

东吴优信稳健债券型证券投资基金

更新招募说明书摘要

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

重要提示

本基金根据 2008 年 8 月 15 日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴优信稳健债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】1048 号）的核准，进行募集。

基金管理人保证《东吴优信稳健债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险，此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。等等。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2009 年 11 月 05 日，有关财务数据和净值表现

截止日为 2009 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、其他有关规定及《东吴优信稳健债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”或“基金合同”)编写。

本招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

1. 名称: 东吴基金管理有限公司
2. 住所: 上海市浦东新区源深路 279 号(200135)
3. 办公地址: 上海市浦东新区源深路 279 号(200135)
4. 法定代表人: 徐建平
5. 成立日期: 2004 年 9 月 2 日
6. 批准设立机关及批准设立文号: 中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号
7. 组织形式: 有限责任公司(国内合资)
8. 注册资本: 1 亿元人民币
9. 联系人: 徐远征
10. 电话: (021) 50509888
11. 传真: (021) 50509884
12. 客户服务电话: 021-50509666
13. 公司网址: www.scfund.com.cn
14. 股权结构:

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券有限责任公司	4900	49%
上海兰生(集团)有限公司	3000	30%
江阴澄星实业集团有限公司	2100	21%
合 计	10,000	100%

15. 简要情况介绍:

东吴基金管理有限公司下设投资管理部、研究策划部、国际业务部、产品策略部、市场营销部、机构理财部、基金事务部、信息技术部、综合管理部和监察稽核部等 10 个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金, 于 2005 年 2 月 1 日基金合同生效, 托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第二只产品东吴价值成长双动力股票型证券投资基金, 于 2006 年 12 月 15 日基金合同生效, 托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动股票型证券投资基金, 于 2008 年 4 月 23 日基金合同生效, 托管行为华夏银行股份有限公司。公司已管理的第四只产品东吴优信稳健债券型证券投资基金, 于 2008 年 11 月 5 日基金合同生效, 托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第五只产品东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金, 于 2009 年 5 月 6 日基金合同生效, 托管行为中国农业银行股份有限公司。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

吴永敏先生, 董事长, 硕士研究生, 高级审计师、高级经济师, 中共党员。历任无锡县长征企业会计, 苏州市财政局科员、苏州市税务局副科长、苏州市税务局三分局局长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长。现任东吴证券有限责任公司党委书记、董事长。

徐建平先生, 董事, 大学, 会计师, 中共党员。历任张家港市财政局科长兼市房改办副主任, 苏州证券有限责任公司张家港杨舍证券营业部总经理、公司总经理助理兼资产管理总部总经理, 东吴证券有限责任公司副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

金燕萍女士, 董事, 大学, 高级政工师, 中共党员。历任上海外贸总公司党委委员、党委办公室副主任, 上海海外公司党总支书记, 上海广告公司党委副书记、副总经理, 上海实业(集团)有限公司办事处常务副主任、党总支书记。现任上海兰生(集团)有限公司总经理助理、投资管理部总经理。

陆宏伟先生, 董事, 研究生, 经济师, 中共党员。历任江苏省计划经济委员会副科长, 江苏省国际信托投资公司证券部经理, 信泰证券有限公司董事、常务副总经理。现任江苏澄

星实业集团有限公司常务副总经理。

王金来先生，董事，大学，经济师，中共党员。历任苏州市二轻局秘书，苏州市经济体制改革委员会副科长、处长、助理调研员，兼苏州市证券期货监督管理办公室证券处处长和苏州市企业上市工作办公室证券处处长，东吴证券有限责任公司投行总部副总经理。现任东吴证券有限责任公司董事会秘书。

戴继雄先生，董事，硕士，历任上海复星高科技（集团）有限公司财务、审计副总监，现担任上海兰生（集团）有限公司财务副总监、财务部总经理。

贝政新先生，独立董事，大学，教授。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

张平先生，独立董事，博士，研究员。现任中国社科院经济研究所研究员，兼职中央财经大学金融学院教授和江南信托经济学家。

陈如奇先生，独立董事，大专学历，中共党员，高级经济师，历任新疆人民银行巴州中心支行科员，新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长，交通银行上海分行处长、副行长，交通银行广州分行行长，交通银行香港分行总经理等职。现任光大证券有限责任公司独立董事。

