

(上接D40版)

法定代表人:何春梅
客服热线:95563
公司网址:www.gzhq.com.cn
(80)财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28楼
法定代表人:蔡一兵
客服电话:95317
公司网址:www.cfzq.com
(81)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:李伟
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(82)中国银河国际证券有限责任公司(该机构仅代销吴昊信稳健A)
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40F
法定代表人:许刚
客户服务电话:4006208888
公司网址:www.bocichina.com
(83)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人:鞠瑛
客服电话:0471-4961259
公司网址:www.cnht.com.cn
(84)中万宏源(西藏)证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(邮编:830002)
法定代表人:韩志谦
客户服务电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
(85)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号23层
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
客服电话:95538
公司网址:www.zqlq.com.cn
(86)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人:姜昧军
客服电话:4008323000
公司网址:www.csco.com.cn
(87)金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市福田区深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:王义文
客服电话:95372
公司网址:www.jyzq.com.cn
(88)中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:北京市朝阳区京顺东园四区2号中航资本大厦35层
法定代表人:王峰峰
客服电话:95335
公司网址:www.avicsec.com
(89)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-85547(福建省外请拨0591)
公司网址:www.hfzq.com.cn
(90)上海海信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:罗洁
客服热线:68777877
公司网址:www.cjsa.com
(91)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49层
法定代表人:陈永衡
客服电话:40018-40028
公司网址:www.wkzq.com.cn
(92)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞萍
客户服务电话:95332;4001099918
公司网址:www.cfsc.com.cn
(93)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层
法定代表人:龙增来
客服电话:4006080808
公司网址:www.china-invs.cn
(94)西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10号楼
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金鹰东方财富大厦
法定代表人:陈宏
客服热线:95357
公司网址:https://www.18.cn
(95)九州证券股份有限公司
注册地址:青海省西宁市南川工业园区创业路108号
办公地址:北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
法定代表人:魏永刚
客服热线:95305
公司网址:https://www.jzsec.com
(96)国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客服热线:95310
公司网址:www.gjzq.com.cn
(97)华宝证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人:陈林
客服电话:4008209898
公司网址:www.cnhbstock.com
(98)长城国瑞证券有限公司
注册地址:厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼
办公地址:厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼
法定代表人:王莉
客服热线:400-0099-886
公司网址:www.gwsc.com.cn
(99)爱建证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:祝捷
客服电话:4001962502
公司网址:www.aajq.com.cn
(100)金鹰基金代理有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门外大街2号19层A2107
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号19层A2107
法定代表人:夏于佳
客服热线:400-8557333
公司网址:www.jhfund.com
(101)阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市海棠区三亚东路海唐商务12、13层
办公地址:北京市朝阳区朝明门大街乙2号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李伟
客服热线:4006-802-123
公司网址:https://www.zhixin-inv.com/
(二)注册登记机构:东吴基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
办公地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
法定代表人:王刚
联系人:贾云鹏
电话:021-50509888
传真:021-50509884
客户服务电话:021-50509666
网站:www.scfund.com.cn
(三)律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:陆奇
经办律师:黎明、陆奇
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:010-58153000
传真:010-58188298
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、张亚璇
四、基金名称
本基金名称:东吴优信稳健债券型证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式债券型基金
六、基金的投资目标
本基金属债券型基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,精选高信用等级债券,通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。
七、基金的投资范围
本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类资产,包括国债、金融债、信用等级较高的企业债、公司债、次级债、可转换债券、可分离债、短期融资券、回购、央行票据、资产支持证券等,以及部分股票、权证等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于债券类资产(包括含权债券)的比例不低于基金资产净值的80%,投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票等中国证监会允许基金投资的其它金融工具比例合计不超过基金资产净值的20%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
对于中国证监会允许投资的创新类金融产品,将依据相关法律法规进行投资管理。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
八、基金的投资策略
本基金是一只债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅原则构建和管理投

