东吴鼎利分级债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴鼎利分级债券(场内简称:东吴鼎利)	
基金主代码	165807	
交易代码	165807	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型。 基金合同生效日起3年内,鼎利A每满6个月开放一次,接受申购、赎回,第六个开放日只接受赎回,不接受申购;鼎利B封闭运作并上市交易。鼎利A和鼎利B的基金资产合并运作。 基金分级运作周期届满后,本基金转型为上市开放式基金(LOF)	
基金合同生效日	2013年4月25日	
报告期末基金份额总额	1,120,666,599.93份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动式管理,力争提供稳健的投资收益。	
投资策略	本基金为纯债基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动式管理,力争提供稳健的投资收益。	
业绩比较基准	中国债券综合全价指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其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。	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	鼎利优先	鼎利进取
下属两级基金的交易代码	165808	150120
报告期末下属两级基金的份额总额	696,249,879.84份	424,416,720.09份
下属两级基金的风险收益特征	鼎利A份额将表现出低风险、低收益的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	鼎利B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	12,401,621.94
2.本期利润	5,865,198.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0052
4.期末基金资产净值	1,133,083,645.88
5.期末基金份额净值	1.011

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金于2013年4月25日成立。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.12%	-1.92%	0.07%	2.42%	0.05%

注:比较基准=中国债券综合全价指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、比较基准=中国债券综合全价指数。

2、本基金于2013年4月25日成立,基金合同生效起至披露时点不满一年。按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。

3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期(2013年7月1日 — 2013年9月30日)
鼎利优先与鼎利进取基金份额配比	1.64048645:1
期末鼎利优先份额参考净值	1.018
期末鼎利优先份额累计参考净值	1.018
期末鼎利进取份额参考净值	1.000
期末鼎利进取份额累计参考净值	1.000
鼎利优先的预计年收益率	4.15%

注:鼎利优先约定年收益率=一年期银行定期存款利率×0.7+6个月Shibor×0.5。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁蕙	本基金基金经理、公司固定收益部总经理	2013年4月25日	-	13.5年	工商管理硕士,历任中信证券上海营业部交易员,汉唐证券固定收益部债券研究主管,航天科技财务公司债券投资主管,平安资产管理公司投资经理;2011年7月加入东吴基金管理有限公司,现担任公司固定收益部总经理兼东吴优信稳健债券基金基金经理、东吴保本混合基金基金经理、东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。
杨庆定	本基金基金经理、公司固定收益部副总经理	2013年6月25日	-	8年	管理学博士,历任天公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理,上海证券有限公司高级经理,太平资产管理有限公司高级投资经理;2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员,基金经理助理;2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司,现担任公司固定收益部副总经理,东吴鼎利分级债券基金基金经理。

注:1、丁蕙为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日,其他日期均指公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年以来监管层加强了债券市场的规范化管理,期初各类机构处于观望状态,六月份钱荒风暴释放了监管层从严治市的信号,因而三季度尽管市场资金价格中规中矩,但市场对流动性的预期发生了深刻改变。加之美国QE的退出路径愈发清晰,7、8月份工业增加值增速逐步上行,债券市场经历了本年度内的大幅调整,银行间10年期国债收益率本季度上升了约50BP。

本基金整个三季度实施中等仓位和低久期策略,投资标的为优质信用债券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.011元,累计净值1.011元;本报告期份额净值增长率0.50%,同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年6月份至8月份工业增加值增速逐步上行,8月份工业增加值同比增速为10.4%,创年内新高。10月份以来的高频数据显示工业增加值增速难以保持高位。因为基期因素等我们认为3季度应该是年内GDP增速的高点,4季度经济增速的动量不足,新一届政府对经济下行的也并非无底线,我们认为4季度经济下行幅度也有限。于此同时,美国QE退出的影响程度也将逐步降低。

基于我们的基本判断,结合当前债券收益率的绝对水平,本基金将继续加大高收益信用债的配置。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,417,250,718.42	95.40
	其中:债券	1,417,250,718.42	95.40
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	8,900,000.00	0.60
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	26,219,546.23	1.76
6	其他资产	33,204,850.73	2.24
7	合计	1,485,575,115.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	88,272,000.00	7.79
	其中:政策性金融债	88,272,000.00	7.79
4	企业债券	1,192,468,498.51	105.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	85,721,418.96	7.57
8	其他	50,788,800.95	4.48
9	合计	1,417,250,718.42	125.08

注:组合持仓中小企业私募债情况

代码	名称	持仓数量	票面利率(%)	期限(年)
125052	12徐水务100000	8		1
125108	13松鹤楼100000	8.9		2
118057	12冠耀集55000	9.8		2
118066	12盛水债100000	8.6		2
125123	13瑞水02 50000	8.1		3
125069	13瑞水01 100000	8.1		3