2、监事会成员

马震亚先生，监事长，大学，会计师。历任苏州市审计局科员、副主任科员，苏州证券有限责任公司财务部总经理，东吴证券有限责任公司财务总监。现任东吴证券有限责任公司副总经理，中共东吴证券有限责任公司党委纪委书记，党委委员。

赵江先生，监事，大专，会计师。曾任中国船舶工业集团公司澄西船厂财务处会计科长，现任江阴澄星实业集团有限公司审计部经理、兼资产管理部经理。

王炯女士，员工监事，硕士学历。曾任大鹏证券研究所和投资部研究员、首席分析师助理、东吴基金管理有限公司基金经理助理等职，现任东吴基金管理有限公司投资总监，兼投资管理部总经理、东吴价值成长双动力基金基金经理、东吴进取策略灵活配置基金基金经理。

3、高管人员

吴永敏先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

徐建平先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

胡玉杰女士，副总经理，经济学硕士，历任大鹏证券有限责任公司营业部总经理、融资服务公司董事、副总经理；2004年9月任东吴基金管理有限公司市场总监职务；现任东吴基金管理有限公司副总经理。

吴威先生，督察长，经济学博士，历任兴业证券股份有限公司研究发展中心高级研究员、国际业务部负责人，兴业基金管理有限公司筹备组成员，兴业基金管理有限公司副总经理，日本野村证券北京代表处业务拓展总监。现任东吴基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

徐嵩先生，六年证券从业经验。历任平安信托投资责任有限公司资产管理部交易员，平安保险资产营运中心银行间交易员，上投摩根基金管理有限公司基金经理助理，2008年3月加入东吴基金管理有限公司，负责债券研究及交易。2008年11月担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

徐建平 总经理；

胡玉杰 副总经理（债券投资）；

王 炯 投资总监，兼投资管理部总经理、基金经理；

黎 瑛 研究策划部总经理；

陈 宪 首席策略规划师。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况：

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承

兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务

（二）基金托管业务主要人员情况：

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

截止到2009年9月30日，中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等7只封闭式证券投资基金，以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华一道琼斯88指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票（LOF）、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合（LOF）、华夏中小板ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票（LOF）、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票（LOF）、华宝兴业行业精选股票、

工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票（QDII）、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票（QDII）、海富通中国海外股票（QDII）、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信2026周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票（QDII）、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票（LOF）、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深300指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合、天治趋势精选灵活配置混合、中欧价值发现股票、长信恒利优势股票、民生加银增强收益债券、国联安主题驱动股票、宝盈货币市场基金、博时策略灵活配置混合、信诚优胜精选股票、易方达沪深300指数、中银中证100指数增强、鹏华精选成长股票、金元比联价值增长股票、诺德成长优势股票、摩根士丹利华鑫领先优势、华宝兴业中证100指数、华安上证180ETF联接基金、农银汇理策略价值股票基金等125只开放式证券投资基金。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1. 直销机构：

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：徐建平

联系人：徐远征

直销电话：（021）50509880

传真：(021) 50509884

客户服务电话：(021) 50509666

网站： www.scfund.com.cn

2. 代销机构：

(1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

联系人：王琳

电话：(010) 67596084

传真：(010) 66218888

客服电话：95533

网站：www.ccb.com

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100005)

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100005)

法定代表人：姜建清

联系人：田耕

电话：(010) 66106912

传真：(010) 66016904

客服电话：95588

网站：www.icbc.com.cn

(3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

联系人：蒋浩

电话：(010) 68424199

传真：(010) 68424181

客服电话：95599

网站：www.abchina.com

(4) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)

法定代表人：吴建

联系人：陈宇

传真：(010) 85238680

客户服务电话：95577

网站：www.hxb.com.cn

(5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客服电话：95559

网站：www.bankcomm.com

(6) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

联系人：金蕾

电话：010-65557013

传真：010-65550827

客服电话：95558

网站：www.bank.ecitic.com

(7) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

联系人：万丽

电话：(0755)83198888

传真：(0755) 83195049

客服电话：95555

网站：www.cmbchina.com

(8) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：弗兰克纽曼 (Frank Neil Newman)

