	-	-	1.003	1.003

基金名称	10月9日		10月10日		10月11日		10月12日		10月13日		10月14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	3.728	9.0307	3.618	0.8018	3.537	0.8542	3.026	0.0561	2.958	0.8781	2.499	0.1484
东吴货币 B	3.977	9.6225	3.866	0.8656	3.785	0.9205	3.274	0.1246	3.208	0.9474	2.75	0.2184

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	-16.6	0.65	-4.66	-12.18	-12.28	-9.21	3.72	13.38	200.94
东吴双动力	-18.6	1.65	-4.38	-10.97	-12.07	-16.76	5.59	9.26	69.66
东吴轮动	-21.4	-1.96	-6.39	-18.5	-23.66	-23.25	1.03	12.59	-2.36
东吴优信 A	-10.37	0.88	0.01	-5.85	-8.37	-12.48	-3.47	-	-4.64
东吴优信 C	-10.55	0.87	-0.01	-5.93	-8.5	-12.74	-3.83	-	-7.48
东吴策略	-20.76	0.84	-3.36	-12.84	-14.9	-20.39	1.9	-	2.74
东吴新经济	-12.6	2.97	-1.76	-10.97	-11.99	-3.82	-	-	0.6
东吴货币 A	2.49	0.12	0.24	0.73	1.54	2.86	-	-	3.42
东吴货币 B	2.68	0.13	0.26	0.8	1.67	3.1	-	-	3.78
东吴新创业	-10.74	1.47	-3.21	-10.41	-8.28	-5.48	-	-	1.71
东吴新兴产业	-	2.72	-3.3	-16.54	-20.96	-	-	-	-20.8

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	0.65%	-5.40%	-12.47%	18	-12.39%	11	-16.60%	21	-10.28%	14	7.07%	9	205.67%
东吴双动力	1.65%	-4.73%	-11.77%	56	-11.67%	23	-18.60%	137	-16.72%	138	10.89%	8	69.20%
东吴轮动	-1.96%	-6.08%	-18.87%	232	-23.53%	222	-21.40%	177	-24.49%	200	2.27%	39	-2.35%
东吴优信 A	0.88%	0.08%	-6.02%	57	-8.39%	60	-10.37%	60	-13.34%	54	-6.78%	47	-4.64%
东吴优信 C	0.87%	0.07%	-6.10%	59	-8.53%	61	-10.55%	61	-13.60%	55	-7.45%	49	-7.48%
东吴策略	0.84%	-4.92%	-13.31%	41	-15.52%	35	-20.82%	44	-20.43%	44	2.83%	15	2.65%
东吴新经济	2.97%	-2.33%	-11.68%	54	-11.99%	27	-12.60%	36	-4.19%	10	--	--	0.60%
东吴新创业	1.47%	-3.50%	-11.64%	49	-8.10%	5	-10.74%	18	-5.49%	16	--	--	1.79%
东吴新兴产业	2.72%	-3.77%	-17.24%	77	-20.72%	--	-20.80%	--	--	--	--	--	-20.80%
东吴增利 A	0.30%	0.20%	--	--	--	--	0.20%	--	--	--	--	--	0.20%
东吴增利 C	0.30%	0.20%	--	--	--	--	0.10%	--	--	--	--	--	0.10%
东吴新产业	0.30%	--	--	--	--	--	0.30%	--	--	--	--	--	0.30%

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

窗口期 多观察

随着9月份CPI数据的公布，汇金的进场增持，目前市场进入了窗口期，我们近期主要关注几个方面的指标，第一、CPI数据在四季度回落基本在市场预期之中，我们需要观察的是经济增速的下滑态势，上市公司的盈利增速下降数据，会否超出市场预期；第二、金融秩序紊乱，公共资源错配的局面是否有有效控制手段，民间借贷风险恶化，除了一部分自身原因之外，与目前整体资源分配的不均衡有极大地关系，金融机构在调控与暴利的双重驱使下，民间企业在生存与发展的压力下，不得已的一条路，未来管理层如何解决这一问题我们会密切关注，局部政策的优惠是否能够成为定向放松的信号；第三、地产销售滑坡明显，房价下调的趋势已然出现，我们认为这是有利于目前经济全局的，至少为政府的调控政策的调整提供了空间，未来我们也会密切关注这一指标。

