

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
送出日期:二〇一六年三月二十六日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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。 本年度报告及其摘要之正文及与上述信息相关的内容,均由基金管理人平安银行股份有限公司根据基金合同编制,于2016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。
本报告旨在提供真实信息,帮助投资者了解基金管理人运用基金资产,但不保证基金本金一定盈利。基金的投资价值及未来表现其未来表现。 投资者应了解,投资者在作出投资决策前须仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告自2016年01月01日起至2016年12月31日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金
基金简称	东吴转债分级
代码	501009
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日期	2015年01月01日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日期	2015年01月01日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日期	2015年01月01日

2.2 基金主要财务指标

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.3 基金管理人、基金托管人、基金销售机构

基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	平安银行股份有限公司
基金销售机构	平安银行股份有限公司	基金销售机构	平安银行股份有限公司

2.4 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.5 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.6 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.7 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.8 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.9 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.10 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.11 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.12 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.13 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.14 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.15 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.16 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.17 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.18 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.19 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.20 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.21 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.22 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.23 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.24 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.25 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.26 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.27 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.28 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.29 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.30 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.31 基金业绩表现

项目	2015年12月31日	2015年9月30日	2015年6月30日	2015年3月31日
资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
负债	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
净资产	0.00	0.00	0.00	0.00

2.32 基金业绩表现

||
||
||