联系人：张青

电话：0755-22166118

传真：0755-25841098

客服电话：95501

网站：www.sdb.com.cn

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：(010)58351666

传真：(010)83914283

客服电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

(10) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：010-66415194

网站：www.psbc.com

(11) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：(021) 63586210

传真：(021) 63586215

客服电话：96528，上海地区 962528

网站：www.nbcb.com.cn

(12) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

电话：0755-22197874

传真：0755-22197701

联系人：霍兆龙、蔡宇洲

客户服务电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

网站: www.pingan.com

(13) 温州银行股份有限公司

注册地址: 温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址: 温州市车站大道华海广场 1 号楼

法定代表人: 夏瑞洲

联系人: 林波

电话: 0577-88990082

传真: 0577-88995217

客户服务电话: 0577-96699

银行网站: www.wzbank.cn

(14) 东吴证券有限责任公司

注册地址: 苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人: 吴永敏

电话: 0512-65581136

传真: 0512-65588021

联系人: 方晓丹

客户服务电话: 0512-33396288

网站: www.dwzq.com.cn

(15) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客服电话: 021-95553

网站: www.htsec.com

(16) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：胡长生

电话：010-66568047

传真：010-66568536

联系人：李洋

客服电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

(17) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海常熟路 171 号

办公地址：上海常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：邓寒冰

客服电话：021-962505

网站：www.sw2000.com.cn

(18) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

客服电话：400-8888-108

网站：www.csc108.com

(19) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：沈东燮、黄岚

客户服务热线：95575

网站：www.gf.com.cn

(20) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-721

传真：025-84579879

联系人：樊昊

客服电话：025-84579897

网站：www.htsc.com.cn

(21) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳、谢高得

客服电话：400-8888-123

网站：www.xyzq.com

(22) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网站：www.guosen.com.cn

(23) 湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能大厦

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：钟康莺

客服电话：400-888-1551

网站：www.xcsc.com

(24) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

联系人：匡婷

客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888

网站：www.cgws.com

(25) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82833321

联系人：袁丽萍

客服电话：0510-82588168

网站：www.glsc.com.cn

(26) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62674109

联系人：芮敏祺

客服电话：400-8888-666

网站：www.gtja.com.

(27) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：刘军辉

客服电话：0755-83199511

网站：www.csc.com.cn

(28) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

联系人：盛宗凌

客服电话：400-8888-555

网站：www.lhzq.com

(29) 金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：(0755) 83025022

传真：(0755) 83025625

联系人：张萍

客服电话：4008-888-228

网站：www.jyzq.com.cn

(30) 东方证券有限责任公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：021-962506

网站：www.dfzq.com.cn

(31) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务热线：400-800-1001

网站：www.essence.com.cn

(32) 江南证券责任有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号江西教育出版社六楼

法定代表人：姚江涛

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

客户服务热线：0791-6781119

网站：www.scstock.com

(33) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客户服务热线：0731-84403350

网站：www.cfzq.com

(34) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507--1510 室

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：(0532) 85022026

传真：(0532) 85022026

联系人：丁韶燕

客服电话：(0532) 96577

网站：www.zxwt.com.cn

(35) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服电话：4008888788、10108998

网站：www.ebscn.com

(36) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861

传真：022-28451616

联系人：王兆权

客户服务电话：400-651-5988

公司网站：www.bhzq.com

(37) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39-40F

法定代表人：唐新宇

电话：(021) 68604866

传真：(021) 50372474

联系人：张静

客户服务电话：021-68604866

网站：www.bocichina.com

(38) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：黄健

客服电话：95565、400-8888-111

网站：www.newone.com.cn

(39) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：(0531) 81283728

传真：(0531) 81283735

联系人：傅咏梅

客服电话：95538

网站：www.qlzq.com.cn

(40) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客服电话：0471-4961259

网站：www.cnht.com.cn

(41) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207936

传真：0551-2207965

联系人：程维

客服电话：95578

网站：www.gyzq.com.cn

(42) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

电话：025-83364032

传真：025-83320066

联系人：徐翔

客服电话：400-828-5888

网站：www.njzq.com.cn

(43) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：李涛

客户服务热线：021-52574550 0519-88166222 0379-64902266

免费服务热线：400-888-8588

网站：www.longone.com.cn

(44) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026521

传真：0755-82026539

联系人：刘权

客户服务热线：400-600-8008

网站：www.cjis.cn

(45) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

客户服务热线：021-63340678

网站：www.ajzq.com

(46) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

联系人：莫晓丽

电话：010-66045529

传真：010-66045500

网站：www.txsec.com

(47) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：楼斯佳

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务热线：4008209898

网站：www.cnhbstock.com

(48) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：0755-82433794

客服热线：4008816168

网站：www.PINGAN.com

(49) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务热线：4008-888-999 或 027-85808318

