

## 东吴增利债券型证券投资基金

## 2013第四季度报告

2013年12月31日

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  
报告期出日期:二〇一四年一月二十二日  
**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及监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。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据基金合同范本，经协商一致并经基金管理人和基金托管人签字盖章后，于2014年1月17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。特此公告。

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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告期(2013年10月1日起至12月31日止)。

**5.2 基金产品概况**

基金名称 东吴增利债券

基金代码 588202

交易代码 588202

基金运作方式 灵均的。本基金在合同生效一年内封闭运作，基金合同期满后一年内转为开放运作。

基金合同生效日 2011年7月27日

报告期末基金份额总额 47,889,559.87份

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债券投资。

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长。

业绩比较基准 中国国债指数平均收益率。

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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

下属两级基金的基金简称 东吴增利债券A

东吴增利债券C

下属两级基金的交易代码 588202

588202

报告期末持有的流通受限股票的份额总额 11,385,031.57份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2013年10月1日～2013年12月31日)

东吴增利债券A 东吴增利债券C

1.本期已实现收益 115,086.27 22,923.53

2.本期利润 -464,727.87 -175,709.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 37,823,358.21 11,671,660.97

5.期末基金份额净值 1.036 1.025

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.上证国债指数所不含不包括个人投资者或机构投资者的各类费用,计算时将扣除所有费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金资产总值减去总负债后的单位净值。

4.本基金本报告期末未持有股票。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

6.本期期间费用 1.24% -1.24%

7.净值得增长 0.10% -0.10%

8.净值增长率标准差(%) 2.68% -2.68%

9.业绩比较基准收益率 0.10% 0.10%

10.业绩比较基准收益率标准差(%) 1.33% 0.01%

3.2.2 合同期内收益率增长率为基金累计净值增长率变化及其同期业比较基准收益率变化的比率

阶段 净值得增长 网值增长率 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.24% 0.10% -2.68% 0.10% 0.00%

东吴增利债券C

1.本期已实现收益 115,086.27 22,923.53

2.本期利润 -464,727.87 -175,709.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 37,823,358.21 11,671,660.97

5.期末基金份额净值 1.036 1.025

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.上证国债指数所不含不包括个人投资者或机构投资者的各类费用,计算时将扣除所有费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金资产总值减去总负债后的单位净值。

4.本基金本报告期末未持有股票。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

6.本期期间费用 1.24% -1.24%

7.净值得增长 0.10% -0.10%

8.净值增长率标准差(%) 2.68% -2.68%

9.业绩比较基准收益率 0.10% 0.10%

10.业绩比较基准收益率标准差(%) 1.33% 0.01%

3.2.2 合同期内收益率增长率为基金累计净值增长率变化及其同期业比较基准收益率变化的比率

阶段 净值得增长 网值增长率 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.24% 0.10% -2.68% 0.10% 0.00%

东吴增利债券C

1.本期已实现收益 115,086.27 22,923.53

2.本期利润 -464,727.87 -175,709.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 37,823,358.21 11,671,660.97

5.期末基金份额净值 1.036 1.025

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.上证国债指数所不含不包括个人投资者或机构投资者的各类费用,计算时将扣除所有费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金资产总值减去总负债后的单位净值。

4.本基金本报告期末未持有股票。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

6.本期期间费用 1.24% -1.24%

7.净值得增长 0.10% -0.10%

8.净值增长率标准差(%) 2.68% -2.68%

9.业绩比较基准收益率 0.10% 0.10%

10.业绩比较基准收益率标准差(%) 1.33% 0.01%

3.2.2 合同期内收益率增长率为基金累计净值增长率变化及其同期业比较基准收益率变化的比率

阶段 净值得增长 网值增长率 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.24% 0.10% -2.68% 0.10% 0.00%

东吴增利债券C

1.本期已实现收益 115,086.27 22,923.53

2.本期利润 -464,727.87 -175,709.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 37,823,358.21 11,671,660.97

5.期末基金份额净值 1.036 1.025

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.上证国债指数所不含不包括个人投资者或机构投资者的各类费用,计算时将扣除所有费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金资产总值减去总负债后的单位净值。

4.本基金本报告期末未持有股票。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

6.本期期间费用 1.24% -1.24%

7.净值得增长 0.10% -0.10%

8.净值增长率标准差(%) 2.68% -2.68%

9.业绩比较基准收益率 0.10% 0.10%

10.业绩比较基准收益率标准差(%) 1.33% 0.01%

3.2.2 合同期内收益率增长率为基金累计净值增长率变化及其同期业比较基准收益率变化的比率

阶段 净值得增长 网值增长率 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.24% 0.10% -2.68% 0.10% 0.00%

东吴增利债券C

1.本期已实现收益 115,086.27 22,923.53

2.本期利润 -464,727.87 -175,709.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 37,823,358.21 11,671,660.97

5.期末基金份额净值 1.036 1.025

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.上证国债指数所不含不包括个人投资者或机构投资者的各类费用,计算时将扣除所有费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金资产总值减去总负债后的单位净值。

4.本基金本报告期末未持有股票。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

6.本期期间费用 1.24% -1.24%

7.净值得增长 0.10% -0.10%

8.净值增长率标准差(%) 2.68% -2.68%

9.业绩比较基准收益率 0.10% 0.10%

10.业绩比较基准收益率标准差(%) 1.33% 0.01%

3.2.2 合同期内收益率增长率为基金累计净值增长率变化及其同期业比较基准收益率变化的比率

阶段 净值得增长 网值增长率 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.24% 0.10% -2.68% 0.10% 0.00%

东吴增利债券C

1.本期已实现收益 115,086.27 22,923.53

2.本期利润 -464,727.87 -175,709.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 37,823,358.21 11,671,660.97

5.期末基金份额净值 1.036 1.025

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.上证国债指数所不含不包括个人投资者或机构投资者的各类费用,计算时将扣除所有费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值是指基金资产总值减去总负债后的单位净值。

4.本基金本报告期末未持有股票。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

6.本期期间费用 1.24% -1.24%

7.净值得增长 0.10% -0.10%

&lt;p