

东吴增利债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期: 二〇一九年四月二十一日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售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责任。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中所列资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金资产概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额净值.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年1月1日至2019年3月31日), 报告期末基金份额净值, 报告期末基金份额总额.

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。

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

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率(基准), 净值增长率(基金), 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④.

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本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:比较基准=中国债券综合全价指数。

基金经理

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明.

注:1. 此处的任职日期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。
3. 2019年1月1日起,本基金管理人聘任王宏斌为东吴增利债券型证券投资基金基金经理,自2019年1月1日起担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理,自2019年4月1日起担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理。

投资组合

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

Table with 4 columns: 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(%)

5.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 4 columns: 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(%)

5.6 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资产支持证券投资明细

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8 报告期末持有的其他权证

5.9 报告期末持有的其他金融工具

5.10 报告期末持有的其他金融工具

5.11 报告期末持有的其他金融工具

5.12 报告期末持有的其他金融工具

5.13 报告期末持有的其他金融工具

5.14 报告期末持有的其他金融工具

5.15 报告期末持有的其他金融工具

5.16 报告期末持有的其他金融工具

5.17 报告期末持有的其他金融工具

5.18 报告期末持有的其他金融工具

5.19 报告期末持有的其他金融工具

5.20 报告期末持有的其他金融工具

5.21 报告期末持有的其他金融工具

5.22 报告期末持有的其他金融工具

5.23 报告期末持有的其他金融工具

5.24 报告期末持有的其他金融工具

5.25 报告期末持有的其他金融工具

5.26 报告期末持有的其他金融工具

5.27 报告期末持有的其他金融工具

5.28 报告期末持有的其他金融工具

5.29 报告期末持有的其他金融工具

5.30 报告期末持有的其他金融工具

5.31 报告期末持有的其他金融工具

5.32 报告期末持有的其他金融工具

5.33 报告期末持有的其他金融工具

5.34 报告期末持有的其他金融工具

5.35 报告期末持有的其他金融工具

5.36 报告期末持有的其他金融工具

5.37 报告期末持有的其他金融工具

5.38 报告期末持有的其他金融工具

5.39 报告期末持有的其他金融工具

5.40 报告期末持有的其他金融工具

5.41 报告期末持有的其他金融工具

5.42 报告期末持有的其他金融工具

5.43 报告期末持有的其他金融工具

5.44 报告期末持有的其他金融工具

5.45 报告期末持有的其他金融工具

5.46 报告期末持有的其他金融工具

5.47 报告期末持有的其他金融工具

5.48 报告期末持有的其他金融工具

5.49 报告期末持有的其他金融工具

5.50 报告期末持有的其他金融工具

5.51 报告期末持有的其他金融工具

5.52 报告期末持有的其他金融工具

5.53 报告期末持有的其他金融工具

5.54 报告期末持有的其他金融工具

5.55 报告期末持有的其他金融工具

5.56 报告期末持有的其他金融工具

5.57 报告期末持有的其他金融工具

本基金资产配置: 利率债和高信用等级信用债为主。

45 报告期末基金的业绩表现

截至本报告期末,东吴增利债券A的净值为1.134元,累计净值1.474元;本报告份额净值增长率为1.26%,同期业绩比较基准收益率为0.47%;东吴增利债券C的净值为1.123元,累计净值1.453元,本报告份额净值增长率为1.20%,同期业绩比较基准收益率为0.47%。

46 报告期末基金持有人数量或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内,未出现连续2个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

基金资产概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

Table with 4 columns: 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(%)

5.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 4 columns: 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(%)

