东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

【2015】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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§1 重要提示

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月14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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴转债		
场内简称	东吴转债		
基金主代码	165809		
交易代码	165809		
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	2014年5月9日		
报告期末基金份额总额	755,318,232.66份		
投资目标	本基金为债券型指数证券投资基金,采用优化复制法的投资策略,按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金为债券指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。		
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%		
风险收益特征	本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。		
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		
下属分级基金的基金简称	可转债A	可转债B	东吴转债
下属分级基金的场内简称	可转债A	可转债B	东吴转债
下属分级基金的交易代码	150164	150165	165809
报告期末下属分级基金的份额总额	467,481,343.00份	200,349,148.00份	87,487,741.66份
下属分级基金的风险收益特征	可转债A份额为约定收益,将表现出预期低风险、预期收益相对稳定的明显特征	可转债B份额获得产品剩余收益,带有适当的杠杆效应,表现出预期风险高、预期收益高的显著特征。	东吴转债是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 – 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	–23,526,708.99
2.本期利润	–30,659,203.10
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0528
4.期末基金资产净值	760,903,314.23
5.期末基金份额净值	1.007

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。

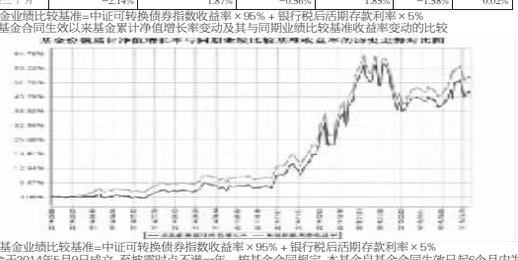
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	–2.14%	1.87%	–0.56%	1.85%	–1.58%	0.02%

注:本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

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与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

2、本基金于2014年5月9日成立,至披露时点不满一年。按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期(2015年1月1日 – 2015年3月31日)
可转债A与可转债B基金份额配比	7:3
期末可转债A份额参考净值	1.014
期末可转债A份额累计参考净值	1.053
期末可转债B份额参考净值	0.991
期末可转债B份额累计参考净值	2.366
报告期末可转债A的预计年收益率	0.0575

注:可转债A约定年收益率=一年期银行定期存款年利率(税后)+3.0%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨庆定	本基金基金经理、公司固定收益部总经理	2014年5月9日	–	9.5年	博士,上海交通大学管理学专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理,上海证券有限公司高级经理,太平资产管理有限公司高级投资经理;2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理;2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司,现担任公司固定收益部总经理,东吴集利分级债券型证券投资基金基金经理,东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金,东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理,东吴保本混合型证券投资基金基金经理。

注:1、杨庆定为该基金的首任基金经理,此处的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》相关规定。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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定,本着诚实信用、勤勉尽责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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人按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组合同向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场来看,2015年1月至2月,债券市场在经济预期较为悲观、财政与货币政策取向仍不明晰以及权益市场调整的背景下,延续了去年以来的上涨,由于资金价格持续偏高,收益率曲线呈现明显的平坦化,去年12月中证登企业债质押回购新规的事件性影响也逐步消退,信用利差持续收窄;而3月以来,在金融数据持续改善,以及地方政府债务置换等系列措施出台后,市场对债券供给压力及“保增长”力度的担忧上升,同时权益市场全面走强对资金也产生了明显的分流影响,债券收益率开始大幅波动上行,截至3月末,10年期国开金融债收益率已基本相当于去年12月中旬水平。

权益市场来看,去年来大盘蓝筹股大幅上涨后,今年初监管层通过规范“两融”等方式防控风险,随团大盘明显调整,2月中旬再度重启上涨;创业板的上涨则贯穿整个1季度。

转债市场来看,去年来多数转债估值水平较高,在年初权益市场调整背景下,以及超大规模的强制赎回压力下,转债估值水平明显压缩,转债跑输正股。

本基金在严格按照基金合同约定执行投资操作,较好地跟踪了标的指数,为投资者实现了较好的收益。

4.4.2 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1.007元,累计净值1.447元;本报告期份额净值增长率–2.14%,同期业绩比较基准收益率为–0.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年经济基本面偏弱,经济下行压力较大已经成为共识。年初以来,各项“稳增长”举措不断出台,包括盘活存量资金、批复重大基建项目和稳定房地产市场等,并以降准降息等货币政策作为配合,同时通过债务置换等方式逐步实现债务结构的优化,降低社会融资成本并化解地方政府债务风险。因此在稳增长、降成本与控风险多重举措下,经济加速下行预期减弱。

