

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
基金合同生效日期:二〇一三年三月二十六日

1.1 重要提示
本基金的基金管理人东吴基金管理有限公司不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告自2012年8月13日起适用,投资者欲了解详细情况,应查阅本报告正文。

2.1 基金基本情况
基金名称:东吴保本基金
基金代码:582003
交易代码:582003

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年8月13日
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

基金投资目标:本基金主要通过投资组合保险策略的运用,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳健增长。

投资策略:1.资产配置策略
本基金资产分为保本资产与风险资产两大类,以恒定组合投资保险策略(CPI)为策略,结合东吴"M"值化模型,再基于基金管理人研究团队对宏观经济、市场及投资组合风险因素的综合判断,确定基金资产在股票、债券等投资品种中的比例。

2.债券投资策略
债券投资方面,对于本基金的保本资产部分,本基金主要投资对象为交易所和银行间债券市场上的债券,其组合久期与保本周期基本匹配,且以有较好流动性、收益相对稳定、再投资等各种风险同时可控等综合性、政策性的因素,审慎和动态调整。

3.股票投资策略
本基金股票资产部分,在符合保本资产投资比例的前提下,采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现超额收益。

4.衍生品投资策略
衍生品投资方面,本基金将根据对CPI模型并结合M值化模型,动态调整风险资产比例,在风险资产中,本基金将选择具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票作为投资对象,力争最大限度获取资本增值。

5.其他投资策略
本基金为保本混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

Table with 2 columns: 名称, 项目. Lists fund manager and custodian details.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
2012年8月13日至2012年12月31日
2011年
2010年

3.1.2 期末数据和指标
2012年末
2011年末
2010年末

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.

注:1.比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)。
2.本基金自2012年8月13日成立,合同生效当年按实际存续期计算,不按照自然年度进行计算。

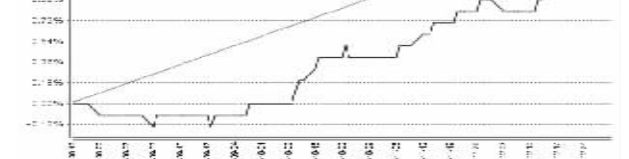


图3:基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

注:1.比较基准=银行三年定期存款收益率(税后)。
2.本基金自2012年8月13日成立,合同生效当年按实际存续期计算,不按照自然年度进行计算。

4.1 基金管理人及基金基本情况
4.1.1 基金管理人及其背景情况

东吴基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]2号批准设立的证券投资基金管理人,于2004年9月正式成立,注册资本人民币1亿元。由东吴证券股份有限公司、上海兰生(集团)有限公司、江苏东吴实业集团有限公司共同发起设立。

截至2012年12月31日,本基金管理人旗下管理基金13只,其中混合型基金3只,分别为东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴进取灵活配置混合型开放式证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金;股票型基金5只,分别为东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴进取灵活配置混合型开放式证券投资基金、东吴中证新兴产业主题证券投资基金、东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金。

4.1.2 基金的投资(或类似)及其基金投资范围
4.1.3 基金的投资策略

4.1.4 基金的风险控制
4.1.5 基金管理人承诺

4.2 基金托管人
4.2.1 基金托管人基本情况

4.2.2 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

4.3 基金销售
4.3.1 基金销售机构

4.3.2 基金销售机构的职责

4.3.3 基金销售机构的职责

4.3.4 基金销售机构的职责

4.3.5 基金销售机构的职责

4.3.6 基金销售机构的职责

4.3.7 基金销售机构的职责

4.3.8 基金销售机构的职责

4.3.9 基金销售机构的职责

4.3.10 基金销售机构的职责

4.3.11 基金销售机构的职责

4.3.12 基金销售机构的职责

东吴保本混合型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

4.7 管理人应对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金自成立以来未进行利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人履行托管职责情况
5.1.1 基金托管人基本情况

5.1.2 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.3 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.4 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.5 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.6 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.7 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.8 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.9 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.10 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.11 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.12 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.13 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.14 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.15 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.16 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.17 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.18 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.19 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.20 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.21 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.22 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.23 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.24 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.25 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.26 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.27 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.28 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.29 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.30 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.31 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.32 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.33 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.34 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.35 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.36 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.37 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.38 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.39 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.40 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.41 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

5.1.42 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值的比例(%)

8.2 期末按产品分类的股票投资组合
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值的比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值的比例(%)

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.3 期末本基金各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.9.4 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.5 期末本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.6 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.7 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.8 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.9 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.10 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.11 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.12 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.13 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.14 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.15 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.16 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.17 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.18 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.19 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.20 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.21 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.22 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.23 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.24 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.25 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.26 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.27 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.28 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.29 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.30 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。