网站：www.95579.com

(50) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

邮政编码：350003

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

网站：www.gfhfzq.com.cn

(51) 宏源证券股份有限公司（简称宏源证券）

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085344

客户服务热线：400-800-0562

网站：www.hysec.com

(52) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-88656100

传真：010-88656290

客服电话：400-800-8899

网站：www.cindasc.com

(二) 注册登记机构：东吴基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：徐建平

联系人：徐远征

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：021-50509666

网站：www.scfund.com.cn

(三) 律师事务所和经办律师

名称：北京市君泽君律师事务所

住所：北京东城区东四十条68号平安发展大厦3层

办公地址：北京东城区东四十条68号平安发展大厦3层

负责人：陶修明

电话：010-84085338

传真：010-84085858

经办律师：陈冲冲、余红征

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：江苏公证天业会计师事务所有限公司

注册地址：无锡市新区开发区旺庄路生活区

办公地址：中国苏州新市路130号宏基大厦五楼

法定代表人：张彩斌

经办注册会计师：叶水林 吕卫星

电话：0512-65260880

传真：0512-65186030

四、基金的名称

本基金名称：东吴优信稳健债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式债券型基金

六、基金的投资目标

本基金属于债券型基金，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。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、信用等级较高的企业债、公司债、次级债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、回购、央行票据、资产支持证券等，以及部分股票、权证等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于债券类资产(包括含权债券)的比例不低于基金资产净值的80%，投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票等中国证监会允许基金投资的其它金融工具比例合计不超过基金资产净值的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%。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品，将依据有关法律法规进行投资管理。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。

八、基金的投资策略

本基金是一只债券型基金，以债券投资为主，股票投资为辅原则构建和管理投资组合。对于债券投资，本基金通过对利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的分析，确定本基金债券组合久期和期限结构配置。债券选择上，本基金根据债券信用风险特征、到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析，并考虑债券流动性和操作策略，选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为债券投资的有益补充，主要采取自下而上的策略精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。

（一）债券投资策略

1、利率分析和债券组合久期确定

利率是债券投资重要影响因素，本基金将通过宏观经济和政策取向的分析，把握利率走势，为债券投资决策提供依据。

从理论与实践经验看，影响利率走势的因素主要有：1、宏观经济增长状况，主要衡量指标有GDP增速、工业增加值、固定资产投资增速、消费水平、贸易顺差程度；2、物价走势：CPI、PPI；3、货币供应量和信贷增速；4、国际主要经济体利率走势。本基金通过以上四个方面的综合分析，把握利率走势。

根据利率走势的判断结果，确定债券投资组合久期。在预期利率下降时，增加债券组合久期，提高债券价格上涨产生的收益；在预期利率上升时，减小债券组合久期，降低债券价格下跌产生的损失。

2、期限结构配置策略

本基金在确定债券组合久期之后，将结合收益率曲线变化的预测，通过分析和情景测试，确定短、中、长期三类债券的投资比例。具体而言：

通过考察市场收益率曲线的历史变动情况，并结合利率走势，把握收益率曲线变化趋势。在此基础上，本基金根据收益率曲线变动特征，在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择期限结构配置策略，据此确定本基金债券组合在短、中、长期三类不同期限结构的配置。

3、债券选择策略

在债券选择上，本基金，首先精选信用风险低的债券构建初选债券池。其次，选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。

1) 债券信用风险评级

随着我国债券市场的发展，具有信用风险的债券品种扩展迅速，并且银监会近期要求银行系统退出债券担保市场，进一步凸显了我国债券市场信用风险。与此同时，根据国内外债券市场经验表明，信用风险（如美国次级债危机）会造成债券投资重大损失。在信用风险逐步凸显的背景下，本基金为控制投资风险，参考其它信用评级机构对债券信用风险评级结果，同时结合东吴基金债券信用风险评级体系得出的评级结果，确定债券最终信用评级等级。本基金选择中长期债券不低于AA、短期债券不低于A-1（或相应的信用级别），同时纳入全部无信用风险债券，作为本基金初选债券池。东吴基金债券信用风险评级体系借鉴国内外信用评