从转债市场来看,目前存量转债仅有500余亿元,过半转债已经触发或正在触发赎回,还有转债将于2季度进入赎回触发窗口期,而转债供给短期难以跟上,因此2季度转债市场仍将面临规模的下降。在权益市场调整、强制赎回“天花板”和摊薄压力的影响下,部分转债品种估值可能出现阶段性的波动下行,但估值压缩至合理水平后弹性也将增强。另外,一级市场新发转债预计仍将有较好收益。我们将基于对市场环境的客观判断,密切跟踪中证转债指数,并对仓位进行合理控制,努力把握市场机会,为投资者争取良好的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内,未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	754,126,192.80	93.50
	其中:债券	754,126,192.80	93.50
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	49,670,637.67	6.16
7	其他资产	2,786,130.48	0.35
8	合计	806,582,960.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券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	499,650.00	0.07
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	4,051.50	0.00
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	753,620,791.50	99.04
8	其他	1,699.80	0.00
9	合计	754,126,192.80	99.11

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

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	110023	民生转债	1,738,090	238,587,614.30	31.36
2	110029	浙能转债	895,690	124,850,229.10	16.41
3	113008	电气转债	698,690	97,006,119.60	12.75
4	113501	洛钼转债	451,850	79,123,453.50	10.40
5	128009	歌尔转债	237,884	39,198,525.52	5.15

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	363,472.48
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	816,506.53
5	应收申购款	1,606,151.47
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,786,130.48

5.11.4 报告期末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	110023	民生转债	238,587,614.30	31.36
2	125089	深机转债	28,241,375.54	3.71
3	110028	冠城转债	27,415,112.10	3.60
4	113007	吉视转债	24,322,394.70	3.20
5	110011	歌华转债	22,087,083.20	2.90
6	113006	深燃转债	20,353,422.00	2.67
7	110012	海运转债	10,798,488.50	1.42
8	128008	奇峰转债	9,108,129.32	1.20
9	128006	长青转债	8,728,301.40	1.15
10	128005	齐翔转债	3,227,421.56	0.42
11	110019	恒丰转债	2,534,493.00	0.33
12	128007	通鼎转债	1,301,336.00	0.17
13	126729	燕京转债	679,209.24	0.09
14	128002	东华转债	81,955.72	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	可转债A	可转债B	东吴转债
报告期期初基金份额总额	27,078,177.00	11,604,934.00	83,878,607.46
报告期期间基金总申购份额	0.00	0.00	1,087,900,485.03
减:报告期期间基金总赎回份额	0.00	0.00	455,143,970.83
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“–”填列)	440,403,166.00	188,744,214.00	–629,147,380.00
报告期期末基金份额总额	467,481,343.00	200,349,148.00	87,487,741.66

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

3、报告期间拆分变动包括日常拆分合并和折算产生的份额变动。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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

根据中国证监会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的要求,经与相关托管银行协商一致,自2015年3月24日起,东吴基金管理有限公司旗下基金采用第三方估值机构提供的当日估值净价对交易所市场上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券品种以外的固定收益品种进行估值。

§9 备查文件目录

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、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

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。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

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 。

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4月20日

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

【2015】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§1 重要提示

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。

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2015年4月14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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴中证新兴指数
场内简称	–
基金主代码	585001
交易代码	585001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年2月1日
报告期末基金份额总额	437,164,545.19份
投资目标	本基金采用指数化投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金通过采用指数化投资策略,选择中证新兴产业指数作为跟踪基准,按照指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,为投资者获取新兴产业高速成长所带来的投资收益。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率 +5%*银行同业存款利率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金以及混合型基金。本基金为指数型基金,紧密跟踪中证新兴产业指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 – 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	72,036,479.14
2.本期利润	178,732,039.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.3405
4.期末基金资产净值	597,104,209.93
5.期末基金份额净值	1.366

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。

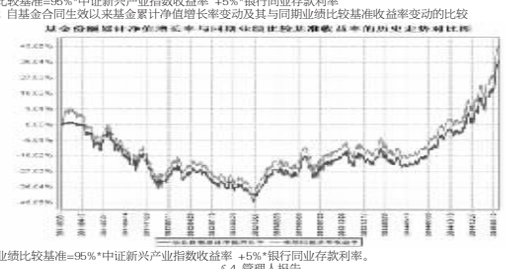
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	33.92%	1.42%	33.57%	1.41%	0.35%	0.01%

注:比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率 +5%*银行同业存款利率

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与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率 +5%*银行同业存款利率。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周健	本基金基金经理	2012年5月3日	–	8年	硕士,南开大学毕业。曾就职于海通证券;2011年5月加入东吴基金管理有限公司,曾任公司研究策划部研究员,现担任东吴中证新兴指数基金基金经理、东吴新创业股票基金基金经理、东吴深证100指数增强型证券投资基金基金经理(LOF)。