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128002	东华转债	448,353	55,716,378.96	4.92
2	122732	12九江债	500,000	54,750,000.00	4.83
3	122726	12柳东债	500,000	53,090,000.00	4.69
4	122685	12吉城投	500,000	52,780,000.00	4.66
5	122626	12海恒债	500,000	51,785,400.00	4.57

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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、处罚的情形。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,943.53
2	应收证券清算款	445,837.13
3	应收股利	-
4	应收利息	32,690,245.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,824.90
8	其他	-
9	合计	33,204,850.73

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	30,005,040.00	2.65

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鼎利优先	鼎利进取
报告期期初基金份额总额	696,249,879.84	424,416,720.09
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	696,249,879.84	424,416,720.09

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务份额;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金报告期间无基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴鼎利分级债券型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴鼎利分级债券型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5、报告期内东吴鼎利分级债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站:http://www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 (021)50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司
2013年10月23日

富安达优势成长股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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责任。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达优势成长股票
基金主代码	710001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月21日
报告期末基金份额总额	229,915,689.08份
投资目标	本基金定位为股票型证券投资基金,在充分控制风险的前提下,精选具有竞争优势及持续成长性的上市公司,分享中国经济高速发展带来的收益,力争获得超越投资基准的收益。
投资策略	本基金采用自上而下的多维经济模型,通过对全球经济发展形势,国内经济情况及经济政策,物价水平变动趋势,资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时将定性分析与定量分析贯穿于行业配置和个股选择的投资全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	24,837,347.48
2.本期利润	38,812,798.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.1551
4.期末基金资产净值	250,546,945.64
5.期末基金份额净值	1.0897

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.33%	2.18%	7.26%	1.07%	9.07%	1.11%

注:①本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×上证国债指数。

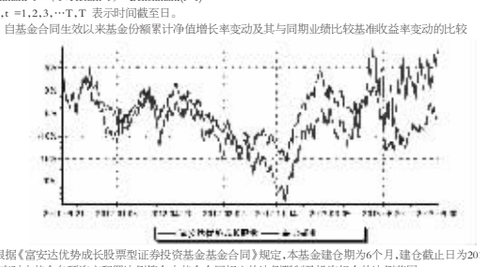
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =75%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+25%×[上证国债指数t / 上证国债指数(t-1) -1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:根据《富安达优势成长股票型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2012年3月20日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学兵	本基金的基金经理、投资管理部副总监	2011年9月21日	—	17年	硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍,历任南京证券股份有限公司证券投资总部投资经理;资产管理总部投资主办。

注:1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日,其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日;

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《富安达优势成长股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。

本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中存在价格差异的样本。通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析,在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内,因此不构成潜在利益输送的显著性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年三季度,政府在特定领域加大了稳增长力度,叠加市场流动性趋于稳定,宏观经济迎来阶段性趋稳回升。在改革与创新双轮推动下,A股市场整体性风险偏好回升,结构性机会反复演绎。与此相对应,作为成长股崛起的一个缩影,代表新经济模式与增长驱动力的创业板指数穿越周期迷雾,在转型预期推动下持续享受估值溢价,领涨全市场,成为"中国好指数"。

报告期内本基金坚持了成长股投资策略,对周期股的交易性波动,以及自贸区、土地改革等主题性博弈关注不多。根据成长板块行业景气度波动导致的内部分化与裂变,结合估值水平基本合理性,本基金投资组合进一步向互联网应用、文化传媒、医疗服务、智慧城市等符合经济结构转型与内需升级要求的轻资产行业倾斜,阶段性减持了消费电子、环保等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.0897元,本报告期份额净值增长率为16.33%,同期业绩比较基准增长率为7.26%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度乃至未来相当长的一段时期,三中全会的召开,大概率上将推动政府不断提高对经济增速下行的容忍度,不断强化以改革和创新推动转型的决心,虚拟经济部门投融资结构的期限错配和实体经济部门的资产负债结构错配,仍将面临持续的拨乱反正,以换取未来更高质量、更可持续的经济增长。在此背景下,资本市场领先实体经济开始转型,将体现出更强的有效性。实体经济去产能路上,利率市场化推动市场长期利率上行,周期股虽有阶段性逆袭,但缺乏整体性趋势动力,能够穿越周期迷雾的依然是符合时代变迁特征、具备较大市值提升空间、有望成长为未来新蓝筹的优质成长股。具体到四季度,尽管创业板面临IPO重启,但只会阶段性改变市场供需结构,不会改变公司质地和中长期市值占比逐步提升的大格局,尽管内部有分化和裂变,但稀缺性导致的估值溢价,仍将导致挖掘成长股成为市场的核心投资逻辑,现阶段仅因短期估值压力而指望创业板出现大的系统性回调,并不现实。

