

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

2015年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

81 重要提示
基金管理人东吴基金管理有限公司根据基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容,保证基金数据不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

82 基金产品概况
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
基金代码:160809

Table with 2 columns: 基金主要指标 and 基金业绩比较基准. Lists various performance metrics and benchmarks.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期. Shows financial data for the reporting period.

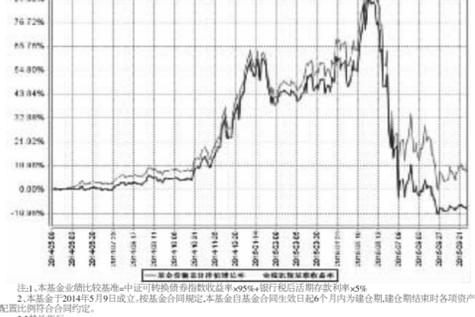
注1:本基金本期收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金本期收益扣除本期公允价值变动收益。

注2:本基金本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益。

注3:本基金本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。

注4:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

注5:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。



东吴中证可转换债券指数分级基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

注:本基金于2014年5月9日成立,按基金合同规定,本基金基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期间各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他资产

4.1 基金业绩比较基准小组简介

4.2 基金管理人、基金托管人职责

4.3 基金费用

4.4 基金收益分配原则

4.5 基金资产估值

4.6 基金合同变更、终止与基金财产清算

4.7 基金信息披露

4.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构

4.9 基金合同生效

4.10 基金合同解除

4.11 基金合同变更

4.12 基金合同终止

4.13 基金合同其他

4.14 基金合同其他

4.15 基金合同其他

4.16 基金合同其他

4.17 基金合同其他

4.18 基金合同其他

4.19 基金合同其他

4.20 基金合同其他

4.21 基金合同其他

4.22 基金合同其他

4.23 基金合同其他

4.24 基金合同其他

4.25 基金合同其他

4.26 基金合同其他

4.27 基金合同其他

4.28 基金合同其他

4.29 基金合同其他

4.30 基金合同其他

4.31 基金合同其他

4.32 基金合同其他

4.33 基金合同其他

4.34 基金合同其他

4.35 基金合同其他

4.36 基金合同其他

4.37 基金合同其他

4.38 基金合同其他

4.39 基金合同其他

4.40 基金合同其他

4.41 基金合同其他

4.42 基金合同其他

4.43 基金合同其他

4.44 基金合同其他

4.45 基金合同其他

4.46 基金合同其他

4.47 基金合同其他

4.48 基金合同其他

81 重要提示
基金管理人东吴基金管理有限公司根据基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容,保证基金数据不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

82 基金产品概况
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
基金代码:160809

Table with 2 columns: 基金主要指标 and 基金业绩比较基准. Lists various performance metrics and benchmarks.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期. Shows financial data for the reporting period.

注1:本基金本期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,本期利润为本基金本期收益扣除本期公允价值变动收益。

注2:本基金本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益。

注3:本基金本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。

注4:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

注5:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。



东吴中证可转换债券指数分级基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

注:本基金于2014年5月9日成立,按基金合同规定,本基金基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期间各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他资产

4.1 基金业绩比较基准小组简介

4.2 基金管理人、基金托管人职责

4.3 基金费用

4.4 基金收益分配原则

4.5 基金资产估值

4.6 基金合同变更、终止与基金财产清算

4.7 基金信息披露

4.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构

4.9 基金合同生效

4.10 基金合同解除

4.11 基金合同变更

4.12 基金合同终止

4.13 基金合同其他

4.14 基金合同其他

4.15 基金合同其他

4.16 基金合同其他

4.17 基金合同其他

4.18 基金合同其他

4.19 基金合同其他

4.20 基金合同其他

4.21 基金合同其他

4.22 基金合同其他

4.23 基金合同其他

4.24 基金合同其他

4.25 基金合同其他

4.26 基金合同其他

4.27 基金合同其他

4.28 基金合同其他

4.29 基金合同其他

4.30 基金合同其他

4.31 基金合同其他

4.32 基金合同其他

4.33 基金合同其他

4.34 基金合同其他

4.35 基金合同其他

4.36 基金合同其他

4.37 基金合同其他

4.38 基金合同其他

4.39 基金合同其他

4.40 基金合同其他

4.41 基金合同其他

4.42 基金合同其他

4.43 基金合同其他

4.44 基金合同其他

4.45 基金合同其他

4.46 基金合同其他

4.47 基金合同其他

4.48 基金合同其他

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

2015 第三季度报告

2015年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

81 重要提示
基金管理人东吴基金管理有限公司根据基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容,保证基金数据不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

82 基金产品概况
基金名称:东吴中证新兴产业指数证券投资基金
基金简称:东吴新兴产业
基金代码:160810

Table with 2 columns: 基金主要指标 and 基金业绩比较基准. Lists various performance metrics and benchmarks.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期. Shows financial data for the reporting period.