级机构的评级方法，从企业现金流与债务匹配的角度把握企业信用状况。

2) 债券投资价值分析

在初选债券池基础上，本基金根据东吴基金债券投资价值分析体系，选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。东吴基金债券投资价值分析体系根据债券到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析，并考虑债券流动性溢价和操作策略进行构建的。具体做法是：

首先，计算各债券到期收益率；其次，计算剔除税率的到期收益率；第三，考虑信用利差的到期收益率。根据以上经税收和信用利差修正后的到期收益率大小，本基金对债券投资价值从大到小排序。第四，根据各债券流动性溢价水平，以及债券操作策略（如果采取买入持有操作策略，可以不考虑流动性问题），对以上债券投资价值排序进行优化，选择投资价值高的债券构建本基金债券投资组合。

（二）股票投资策略

本基金的股票投资作为债券投资的有益补充，以提高投资组合收益并适当分散风险。对于股票投资策略，本基金采取自下而上策略，精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。本基金优势企业是指具有明显竞争优势，并且未来能够实现持续增长。具体选股步骤是：

首先，本基金充分利用本基金管理人行业研究员的盈利预测数据，并结合国内研究机构做过盈利预测数据的上市公司，初步筛选出未来两年净利润复合增长率超过20%的上市公司的股票，作为“备选股票池（I）”。

其次，在“备选股票池（I）”基础上，根据东吴基金企业竞争优势评价体系精选具有竞争优势的上市公司股票作为“备选股票池（II）”。东吴基金企业竞争优势评价体系是根据波特的五种竞争力模型和价值链分析内容、以及企业能力理论和企业资源理论等构建的，用来评价上市公司的竞争优势和未来成长能力。东吴基金企业竞争优势评价体系具体包括以下五方面内容：战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势、资源及其它附加优势。行业研究员对不同竞争优势进行打分，并统计计算出上市公司竞争优势综合评分值=战略管理优势+技术优势+市场优势+管理运营优势+附加优势，作为上市公司竞争优势的评价。最后，精选竞争优势综合分值排名最靠前的上市公司股票作为“备选股票池（II）”。

第三，本基金根据内在价值和相对价值相结合的估值方法评估“备选股票池（II）”股票的投资价值，其中内在价值采取现金流贴现估值方法，相对价值评估主要采取PE、PB和PEG等指标。最后精选出“备选股票池（II）”中具有投资价值的股票作为本基金投资对象。

（三）新股申购策略

从我国未来证券市场的发展来看，新股发行仍然会保持一定的数量与规模，在目前的政策条件下，由于一、二级市场价差的存在，参与新股申购能够取得较高的固定收益。通过对过往新股发行上市的数据分析，我们发现，申购新股可获得股票市场无风险的固定收益。

本基金作为固定收益类产品，为获得目前股票市场存在的固定收益，将在充分研究新发股票基本面的前提下，参与新股的申购。

（四）投资决策流程

本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系，具体如下：

1、投资决策委员会：决策基金总体战略、资产配置、审议基金的债券（股票）池、对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策，就风险事项与风险管理委员会沟通；

2、基金经理：参与构建基金的债券（股票）池、提出资产配置方案、实施具体投资计划。基金经理必须严格按照《投资管理流程》进行操作，资产配置方案经投资决策委员会审议通过后，以《资产配置方案决议》的形式形成书面结果，作为基金经理投资操作的依据，同时给投资总监、风险控制部门等备案，以便监控。

3、集中交易室：执行基金经理的交易指令、反馈交易指令的执行情况、监督交易指令的合规合法性；

4、研究平台：构建债券（股票）池、为投资决策委员会提供投资决策咨询支持、为基金经理投资提供支持；

5、金融工程小组：通过对投资组合的跟踪与评估，为投资决策委员会和基金经理提供投资实际效果的反馈意见，以优化改进投资决策；

6、风险控制部门：由风险管理委员会、监察稽核部、绩效与风险评估小组等构成。监察稽核部对投资决策及实际投资进行全程监控，并定期和不定期向风险管理委员会提供风险事项报告；绩效与风险评估小组定期评估投资组合风险与收益水平，向风险管理委员会提供投资组合风险评估报告。风险管理委员会就风险事项和风险评估报告进行审议并与投资决策委员会沟通，以监控投资决策流程和各级决策权限的行使是否合法合规及科学合理。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数。

