國证券報	信息披露 Discl	2011KO	■ 2015年1月21日 星期三   <b>B029</b>
	BISCIO	osure	
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: 二〇一五年一月二十一日	东吴增利债券	型证券投资基金	本基金本报告期末未持有权证。 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.9.1 本期国债期货投资政策 本基金水报告期末投资国债期货。 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金水报告期末发生有国债期货
\$1 重要批示	注:1.比较届准—中国债券综合企价指数。  2.本基金于2011年7月最近。  4.1 基金於理(或基金於理小班)	率出现急涨,信用利差也快速扩大。     本基金资产配置,降低仓位、防范风险。待调整后适时加仓。     4.42 报告前即为基金的业绩表现     第左本标告的果,东吴通州创债外公价额净值为1.143元,累计净值1.183元;本报告期份额净值增长率 1.57%。间别组就比较基础收益率为1.108%;东边即利债券公价额净值为1.128元,累计净值1.165元;本报告     第6	本基金本报告期末处资国债明价度。 5.03 本期的债明货投资评价 本基金包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,或在报告编制目前一年内受到人开疆对。处罚的消形。 5.10 投资经合款信的样。 5.10.3 其他资产构成  ———————————————————————————————————
东吴中证可转换债券	<b>省数分级证券投资基金</b>	东吴中证新兴产业	指数证券投资基金
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 报告签出日期; 二〇一五年一月二十一日 5.1 面型提示 报告签出日期; 二〇一五年一月二十一日 5.1 面型提示 据金管理人的董单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 和完整性"强化"列及革带责任。 基金进行"列及革带责任,从全年特别及"司根报本基金合同规定"于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现 基金管理人或证以规定信用,勤勉是责防税则管理和运用基金营产。但不保证基金一定盈利。 基金管理人或证以规定信用,勤勉是责防税则管理和运用基金营产。但不保证基金一定盈利。 基金管理人或证以规定信用,数处是防税则管理和运用基金营产。但不保证基金一定盈利。 本报告申财务资料未经审计。本报告申财务资料未经审计。本报告申财务资料未经制,企业公司,以资有风险,投资者在中出投资决策前应行相阅读本基金的招募说明书。本报告申财务资料未经审计。本报告申财务资料未经审计。 基金盈序 东吴转馈 基金主代码 165809 五级金产品概况 基金盈价方式 契约度开放式 36000000000000000000000000000000000000	随着年度业绩预告与年报的发布,部分公司债也会受到影响。 4.6 报告期户基金持有人效或基金资产净值预暂识别	基金性智人,中国灾业银行股份有限公司 报合性智人,中国灾业银行股份有限公司 报合营理人的確求会及董卓征本报告所载资料不存在整型起载、误停性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性 现在分别及某情形式。 现在分别是不存在整印或,是一个一个	N   水利,环境和公共设施管理业
下属三级基金的基金的称 东吴转债 可转债A 可转债B 下属三级基金的场内简称 东吴转债 可转债A 可转债B	8 X他 9 会计 134.017.917.97 106.21	1.本期已实现收益 89,580,727.17 2.本期利润 54,034,431.54	5.3 报告期末接处介价值占基金竞产净值比例大小排序的前十全股票投资明和 5.3 报告期末指数投资接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和 占基金资产净值比例

4.期末基金资产净值

设告期末下属三级基金的份: 83,878,607.46份 27,078,177.00份 11,604,934.00份 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 可转债A 份額为约定收 協,将表现出預期低风险、 資期收益相对稳定的明显 章經 可转债B 份额获得产品 剩余收益,带有适当的标 113005 24,715,735.8 民生转债 110023 14,613,756.3 3.1 主要财务指标 本建立中级古男外来特别广义村业产种信息作员大小排序的前五名贵金属投资明维 本基金本报告期末未特有价金属。 各 报告期末状合有价金属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特有权配。 59 报告期末未基金投资的股捐期货交易情况说明 591 报告期末未基金投资的股捐期货仓利撤益明细 本基金本报告期末共特有股份股捐期货仓利撤益明细 本基金本报告期末共均股捐制的货。 592 本基金投资股捐制度的投资废 本基金本报告期未投资股捐制度的投资废 本基金本报告期未投资股捐制度的发验 5101 在期间的财投资废价 大量企业报告期未投资股捐制度的发验 (5101 和明期未基金股资的国债制度经验情况说明 5102 报告期末本基金股资的国债制度经验 本基金本报告期未投资的国债制度经 本基金本报告期未投资股间的财资。 5103 本期国值则的投资资金 5103 本期国值则的投资资金 5103 本期国值则的投资资金 本基金和报告期末未基金股份国债制度 期末基金资产净值 126,176,702.10 5.则来基金份额净值 1.029 注:1.本期已实现收益相基金本明利息收入、投资收益·其使收入(不含公允价值变对收益)和除相关费用后的。 扫削剂为本期已实现收益加上本明公允价值变对收益。 2.上述基金业使指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实诉收益水平要低于所列数字。 2.基金净值数2. 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 
 净值增长率()
 净值增长率标准差
 业绩比较基准收益率()

