

东吴增利债券型证券投资基金

[2015]第三季度报告

东吴增利债券型证券投资基金

基金管理人:东吴基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2015年10月26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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东吴增利债券
场内简称	
基金代码	682002
交易代码	682002
基金运作方式	契约型，基金合同生效后一年内封闭运作，基金合同生效后一年内封闭运作
基金合同生效日	2011年7月1日
报告期末基金份额总额	44,669,538.46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绝对的货币收益。
投资策略	本基金严格控制风险的基础上，坚持稳健型策略，力争实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益与风险均低于货币市场基金、低于混合型基金和股票型基金。
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
下属分级基金的基金简称	东吴增利债券A
下属分级基金的交易代码	682002
报告期末下属分级基金的份额总额	6,639,694.46份
报告期末基金资产净值	36,029,844.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	170,120.11
2.本期利润	129,306.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0141
4.期末基金份额净值	10,682,910.057
5.期末可供分配基金份额净值	1,226

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含持有人认购或者交易基金份额的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴增利债券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

过去一个月 1.07% 0.18% 1.12% 0.06% -0.06% 0.12%

东吴增利债券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

过去三个月 1.01% 0.10% 1.12% 0.06% -0.06% 0.12%

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

前一月度内公开到公开谴责、处罚的情形。

5.1.2 基本情况的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 646,013.06

2 应收证券清算款 908,113.63

3 应收股利

4 应收利息 1,766,571.96

5 应收申购款 55,881.54

6 其他应收款

7 存货跌价

8 其他

9 合计 3,466,580.10

5.10.4 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 12834909 12蓝筹水 MTN1 60,000 5,067,500.00 9.20

2 112080 12国开行 44,320 4,568,642.00 8.44

3 112120 12国开行 40,000 4,120,800.00 7.63

4 112160 12国开行 35,081 3,522,483.21 6.52

5 127264 11通城 29,020 3,260,500.00 6.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有股票。

5.10.6 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 东吴增利债券A 东吴增利债券C

报告期初基金份额总额 9,961,950.07

报告期初基金份额总金额 36,016,615.62

报告期申购金额 4,309,251.51

报告期赎回金额 6,631,567.93

报告期申购金额减去赎回金额后的金额 6,530,564.32

报告期末基金份额总额 8,639,694.46

报告期末基金份额总金额 36,029,844.00

注:1.此处的任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《证券从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

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

规定及其有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，为基金持有人谋取最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金资产运用固有资金投资资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资资本基金情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期初基金管理人持有的本基金份额 4,811,367.07

报告期初基金管理人持有的基金资产份额 -

报告期基金管理人赎回的基金份额 -

报告期基金管理人持有的基金份额 4,811,367.07

报告期基金管理人持有的基金份额占基金总份额比例 10.77%

7.2 基金管理人运用固有资金投资资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资资本基金情况。

网址: http://www.scfund.com.cn

投资者对本基金报告如有疑问，可咨询基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务电话中心 (021) 50509666; 400-821-0588。

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

[2015]第三季度报告

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

[2015]第三季度报告

基金经理回避。目前转债市场仅有约百亿元规模，一级市场供给尚未跟上，存量品种有一定稀缺性。

本基金在3季度平稳应对B份额向下定期折算，并对中证转债指数保持了较好跟踪。

4.42 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

[2015]第三季度报告

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

等效增强指数波动率放大，市场功能偏弱，功能偏弱，市场整体表现疲弱。

4.43 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.44 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.45 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.46 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.47 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.48 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.49 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.50 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.51 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.52 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.53 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值为0.919元，累计净值0.919元，累计净值1.024元；本期报告期份额净值增长率-20.04%，同期业绩比较基准收益率-20.33%。

基金经理回避。目前转债市场供给不足，市场整体表现疲弱。

4.54 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金