本基金债券投资比例为80%-100%，根据相关法律法规定义，本基金为债券型基金。由于

本基金股票投资只是作为债券投资的有益补充，比例相对较低，所以基金基准里就不考虑股票部分。由于本基金债券投资范围不仅包括国债，而且也包括企业债和金融债等，而中信标普全债指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数，能较好地反映本基金在债券方面的投资范围，所以本基金选择中信标普全债指数作为基金比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场变化情况及本基金的投资范围和投资策略，调整该基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金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。

十一、基金的投资组合报告

东吴优信稳健债券型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)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。

本基金的托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年10月23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。

1、截至2009年9月30日基金资产组合情况：

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,457,725.00	0.63
	其中：股票	2,457,725.00	0.63
2	固定收益投资	328,403,052.30	84.66
	其中：债券	328,403,052.30	84.66
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	52,239,797.79	13.47
6	其他资产	4,809,412.30	1.24
7	合计	387,909,987.39	100.00

2、截至2009年9月30日按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,378,945.00	0.62
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,353,000.00	0.61
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	25,945.00	0.01
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	67,000.00	0.02
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	11,780.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,457,725.00	0.64

3、截至 2009 年 9 月 30 日，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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000578	盐湖集团	100,000	2,353,000.00	0.61
2	300002	神州泰岳	1,000	58,000.00	0.02
3	300003	乐普医疗	500	14,500.00	0.00
4	601888	中国国旅	1,000	11,780.00	0.00
5	300004	南风股份	500	11,445.00	0.00
6	300010	立思辰	500	9,000.00	0.00

4、截至 2009 年 9 月 30 日，按券种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	24,691,000.00	6.40
2	央行票据	49,205,000.00	12.74
3	金融债券	229,624,000.00	59.47
	其中：政策性金融债	229,624,000.00	59.47

4	企业债券	9,779,600.00	2.53
5	企业短期融资券	9,973,000.00	2.58
6	可转债	5,130,452.30	1.33
7	其他	-	-
8	合计	328,403,052.30	85.06

5、截至 2009 年 9 月 30 日，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	070413	07农发13	300,000	30,087,000.00	7.79
2	060202	06国开02	300,000	30,027,000.00	7.78
3	070416	07农发16	300,000	30,021,000.00	7.78
4	080225	08国开25	300,000	29,934,000.00	7.75
5	0901043	09央票43	300,000	29,901,000.00	7.74

6、截至 2009 年 9 月 30 日，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。

7、截至 2009 年 9 月 30 日，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。

8、投资组合报告附注

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。

2) 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。

3) 截至 2009 年 9 月 30 日，其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,523,782.24
5	应收申购款	35,630.06

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,809,412.30

4) 截至 2009 年 9 月 30 日, 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	125709	唐钢转债	4,016,304.50	1.04

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300002	神州泰岳	58,000.00	0.02	新股未上市流通
2	300003	乐普医疗	14,500.00	0.00	新股未上市流通
3	601888	中国国旅	11,780.00	0.00	新股未上市流通
4	300004	南风股份	11,445.00	0.00	新股未上市流通
5	300010	立思辰	9,000.00	0.00	新股未上市流通

十二、基金的业绩

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,也不保证最低收益。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。

1. 东吴优信稳健基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

1) 东吴优信稳健债券基金 A

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
2008.11.05-2008.12.31	2.44%	0.17%	2.25%	0.11%	0.19%	0.06%
2009.01.01-2009.09.30	-0.24%	0.18%	-0.09%	0.07%	-0.15%	0.11%
2008.11.05-2009.09.30	2.20%	0.18%	2.15%	0.08%	0.05%	0.10%

注: 1.统计截至 2009 年 9 月 30 日, 比较基准=中信标普全债指数。

2. 本基金于 2009 年 6 月 15 日开始分为 A、C 两类

2) 东吴优信稳健债券基金 C

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
2009.06.15-2009.09.30	-0.09%	0.23%	-0.55%	0.05%	0.46%	0.18%