从市场本身来看，如果上述指标向好发展，我们偏积极乐观，认为会有局部的反弹行情，当然，这也与后市IPO的节奏有着很大的关系。

○ 市场综述

全球市场反弹持续

沪深两市结束连续五周下跌行情，本周盘中创出回调新低后随即反弹，量能有所增长。上证综指收报 2431.38 点，涨 72.15 点，涨幅 3.06%；深成指收报 10438.26 点，涨 145.93 点，涨幅 1.42%，中小板及创业板也都出现不同程度的反弹，反弹幅度分别为 2.71%及 4.94%。

10月10日周一，沪深两市高开低走，盘中均创近期调整新低，市场成交也降至近期新低。行业板块中仅信息服务和交通运输两个板块上涨，房地产板块受重挫。周二受汇金公司增持股票及外盘大涨的双重影响，沪深两市大幅高开，金融股表现抢眼，但是采掘股受到资源税利空影响重挫，拖累股指震荡下行，盘中两市股指均再创近期调整新低。周三沪深两市早盘低开，探底后展开强劲放量反弹，尾盘以大阳线报收。金融服务表现持续强劲，采掘仍是弱势板块。周四沪深两市早盘低开，日间逐渐震荡反弹，尾盘双双收涨。各行业板块也全线上扬，金融服务板块由强转弱，采掘业弱势持续。10月14日周五，上证综指低开后震荡下行，尾盘跌幅有所收窄，行业方面，仅采掘、金融服务两个强周期板块小幅上涨，黑色金属跌幅较大。

本周因法德两国承诺采取一切必要措施来支持欧洲银行加上欧盟委员会提出解决欧债危机的建设性方案，令市

场情绪转暖，欧美股市大幅反弹。美国标普 500 指数大涨 5.98%，英国富时 100 指数、法国 CAC 及德国 DAX 指数分别上涨了 3.07%、3.95%及 5.14%。亚太地区主要市场反弹力度稍弱，包括日本、澳大利亚等国家主要股指涨幅都在 1%-2%之间，韩国、印度及香港反弹力度较大，涨幅分别达到 4.30%、5.24%及 4.49%。国际大宗商品市场本周也在大幅反弹，CRB 商品指数本周涨幅 4.54%，主要是由于前期跌幅较大的能源、化工类的品种止跌回升。美国 NYMEX 原油期货主力合约本周上涨 4.60%至 86.80 美元/桶；黄金价格同样出现反弹，COMEX 黄金期货主力 12 月合约涨 2.89%至 1683.0 美元/盎司。

10 月 10 日至 10 月 16 日这段时间内，以下消息值得关注：

1、 国务院关于修改《中华人民共和国资源税暂行条例》的决定，新规将对原油、天然气按销售额的 5-10%征收资源税；将对焦煤按 8-20 元人民币/吨征收资源税，其它煤炭则仍为 0.3-5 元；对稀土矿按每吨 0.4-60 元征收，其它有色金属矿原矿仍为 0.4-30 元。

2、 10 月 10 日晚间，工商银行、农业银行、建设银行和中国银行均在港交所披露汇金增持结果。按当日四大行收盘价粗略计算，汇金增持四大行总计耗资 19732 万元，约为 2 亿元。

3、 国家统计局 10 月 14 日公布的数据显示，9 月全国居民消费价格总水平（CPI）同比上涨 6.1%，比上月回落 0.1 个百分点。尽管 9 月 CPI 同比小幅回落，但仍连续四个月保持在 6%以上高位，分别为 6 月份的 6.4%、7 月份的 6.5%、8 月份的 6.2%、9 月份的 6.1%。