投资逻辑上,我们将紧紧围绕创新与改革的双轮驱动,致力于在时代变迁进程中寻找结构性变化。成长股的选择方面,我们的理解更多侧重于行业景气度、标的稀缺性和竞争优势驱动的未来市值增长空间。具体到四季度,我们重点关注互联网应用、文化传媒、医疗服务、智慧城市建设等需求扩张领域,积极关注地方债务清查后能否迎来订单释放的环保领域,以及估值压力充分释放、竞争优势依然存在的消费电子等领域。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	231,421,195.79	91.14
	其中:股票	231,421,195.79	91.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,821,630.65	7.41
7	其他各项资产	3,663,420.06	1.44
8	合计	253,906,246.50	100.00

注:由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,248.00	-
C	制造业	58,340,787.04	23.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,317.00	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,319,107.10	32.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,390,759.60	2.95
M	科学研究和技术服务业	7,739,910.00	3.09
N	水利、环境和公共设施管理业	12,113,443.25	4.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,337,475.00	5.32
R	文化、体育和娱乐业	50,177,148.80	20.03
S	综合	-	-
	合计	231,421,195.79	92.37

5.3 报告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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300088	长信科技	944,000	18,238,080.00	7.28
2	300017	网宿科技	271,033	15,448,881.00	6.17
3	300113	顺网科技	200,000	14,110,000.00	5.63
4	600763	通策医疗	407,500	13,337,475.00	5.32
5	600880	博瑞传播	438,989	12,818,478.80	5.12
6	300336	新文化	200,000	12,460,000.00	4.97
7	000826	桑德环境	358,855	12,111,356.25	4.83
8	002439	启明星辰	430,000	11,777,700.00	4.70
9	300291	华录百纳	170,000	9,853,200.00	3.93
10	300020	银江股份	384,870	9,190,695.60	3.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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、处罚的情形。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	230,591.29
2	应收证券清算款	3,419,250.93
3	应收股利	-
4	应收利息	8,708.97
5	应收申购款	4,868.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,663,420.06

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	265,032,480.53
本报告期基金总申购份额	13,940,451.47
减:本报告期基金总赎回份额	49,057,242.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	229,915,689.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013/07/17 富安达优势成长股票型证券投资基金2013年第2季度报告

2013/08/21 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司网上申购、定期定额费率优惠活动的公告

2013/08/29 富安达优势成长股票型证券投资基金2013年半年度报告

2013/09/26 关于增加万银财富(北京)基金销售有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构及开通开放式基金非现场交易方式办理申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准富安达优势成长股票型证券投资基金设立的文件

《富安达优势成长股票型证券投资基金招募说明书》

《富安达优势成长股票型证券投资基金基金合同》

《富安达优势成长股票型证券投资基金托管协议》

《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》

基金管理人业务资格批件和营业执照

基金托管人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.fadfunds.com)查阅。

富安达基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

东吴保本混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴保本混合
基金主代码	582003
交易代码	582003
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	344,316,199.98份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险策略的运作,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	本基金遵循保本增值的投资理念,根据恒定组合投资保险策略原理进行资产配置,保证保本周期到期时本金安全,同时通过精选个股和个券实现基金资产的稳健增长。
业绩比较基准	银行三年期定期存款收益率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
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
基金保证人	中国投资担保有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,747,058.69
2.本期利润	1,414,271.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0033
4.期末基金资产净值	354,781,673.32
5.期末基金份额净值	1.030

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

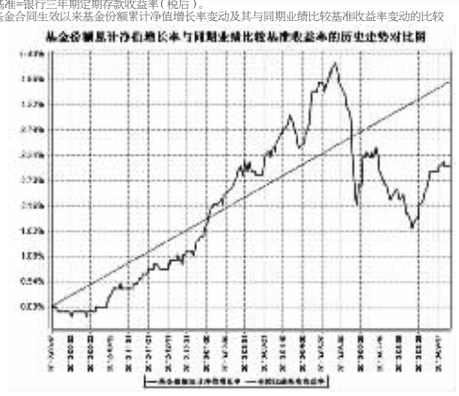
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.12%	1.07%	0.01%	-0.68%	0.11%

注:比较基准=银行三年期定期存款收益率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.比较基准=银行三年期定期存款收益率(税后)。

2.本基金于2012年8月13日成立。按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁蕙	本基金基金经理、公司固定收益部总经理	2012年8月13日	-	13.5年	工商管理硕士,历任中信证券上海营业部交易员,汉唐证券固定收益部债券研究主管,航天科技财务公司债券投资主管,平安资产管理公司投资经理;2011年7月加入东吴基金管理有限公司,现担任公司固定收益部总经理兼东吴优信稳健债券基金基金经理、东吴保本混合基金基金经理、东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

注:1、丁蕙为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日;

2、证券从业的含义