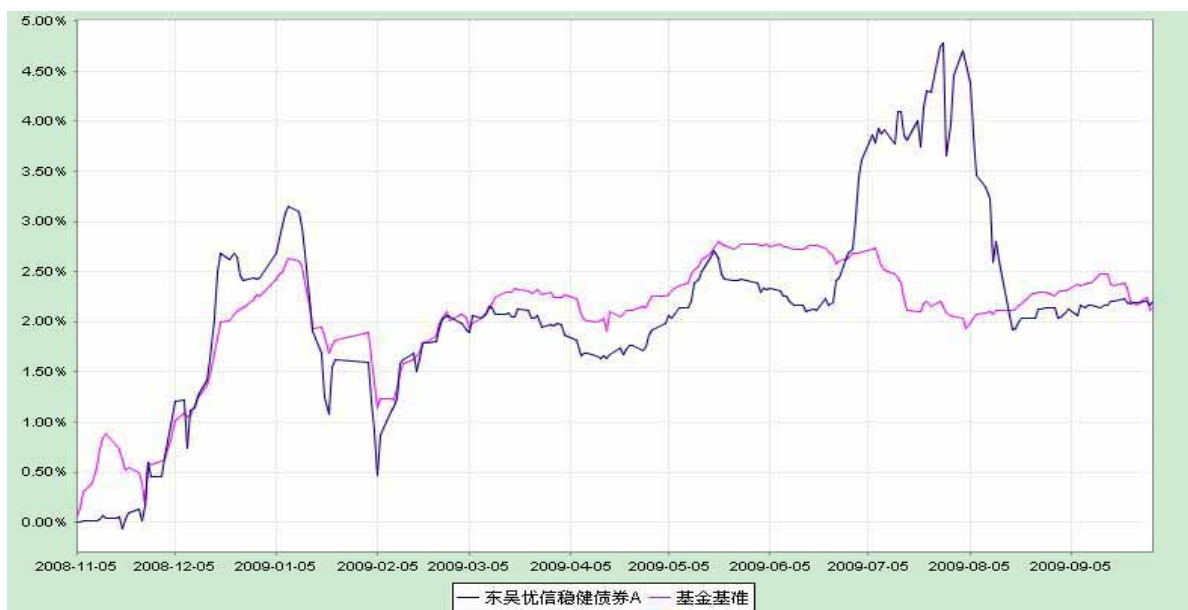
注: 1.统计截至 2009 年 9 月 30 日, 比较基准=中信标普全债指数。

2. 本基金于 2009 年 6 月 15 日开始分为 A、C 两类

2. 东吴优信稳健债券基金累计净值增长率历史走势图

1) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动进行比较(2008 年 11 月 05 日至 2009 年 9 月 30 日)

东吴优信稳健债券型证券投资基金 A



2) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较（2008年06月15日至2009年9月30日）

东吴优信稳健债券型证券投资基金 C



十三、费用概览

(一)基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；

2. 基金托管人的托管费；
3. 销售服务费
4. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(二)与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.65%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 销售服务费

本基金的 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额计提的销售服务费年费率为 0.4%。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整对 C 类各级基金份额计提的销售服务费率。销售服务费将专门用于本基金 C 类基金市场推广、销售以及为 C 类基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）与基金销售有关的费用

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的，称为 A 类；不收取认购或申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本公司旗下基金的投资者可通过本公司直销渠道和以下代销机构办理东吴优信稳健债券型证券投资基金的 C 类收费模式业务：

中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、东吴证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司。

本基金增加 C 类收费模式后，分别设置对应的基金代码，投资者申购时可以自主选择

与 A 类收费模式或 C 类收费模式对应的基金代码进行申购，A 类和 C 类收费模式的销售费率在下表分别列示：

1、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A 类收费模式（原有申购、赎回费率模式）

基金代码：前端（A 类）：582001

费用种类	申购金额 M	
前端申购费	M<100 万	0.8%
	100 万≤M<300 万	0.5%
	300 万≤M<500 万	0.25%
	500 万≤M	固定费用 1000 元
费用种类	持有年限 Y	
赎回费	Y<1 年	0.1%
	1 年≤Y<2 年	0.05%
	2 年≤Y	0%

2、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C 类收费模式（新增加的收费模式）

基金代码：582201

费用种类	费率
申购费率	0%
销售服务费（年）	0.4%（每日从基金资产计提）

费用种类	持有年限 Y	
赎回费	Y<60 天	0.1%
	Y≥60 天	0%

3、本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

5、转换费用

（1）本基金已开通与本基金管理人旗下基金：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金（基金代码：580001）、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）、东吴行业轮动股票型证券投资基金（基金代码：580003）、东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：580005）的基金转换业务。

