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
送出日期:二〇一三年八月二十九日

东吴保本混合型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

本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8月26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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	486,912,415.84份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	1.资产配置策略 本基金的资产将分为保本资产与风险资产两大类资产,以恒定组合投资保险策略 CPPI 为依据,结合东吴 M 值优化*模型,再基于基金管理人对宏观经济运行变化的判断以及各投资品种的风险收益预期,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,以有效规避利率、收益率曲线变化、再投资等各种风险;同时综合考虑收益性、流动性和风险性,选择低估值债券进行投资,并利用市场时机、无风险套利、利率预测等,争取债券投资的超额收益;利用现券回购所得资金适时参与新股申购及配售,以获得稳定的股票一级市场超额回报。 3.股票投资策略 本基金将严格按照CPPI 策略并结合M 值优化模型,动态调整风险资产比例。在风险资产中,本基金将精选具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票作为投资对象,力争最大限度获取基金资产增值。 4.权证投资策略 本基金权证投资将以价值分析为基础,在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稳健的超额收益。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	李芳菲
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	19,566,784.07
本期利润	9,773,332.82
加权平均基金份额本期利润	0.0172
本期基金份额净值增长率	1.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0257
期末基金资产净值	499,427,822.38
期末基金份额净值	1.026

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

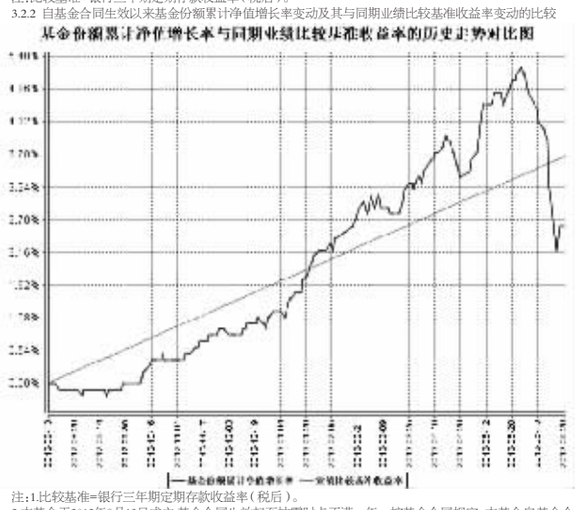
3.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.本基金于2012年8月13日成立,基金合同生效起至披露时点不满一年。

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率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-2.38%	0.25%	0.35%	0.02%	-2.73%	0.23%
过去三个月	-0.77%	0.18%	1.06%	0.01%	-1.83%	0.17%
过去六个月	1.38%	0.15%	2.11%	0.02%	-0.73%	0.13%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.11%	3.75%	0.01%	-1.15%	0.10%

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