5.6 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资产支持证券投资明细

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8 报告期末持有的其他权证

5.9 报告期末持有的其他金融工具

5.10 报告期末持有的其他金融工具

5.11 报告期末持有的其他金融工具

5.12 报告期末持有的其他金融工具

5.13 报告期末持有的其他金融工具

5.14 报告期末持有的其他金融工具

5.15 报告期末持有的其他金融工具

5.16 报告期末持有的其他金融工具

5.17 报告期末持有的其他金融工具

5.18 报告期末持有的其他金融工具

5.19 报告期末持有的其他金融工具

5.20 报告期末持有的其他金融工具

5.21 报告期末持有的其他金融工具

5.22 报告期末持有的其他金融工具

5.23 报告期末持有的其他金融工具

5.24 报告期末持有的其他金融工具

5.25 报告期末持有的其他金融工具

5.26 报告期末持有的其他金融工具

5.27 报告期末持有的其他金融工具

5.28 报告期末持有的其他金融工具

5.29 报告期末持有的其他金融工具

5.30 报告期末持有的其他金融工具

5.31 报告期末持有的其他金融工具

5.32 报告期末持有的其他金融工具

5.33 报告期末持有的其他金融工具

5.34 报告期末持有的其他金融工具

5.35 报告期末持有的其他金融工具

5.36 报告期末持有的其他金融工具

5.37 报告期末持有的其他金融工具

5.38 报告期末持有的其他金融工具

5.39 报告期末持有的其他金融工具

5.40 报告期末持有的其他金融工具

5.41 报告期末持有的其他金融工具

5.42 报告期末持有的其他金融工具

5.43 报告期末持有的其他金融工具

5.44 报告期末持有的其他金融工具

5.45 报告期末持有的其他金融工具

5.46 报告期末持有的其他金融工具

5.47 报告期末持有的其他金融工具

5.48 报告期末持有的其他金融工具

5.49 报告期末持有的其他金融工具

5.50 报告期末持有的其他金融工具

5.51 报告期末持有的其他金融工具

5.52 报告期末持有的其他金融工具

5.53 报告期末持有的其他金融工具

5.54 报告期末持有的其他金融工具

5.55 报告期末持有的其他金融工具

5.56 报告期末持有的其他金融工具

5.57 报告期末持有的其他金融工具

5.58 报告期末持有的其他金融工具

5.59 报告期末持有的其他金融工具

5.60 报告期末持有的其他金融工具

5.61 报告期末持有的其他金融工具

5.62 报告期末持有的其他金融工具

5.63 报告期末持有的其他金融工具

5.64 报告期末持有的其他金融工具

5.65 报告期末持有的其他金融工具

5.66 报告期末持有的其他金融工具

5.67 报告期末持有的其他金融工具

5.68 报告期末持有的其他金融工具

5.69 报告期末持有的其他金融工具

5.70 报告期末持有的其他金融工具

5.71 报告期末持有的其他金融工具

5.72 报告期末持有的其他金融工具

5.73 报告期末持有的其他金融工具

本基金本报告期末持有资产支持证券。

6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

6.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.9.1 本期国债期货投资政策

6.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

6.9.3 本期国债期货投资评价

6.10 股指期货投资政策

6.10.1 本基金股指期货前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

6.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库的情况说明

6.10.3 其他投资说明

6.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

6.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6.10.6 股指期货投资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。

开放式基金份额变动

单位:份

Table with 2 columns: 项目, 基金份额

8.1 本报告期间基金份额变动情况

8.2 本报告期间基金份额变动情况

8.3 本报告期间基金份额变动情况

8.4 本报告期间基金份额变动情况

8.5 本报告期间基金份额变动情况

8.6 本报告期间基金份额变动情况

8.7 本报告期间基金份额变动情况

8.8 本报告期间基金份额变动情况

8.9 本报告期间基金份额变动情况

8.10 本报告期间基金份额变动情况

8.11 本报告期间基金份额变动情况

8.12 本报告期间基金份额变动情况

8.13 本报告期间基金份额变动情况

8.14 本报告期间基金份额变动情况

8.15 本报告期间基金份额变动情况

8.16 本报告期间基金份额变动情况

8.17 本报告期间基金份额变动情况

8.18 本报告期间基金份额变动情况

8.19 本报告期间基金份额变动情况

8.20 本报告期间基金份额变动情况

8.21 本报告期间基金份额变动情况

8.22 本报告期间基金份额变动情况

8.23 本报告期间基金份额变动情况

8.24 本报告期间基金份额变动情况

8.25 本报告期间基金份额变动情况

8.26 本报告期间基金份额变动情况

8.27 本报告期间基金份额变动情况

8.28 本报告期间基金份额变动情况

8.29 本报告期间基金份额变动情况

8.30 本报告期间基金份额变动情况

8.31 本报告期间基金份额变动情况

8.32 本报告期间基金份额变动情况

8.33 本报告期间基金份额变动情况

8.34 本报告期间基金份额变动情况

8.35 本报告期间基金份额变动情况

8.36 本报告期间基金份额变动情况

8.37 本报告期间基金份额变动情况

8.38 本报告期间基金份额变动情况

8.39 本报告期间基金份额变动情况

8.40 本报告期间基金份额变动情况

8.41 本报告期间基金份额变动情况

8.42 本报告期间基金份额变动情况

8.43 本报告期间基金份额变动情况

8.44 本报告期间基金份额变动情况

8.45 本报告期间基金份额变动情况

8.46 本报告期间基金份额变动情况

8.47 本报告期间基金份额变动情况

8.48 本报告期间基金份额变动情况

8.49 本报告期间基金份额变动情况

8.50 本报告期间基金份额变动情况

8.51 本报告期间基金份额变动情况

8.52 本报告期间基金份额变动情况

8.53 本报告期间基金份额变动情况

8.54 本报告期间基金份额变动情况

8.55 本报告期间基金份额变动情况

8.56 本报告期间基金份额变动情况

8.57 本报告期间基金份额变动情况

8.58 本报告期间基金份额变动情况

8.59 本报告期间基金份额变动情况

8.60 本报告期间基金份额变动情况

8.61 本报告期间基金份额变动情况

8.62 本报告期间基金份额变动情况

8.63 本报告期间基金份额变动情况

8.64 本报告期间基金份额变动情况

8.65 本报告期间基金份额变动情况

8.66 本报告期间基金份额变动情况

东吴增利债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期: 二〇一九年四月二十一日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售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责任。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。