基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务，并将另行公告。

（2）投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务：

中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、深圳发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民

生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、江南证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、齐鲁证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司。

(3) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转换公式如下：

1) 转出金额=转出基金份额×转出基金 T 日基金份额净值（此处的 T 日指基金转换申请日，下同）

2) 转出赎回费=转出金额×转出基金赎回费率（注：转出赎回费的 25% 将归入转出方基金的基金财产）

3) 转入金额=转出金额-转出赎回费

4) 如果，转出基金的申购费率 < 转入基金的申购费率，

申购补差费率=转入基金的申购费率-转出基金的申购费率

申购补差费=转入金额×申购补差费率 / (1+申购补差费率)

转入净额=转入金额-申购补差费

如果，转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率，

转入净额=转入金额

5) 转入份额=转入净额÷转入基金 T 日基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额为确定依据。

(4) 转出金额、转出基金转换费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转出基金资产中列支；转入份额、申购补差费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转入基金资产中列支。

(5) 对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基

金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为 0。

(6) 计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过基金管理人网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照基金管理人最新公告的相关费率计算基金转换费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”中，增加了风险提示内容，更新了“所载内容截止日期”及“有关财务数据和净值表现截止日期”。

2、在“三、基金管理人”中，对基金管理人简要情况进行了介绍，并对主要人员情况等内容进行了更新。

3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人情况及其托管业务经营情况进行了更新。

4、在“五、相关服务机构”中，增加了部分代销机构；

5、对“八、基金份额的申购与赎回”中，增加了关于销售服务费（C 类）的内容。

6、在“九、与基金管理人管理的其他基金转换”中，对本基金与本基金管理人管理的其他基金间的转换情况进行了更新。

7、在“十、基金的投资”中，更新了基金投资组合报告的内容。数据内容截止时间为 2009 年 9 月 30 日。

8、在“十一、基金的业绩”中，更新了基金业绩的内容。数据内容截止时间为 2009 年 9 月 30 日。

9、在“十四、基金的收益分配”中，更新了关于C类收费模式的收益分配内容。

10、在“十五、基金的费用与税收”中，增加了关于销售服务费的内容。

11、在“二十三、其他应披露事项”中，更新了其他披露事项：

1) 2009年05月06日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在联合证券有限责任公司推出定期定额申购费率优惠活动的公告》；

2) 2009年06月11日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于东吴优信稳健债券型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》

3) 2009年06月16日，在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为代销机构的公告》；

4) 2009年06月18日，在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金更新招募说明书—东吴基金管理有限公司2009年1号》及《东吴优信稳健债券型证券投资基金更新招募说明书摘要》；

5) 2009年06月19日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加华宝证券经纪有限责任公司为代销机构并开通定期定额业务的公告》；

6) 2009年06月23日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金第一次分红预告》；

7) 2009年06月24日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴优信稳健债券型基金C类收费模式新增代销机构的公告》；

8) 2009年06月29日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金第一次分红公告》；

9) 2009年07月13日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金开通定期定额申购业务和基金转换业务的公告》

10) 2009年07月21日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金2009年第2季度报告》

11) 2009年08月06日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加温州银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》

12) 2009年08月12日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴优信稳健债券型基金C类收费模式新增代销机构的公告》

13) 2009年08月13日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金关于旗下基金增加长江证券为代销机构并推出定期定额投资业务及转换业务的公告》；

14) 2009年08月27日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金2009年半年度报告》及《东吴优信稳健债券型证券投资基金2009年

半年度报告摘要》;

15) 2009年09月07日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加农行网银申购费率优惠的公告摘要》;

16) 2009年09月08日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司参与齐鲁证券对开放式基金申购网上交易费率进行优惠的补充公告》;

17) 2009年09月23日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金投资创业板证券的公告》;

18) 2009年09月29日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金关于旗下基金新增广发华福证券为代销机构并推出定期定额业务及转换业务同时参与网上交易申购费率优惠的公告》;

19) 2009年10月22日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在湘财证券有限责任公司推出定期定额投资业务的公告》;

20) 2009年10月22日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加宏源证券股份有限公司为代销机构并开通转换业务的公告》;

21) 2009年10月28日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金2009年第3季度报告》

22) 2009年11月04日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加信达证券股份有限公司为代销机构并开通转换业务的公告》;

东吴基金管理有限公司

二零零九年十一月五日