注:1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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定,本着诚实信用、勤勉尽责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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人按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组合同向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年一季度,国内宏观经济略有反弹,但是未有明显回暖,目前仍在企稳阶段。PMI恢复到荣枯线之上,PPI环比收窄,显示之前的稳增长政策正在逐步显效。在政策推动之下,房地产销售面积回升,但房价依然低迷,行业仍在去杠杆进程之中,投资下滑造成的经济下行压力依然存在。资本市场在宽松的货币政策作用下一路上行。由于中证新兴指数基金所配置的板块偏向军工、生物医药、新能源等新兴产业,表现明显好于沪深300、上证50等主流指数,但弱于创业板指。报告期内,本基金采用复制指数配置的策略,努力控制仓位和成份股上的偏离,在日常的基金操作中积极应对申购赎回,尽量减少跟踪误差。

4.4.2 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1.366元,累计净值1.366元;本报告期份额净值增长率33.92%,同期业绩比较基准收益率为33.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段经济和市场运行形势,个人认为国内经济下行压力仍然存在,但是大规模风险事件爆发的概率已经微乎其微,下一阶段经济应该会处于不温不火的状态,在政策刺激之下,偶尔可能还有小惊喜。其次,金融市场改革、国企改革等已经进入逐步兑现的阶段,会形成较多的投资机会,只要货币宽松的政策继续维持,经济差、股市好的组合实现的概率较大。板块方面,蓝筹股和创业板轮番上涨的局面已经形成,市场整体估值水平在快速上涨,投资者的乐观预期必然会造成部分板块出现泡沫迹象,尤其是新兴产业板块,要注意短期调整风险,但是市场谈不上有系统性风险,个人认为投资者对改革的预期应该还没有到兑现的时点,经济结构调整是大势所趋,新兴产业的整体成长性会持续,所以仍具有巨大的战略投资价值。

中证新兴产业指数基于经济转型思路优选出的主题策略指数,具备长期投资价值和良好的流动性。作为被动投资的基金,本基金将继续坚持指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标,积极应对申购赎回、成分股调整等因素对指数跟踪带来的冲击,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内,未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	561,532,696.91	93.16
	其中:股票	561,532,696.91	93.16
2	固定收益投资	10,005,000.00	1.66
	其中:债券	10,005,000.00	1.66
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	26,486,257.76	4.39
7	其他资产	4,709,115.38	0.78
8	合计	602,733,070.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	9,753,320.84	1.63
B	采矿业	15,626,463.28	2.62
C	制造业	410,312,832.36	68.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,710,585.31	2.46
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,705,780.04	15.53
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	10,371,692.08	1.74
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	8,052,023.00	1.35
S	综合	–	–
	合计	561,532,696.91	94.04

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601766	中国南车	730,174	12,405,656.26	2.08
2	601299	中国北车	656,588	12,087,785.08	2.02
3	300017	网宿科技	92,543	8,272,418.77	1.39
4	000156	华数传媒	164,327	8,052,023.00	1.35
5	600037	歌华有线	293,811	7,882,949.13	1.32
6	600518	康美药业	252,190	7,820,411.90	1.31
7	600804	鹏博士	237,186	7,744,122.90	1.30
8	600570	恒生电子	70,362	7,661,014.56	1.28
9	002230	科大讯飞	145,602	7,571,304.00	1.27
10	000100	TCL集团	1,266,510	7,472,409.00	1.25

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券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	10,005,000.00	1.68
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	10,005,000.00	1.68

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

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	140014	14付息国债14	100,000	10,005,000.00	1.68

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	155,720.33
2	应收证券清算款	4,032,479.97
3	应收股利	–
4	应收利息	261,853.23
5	应收申购款	259,061.85
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,709,115.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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	601766	中国南车	12,405,656.26	2.08	重大事项停牌
2	601299	中国北车	12,087,785.08	2.02	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 投资组合报告附注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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	638,190,382.10
报告期期间基金总申购份额	11,123,549.53
减:报告期期间基金总赎回份额	212,149,386.44
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“–”填列)	–
报告期期末基金份额总额	437,164,545.19

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务份额;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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

根据中国证监会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的要求,经与相关托管银行协商一致,自2015年3月24日起,东吴基金管理有限公司旗下基金采用第三方估值机构提供的当日估值净价对交易所市场上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券品种以外的固定收益品种进行估值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准东吴中证新兴产业指数证券投资基金设立的文件;

2、《东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金合同》;

3、《东吴中证新兴产业指数证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5、报告期内东吴中证新兴产业指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

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 。

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4月20日

东吴增利债券型证券投资基金

【2015】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:二〇一五年四月二十日

§1 重要提示

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月14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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴增利债券	
场内简称	–	
基金主代码	582002	
交易代码	582002	
基金运作方式	契约型。本基金合同生效后一年内封闭运作,基金合同生效满一年后转为开放运作。	
基金合同生效日	2011年7月27日	
报告期末基金份额总额	57,472,835.34份	
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过主动式管理及量化分析追求稳健的投资收益。	
投资策略	本基金在严格控制风险的基础上,坚持稳健配置策略,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准