4、 北京建设银行个贷中心 10 月 13 日表示，建行根据各贷款客户的不同情况，实施差别化贷款利率政策，已将首套房贷最低利率由原来的基准利率上浮到基准利率的 1.05 倍，申请贷款者如果希望尽快放款，则需要主动上浮利率至基准利率的 1.1 倍。

5、 评级机构标准普尔 10 月 13 日调降西班牙主权信用评级至 AA-，评级展望为负面。标普称，此举主要因为西班牙经济增长放缓与银行业风险增加。

东吴动态

○ 东吴动态

东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中信银行网上银行、 移动银行延长基金申购费率优惠的公告

为了答谢广大投资者对东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的支持和厚爱，经本公司与中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）协商，本公司现决定自2011年10月13日起，对通过中信银行网上银行、移动银行申购本公司以下基金的申购费率实行费率优惠，目前包括：

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金前端收费（基金代码：580002）

一、申购费率优惠方式

活动期间，投资者通过中信银行网上银行、移动银行申购指定的开放式基金，享有申购费率优惠：（1）原申购费率高于0.6%，优惠费率为四折，但优惠费率不低于0.6%；（2）原申购费率低于0.6%，按照原费率执行。（3）只针对正常申购期的开放式基金（不包括定投）的前端收费模式，不包括基金的后端收费模式和基金募集期的认购费率。原费率指本公司发布的公开法律文件上注明的费率。

二、投资者可通过以下途径咨询有关详情

1、中信银行股份有限公司

客户服务电话：95558 网址：<http://bank.ecitic.com>

2、东吴基金管理有限公司

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666 网址：www.scfund.com.cn

三、重要提示

1、本次活动截止日期以中信银行网站公告为准。

2、本次优惠活动适用于本公司旗下基金的前端申购手续费收费（不含定期定额申购）。基金转换等手续费不享受以上优惠。

3、投资者欲了解基金产品的详细情况，请仔细阅读本公司旗下基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2011年10月13日

东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期：2011年10月14日

1、公告基本信息

基金名称	东吴优信稳健债券型证券投资基金
基金简称	东吴优信稳健债券
基金主代码	582001/582201
基金管理人名称	东吴基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
新任基金经理姓名	--
共同管理本基金的其他基金经理姓名	丁蕙
离任基金经理姓名	徐嵩、韦勇

2、离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	徐嵩、韦勇
离任原因	公司安排
离任日期	2011-10-14
转任本公司其他工作岗位的说明	-
是否已按规定在中国证券业协会办理变更手续	是
是否已按规定在中国证券业协会办理注销手续	否

3、其他需要说明的事项

上述事项已在中国证券业协会完成相关手续，并报中国证监会上海监管局备案。

东吴基金管理有限公司

2011年10月14日

○ 媒体报道

东吴基金陈宪：9月CPI或高于6%

证券时报网 2011-10-13

东吴基金首席策略规划师陈宪 10月13日在微博称，9月CPI可能微高于6%。

陈宪称：“9月CPI将于明天14日（周五）公布，9月翘尾因素虽有下降，但节日因素，导致新涨价动能略有提高，因此9月CPI还有可能微高于6%。鉴于CPI是翘尾与新涨价之和。10月起翘尾因素将明显下滑，所以CPI已是强弩之末成定局。”

徐建平：四季度CPI将明显回落

证券时报网 2011-10-14

东吴基金总裁徐建平 10月14日就9月份CPI数据发表看法，称四季度CPI将明显回落。

徐建平称：“CPI拐点确立，货币政策将渐变。9月CPI 6.1%，环比 0.5%，有节日因素，好于市场预期。鉴于翘尾因素和市场形势，四季度CPI将明显回落，通胀压力仍在，但CPI拐点确立。物价形势好转，货币政策的物价因素减弱，考量转型提速和世界经济减速，政策重点将逐步转变，转向不易，但定向宽松将不断浮出水面。”