 ()
 ()
 本維蓝本板它網水送效阻侧则成。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1 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 过去三个月 42.12% 1.84% 注:本基金业绩比较基准=中证可转换债券指3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其 到的情形。 5.11.2 本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。 基金长领等计论值增长率与同剧化镇比较起降收益率值历史北势对比例 序号 1 存出保证金 4 其他应收款5 持维费用 占基金资产净值比例(%) 民生转债 110023 14,613,756.3 可转债A与可转债B基金位额配比 |末可转债A份額参考 110017 中海转债 3,141,477.6 1.039 110018 国电转债 2,024,393. 中皿 期末可转债B份额参考净 期末可转债B份额累计参 净值 125089 2.472 歌华转债 110011 1,002,985.20 128005 110022 齐翔转债 同仁转债 海运转债

サニ 报告期末可转债A的預计 收益率 5.75% 可转债A约定年收益率= 姓名 职务 证券从业年限 说明 本基金基金 经理、公司团 定收益部总 杨庆定 2014年5月9日

建。 注:1.杨庆定为该基金的首任基金经理,此处所任职日期为基金成立日; 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》和关规定。 4.2 管理人对托告朋内本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》,中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》,中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规 、本着诚实信用、勤勉尽费的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。 4.3 公平交易专项规则

204年8年8月7日10日即国辖欧北海军下行约36BP,债券市场继续走强。 者42 程长时以基金的业绩表现 查查未报告期末,本基金份额单值为1029元,累计净值1469元;本报告期份额净值增长率4212%,同期业绩比较基 使放益率为4099%。

9.1 备查文件目录 1.中国证监会批准东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金设立的文件; 2.《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同); 3.《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议); 4.基金管型人业务资格批准、营业此解和公司章程; 5.报告期内东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。 92. 存放地点 92 存成地点 基金管理人处、基金托管人处。

110012 128006 110019

126729

设告期期初基金份额总额

无。

告期期间基金总申购份额

告期期间基金拆分变动份额(份额)

9.3 查阅方式 投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。 18设有可任基金自是人各进门间外光度复构。 网络:http://www.scfund.com.cn 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。 客户服务中心电话(021)50509666 / 400-821-0588

长青转债

恒丰转债 燕京转债

38,822,881.

§ 9 备查文件目录

100,843.7

19 128002 5.11.5 报告期末前子名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末未转有股票。 5.11.6 投资组合报告附注的其他文学描述部分 由于四含五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 § 6 开放式基金份额变动

报告期期末基金份额总额 1、如果本报告期间发生转换人、红利再投业务,则总申购份额

在: 13444年以下前の北京大学大・15人前で放出す。60年中初の本で50米近方:
2 如果木材を前間及生物表址であ。例2数回的都中位含数速方。
3 报告期间形分 安市包括日常形分合并和所寫: 生的分额变动。
7 基金管理人大時有本基金份额变功情况
基金管理人大時有本基金份额变功情况
基金管理人大時有本基金份额变功情况

基金管理人未持有本基金份额。 72. 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。 § 8 影响投资者决策的其他重要信息 无

48,415.7

1,418,641.0

25,659,536.0

10,996,944.

东吴基金管理有限公司 2015年1月21日

2012年5月3日 (22): 其次区河上时间期间期间时间对前分司货外公营之日。 之证券业业的仓业规则不由企业规则,在市场企业从业人加票格管理办法》和关规定。 4.2 管理人对核分期内本基金油作题报写信格劢的原则 本程度期内、本基金管理人严格展示 (证券投票基金): 中国证监企的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定,本着城实信 幼规足班的原则管理和证用基金资产,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。 4.2 公平交易使可视则 《石》次平安易參與說明 4.31、公平受制度的执行情况 本报告期以,本基金管理,从原照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对所管理的不同投资 本报告期以,本基金管理,从原则可管据的不同党度组合在废权。研究分析,投资成果,交易执行,业绩评估等投资管理活动和和节得弱 形好物。
4.423 异常文制行为的专项说明
本报告期对,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
本报告期对,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.4 报偿期内基金投资资格和业绩未发现说明
4.4 报信期内基金投资资格和运行分析
四季度。国内文家经济存在商品、免疫需要人格下滑,制造业PMI用度回路等6.0以下,微观数据也显示宏体经济继续偏软,所以中央
PCI工作会区区形构制经验的进程从外方面一类形,因为企图和过程,以自分开始上述可能放映。但是在货币的股次间度的背景下,非常是于
期间以及常定体系统,然而设备的现象对策,和对金融值上,共享增强的人以金融经济人民的现金信息和发展,而对辖较过度。
从货用的人工的工程,由于中国条件就是由所发现的人类的企业。
从货用的人工的工程,并可能会是有效。