注1:本基金本期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,本期利润为本基金本期收益扣除本期公允价值变动收益。

注2:本基金本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益。

注3:本基金本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。

注4:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

注5:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。



东吴中证新兴产业指数基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金业绩比较基准:中证新兴产业指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

注:本基金于2014年5月9日成立,按基金合同规定,本基金基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期间各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他资产

4.1 基金业绩比较基准小组简介

4.2 基金管理人、基金托管人职责

4.3 基金费用

4.4 基金收益分配原则

4.5 基金资产估值

4.6 基金合同变更、终止与基金财产清算

4.7 基金信息披露

4.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构

4.9 基金合同生效

4.10 基金合同解除

4.11 基金合同变更

4.12 基金合同终止

4.13 基金合同其他

4.14 基金合同其他

4.15 基金合同其他

4.16 基金合同其他

4.17 基金合同其他

4.18 基金合同其他

4.19 基金合同其他

4.20 基金合同其他

4.21 基金合同其他

4.22 基金合同其他

4.23 基金合同其他

4.24 基金合同其他

4.25 基金合同其他

4.26 基金合同其他

4.27 基金合同其他

4.28 基金合同其他

4.29 基金合同其他

4.30 基金合同其他

4.31 基金合同其他

4.32 基金合同其他

4.33 基金合同其他

4.34 基金合同其他

4.35 基金合同其他

4.36 基金合同其他

4.37 基金合同其他

4.38 基金合同其他

4.39 基金合同其他

4.40 基金合同其他

4.41 基金合同其他

4.42 基金合同其他

4.43 基金合同其他

4.44 基金合同其他

4.45 基金合同其他

4.46 基金合同其他

4.47 基金合同其他

4.48 基金合同其他

81 重要提示
基金管理人东吴基金管理有限公司根据基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容,保证基金数据不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

82 基金产品概况
基金名称:东吴中证新兴产业指数证券投资基金
基金简称:东吴新兴产业
基金代码:160810

Table with 2 columns: 基金主要指标 and 基金业绩比较基准. Lists various performance metrics and benchmarks.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期. Shows financial data for the reporting period.

注1:本基金本期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,本期利润为本基金本期收益扣除本期公允价值变动收益。

注2:本基金本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动收益。

注3:本基金本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。

注4:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

注5:本基金本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。



东吴中证新兴产业指数基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金业绩比较基准:中证新兴产业指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

注:本基金于2014年5月9日成立,按基金合同规定,本基金基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期间各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他资产

4.1 基金业绩比较基准小组简介

4.2 基金管理人、基金托管人职责

4.3 基金费用

4.4 基金收益分配原则

4.5 基金资产估值

4.6 基金合同变更、终止与基金财产清算

4.7 基金信息披露

4.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构

4.9 基金合同生效

4.10 基金合同解除

4.11 基金合同变更

4.12 基金合同终止

4.13 基金合同其他

4.14 基金合同其他

4.15 基金合同其他

4.16 基金合同其他

4.17 基金合同其他

4.18 基金合同其他

4.19 基金合同其他

4.20 基金合同其他

4.21 基金合同其他

4.22 基金合同其他

4.23 基金合同其他

4.24 基金合同其他

4.25 基金合同其他

4.26 基金合同其他

4.27 基金合同其他

4.28 基金合同其他

4.29 基金合同其他

4.30 基金合同其他

4.31 基金合同其他

4.32 基金合同其他

4.33 基金合同其他

4.34 基金合同其他

4.35 基金合同其他

4.36 基金合同其他

4.37 基金合同其他

4.38 基金合同其他

4.39 基金合同其他

4.40 基金合同其他

4.41 基金合同其他

4.42 基金合同其他

4.43 基金合同其他

4.44 基金合同其他

4.45 基金合同其他

4.46 基金合同其他

4.47 基金合同其他

4.48 基金合同其他

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

2015年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

81 重要提示
基金管理人东吴基金管理有限公司根据基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容,保证基金数据不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

82 基金产品概况
基金名称:东吴中证可转换债券