东吴基金四季度策略：欧债隐忧未除，控制仓位谨慎投资

东吴基金 2011-09-29

上半年业绩规模齐奏凯歌的东吴基金日前发布四季度策略报告，认为国内经济增长继续向下的趋势可能将延续至四季度，在通胀见顶回落背景下，A股市场不会出现大幅下跌，震荡格局的概率较大。

东吴基金表示，A股市场6月中旬见底反弹，但7月在国内通胀数据连创新高和外围经济恶化等多重利空影响之下再次开跌。美债降级所导致的短暂恐慌使上证综指快速击穿2600点这一重要支撑位。在市场快速下跌后8月初指数反弹，但反弹力度有限，反映市场做多力量不足。

进入到9月份以后，央行9月5日将保证金存款纳入存款准备金缴纳范围，银行需要新缴9000亿左右存款准备金，货币政策没有放松迹象。9月9日公布的8月份CPI 6.2%，超市场预期，通胀压力没有缓解。在国内

经济增速放缓，政策放松预期落空，加上9月份欧债危机爆发，国际金融市场大幅波动，内忧外患，9月份A股市场选择方向继续下跌，并跌破2400点。

鉴于国内经济增长继续向下的迹象仍然较为明显，东吴基金预计这种趋势很有可能将延续至四季度。但固定投资增速的稳健起到了很强的支撑作用，同时，四季度是新项目开工旺季，预计投资端形势仍然较为乐观。总体来看，四季度经济增长仍属温和下行，预计GDP同比增速将在9%左右。通胀形势在四季度改善的概率较大，预计CPI逐月回落，四季度CPI降至5.2%左右。在经济温和下行和通胀见顶回落背景下，预计年内政策放松和收紧概率都比较小。东吴基金判断，在这种经济状态和政策背景下，A股市场不会出现大幅下跌，更多的是震荡格局，除非国内通胀超预期和欧洲主权债务危机失控。

从外围形势来看，欧债危机正逐步从希腊等国向欧盟核心国家扩散，虽然预计欧洲央行和全球其他主要经济体采取措施以帮助应对今年剩余时间欧洲大量主权债务的到期，以防止违约和其他连锁反应的出现，但是这个过程也许是曲折复杂的，从而对全球金融市场会造成巨大波动。

基于以上国内外经济形势的分析，东吴基金建议，4季度投资策略应控制仓位以应对国内通胀超预期和欧债危机可能带来的下跌风险。待情况相对明朗之后，参与可能出现的阶段性反弹。但由于全球经济并未走上真正改善的良性通道，对于阶段性反弹的高度和力度不宜过分乐观。在资产配置上可以遵循三条主线，一是在不确定环境下坚持防御为主，看好食品饮料和医药生物；二是在政策扶持和业绩保证的背景下精选个股，新材料、TMT（软件、电子元器件、通信行业）、节能环保和工程控制等；三是选择市场反弹中具有较高弹性的行业，看好煤炭、有色及其它跌幅较大的行业等。



常见问题

Q：东吴增利债券型证券投资基金的封闭期为多久？

A：基金封闭期是指自基金合同生效之日起至基金开始办理申购和赎回业务的期间，本基金封闭期为1年。本基金封闭期内不办理申购、赎回业务，也不上市交易。

Q：什么是非交易过户？

A：非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

非交易过户在继承、捐赠、司法强制执行以及本公司认可的其他情况下发起，基金合同另有约定的按基金合同规定执行。继承是指基金持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金持有人持有的基金份额强制划转给其它自然人、法人、社会团体或其它组织。

Q：我通过东吴基金网站首页的“在线咨询”栏目留言，为什么看不到客服人员的回复？

A：投资者通过“在线咨询”栏目留言，基金帐号、客户姓名、问题描述为投资者必填选项，联系电话、地址等信息为可填选项。客服人员收到客户的在线咨询提问后在一个工作日内予以回复。如投资者没有填写“基金帐号”这个必填选项，将无法看到客服人员回复的内容，客服人员将通过客户开户时登记的联系电话或电子邮箱予以回复。



○ 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、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		
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		