《报告期中国条件》,是一个专业人工程,是一个专业工程,是一个工程,工程,是一个工程,是一 (1895年)。 442 报告期内基金的业绩表现 截至本报告期末,本基金份额净值为1.020元,累计净值1.020元;本报告期份额净值增长率6.69%,同期业绩比较基准收益率为 他至小玩官到来,各些宣师审理。[313.07]。其下曾且13.07]。在《古即的歌中担语》中50.05%。词则建则以北德德化战争为[4]。 4.16 管理人对张宏统,证券市场产于业市的价值要限 从2008年以来,中国经济区和密建和储在增速都在逐渐下消,44年下半年以来更是显现经济增长动力不足。通常风险升温的局 中央经济工作会议国的提升了《设置代价理要性。但在实现经济托度,而由未来调查特别的增能加强。2016以该会是规模里于进度 中央设计划,实现实现的方向设计发生变化。一步现代广东。第5个"企"一定全个编码"自设金机力",直然形成全场推翻的快速 2.05。以为《成场代价发动机》,如明年,该本市场级相位经元分级更了投资价价水资明,请市面的国际发生。这种场外不能成决。在 提供同时间隔,然后就是对分价值的完成。中长时度发布值显现,我们人类较有的不成相价的原理。还是这种场外不能成决。在 提供同时间的概点,就是是是是一个 5.1 报告期末基金资产组合情况 序号 项 611,676,434.5 其中:债券 10,014,000.0 4 金融衍生品投 2,509,671.07 11,664,704.89 451,852,398.4 69.45 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 E 建筑业 F 批发和零售业 G 交通运输、仓储和 H 住宿和餐饮业

80,626,538.24

12.39

7.45%

1.29%

:期公允价值变动收益。 排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。

净值增长率标准差 业绩比较基准 收益率③

並全部個累計中化著作率与利利电池比較某**准收益率的**历史之势以比例

+5%\*银行同业存款利率 § 4 管理人报告

任职日期 富任日期

金净值表现 本报告期基金份額净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

净值增长率①

注:业绩比较基准=95%\*中证新兴产业指数收益率

本基金基金 <sup>各理</sup>

I 信息传输、软件和信息技术服务业

M 科学研究和技术服:

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名

426,100.

5,342,627.2

9,248,441.6 北新建材 7,286,429.1 7,274,124.00 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 6 中期票据 7 可转债 8 其他 · 允价值占基金资产净值比例> 序号 公允价值(元) 债券代码 债券名称 数量(张) 11.1 V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 5.11.2 本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 5.11.3 其他资产构成 61,804.0 应收证券清算款

股票代码 股票名称 流通受限情况说明 序号 股票代的 1 600458 时代新材 8,817,199.41 5.116 投资组合报告附注的其他文字描述即 1 由于网查五人的原因,外项之和与合计项之间可能存在尾差。 5.6 开放式基金份额变动 报告期期间基金总申购份额 110,137,649. 报告期期间基金拆分变动份额(代 638,190,382.10

报告期期末基金份額息額 注;, 1 與其保質問題支建較長, 红利與投业务, 則是申略份額中包含该业务份額; 2. 如果本报告期间发生转换出业务, 則是據四份鄉中包含该业务份额。 57 基金管理人与有本基金价额设力情况 基金管理人与有本基金价额或力情况 基金管理人与有本基金价额。 7.2 基金管理人与国国有资金投资本基金全资基金编码。 5.8 等等投资者决策的其他重要信息 无。 5.8 等等投资者决策的其他重要信息 § 9 备查文件目录

5 应收申购款 6 其他应收款 7 待摊费用

50 备查文件目录
11 备查文件目录
1中国证监会批准东吴中证新兴产业指数证券投资基金设立的文件;
2. 作吴中证新兴产业指数证券投资基金全合同);
3. 任吴中证新兴产业指数证券投资基金在管制以);
4. 基金营配,从全身接往件、差块地跟和公司营起。
起发告期7年吴中证新兴产业指数证券投资基金在指定规刊上各项公告的原稿。
5. 提合期7年吴中证新兴产业指数证券投资基金在指定规刊上各项公告的原稿。 92. 存放地点 基金管理人处、基金托管人处。 93. 查阅方式 投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅

网站:http://www.scfund.com.cn 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司 客户服务中心电话(021)50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司 2015年1月21日

146,786.8