资组合。对于债券投资,本基金通过对利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的分析,确定本基金债券组合久期和期限结构配置。债券选择上,本基金根据债券信用风险特征、到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析,并考虑债券流动性和操作策略,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为对债券投资的有益补充,主要采取自下而上的策略精选具有估值优势的优质企业股票作为投资对象。
(一)债券投资策略
1.利率分析和债券组合久期确定
利率是债券投资重要影响因素。本基金将通过宏观经济和政策取向的分析,把握利率走势,为债券投资决策提供依据。
从理论与实践经验看,影响利率走势的因素主要有:1、宏观经济增长状况,主要衡量指标有GDP增速、工业增加值、固定资产投资增速、消费水平、贸易顺差程度;2、物价走势、CPI、PPI、3、货币供应量和信贷增速;4、国际主要经济体利率走势。本基金通过以金四个宏观指标综合分析,把握利率走势。
根据利率走势的判断结果,确定债券投资组合久期。在预期利率下降时,增加债券组合久期,提高债券价格上涨产生的收益;在预期利率上升时,减小债券组合久期,降低债券价格下跌产生的损失。
2.期限结构配置策略
本基金在确定债券组合久期之后,将结合收益率曲线变化的预测,通过分析和情景测试,确定短、中、长期三类债券的投资比例。具体而言:
通过考察市场收益率曲线的历史变动情况,并结合利率走势,把握收益率曲线变化趋势。在此基础上,本基金根据收益率曲线变动特征,在子弹式配置、梯式配置和杠铃式配置三种中进行选择,把握利率走势。
根据利率走势的判断结果,确定债券投资组合久期。在预期利率下降时,增加债券组合久期,提高债券价格上涨产生的收益;在预期利率上升时,减小债券组合久期,降低债券价格下跌产生的损失。
3.债券选择策略
在债券选择上,本基金,首先精选信用风险低的债券构建初始债券池。其次,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。
(二)股票投资策略
1)债券信用风险评级
随着我国债券市场的发展,具有信用风险的债券品种扩展迅速,并且银监会近期要求银行系统退出债券担保市场,进一步凸显了我国债券市场信用风险。与此同时,根据国内外债券市场经验表明,信用风险(如违约、假借化机)会造成债券投资价值损失,因此在债券投资中,本基金在控制信用风险的前提下,参考其它信用评级机构对债券信用风险评级结果,同时结合东吴基金债券信用风险评级体系得出的评级结果,确定债券最终信用等级。本基金选择中长期信用债券不低于AA、短期债券不低于A-1或相应的信用级别,同时纳入全部无信用风险债券,作为本基金初始债券池。东吴基金债券信用风险评级体系借鉴国内外信用评级机构的评级方法,从资企业现金流与债务匹配的角度把握企业信用状况。
2)债券投资价值分析
在初始债券池基础上,本基金根据东吴基金债券投资价值分析体系,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。东吴基金债券投资价值分析体系根据债券到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析,并考虑债券流动性溢价和操作策略进行构建的。具体做法是:
首先,计算各债券到期收益率;其次,计算剔除税率后的到期收益率;第三,考虑信用利差的到期收益率。根据以上经税收和信用利差修正后的到期收益率大小,本基金对债券投资价值进行排序。第四,根据各债券流动性溢价水平,以及债券操作策略(如采取买入持有到期操作策略,可以不考虑流动性问题),对以上债券投资价值排序进行优化,选择投资价值高的债券构建本基金债券投资组合。
(三)股票投资策略
本基金作为债券投资的有益补充,以提高投资组合收益并适当分散风险。对于股票投资策略,本基金采取自下而上策略,精选具有估值优势的优质企业股票作为投资对象。本基金优质企业是指具有明显竞争优势,并且未来能够持续成长。具体选股步骤是:
首先,本基金充分利用与本基金管理人行业研究人员的盈利预测数据,并结合国内研究机构做过盈利预测数据的上市公司,初步筛选出未来两年净利润复合增长率超过20%的上市公司股票,作为“备选股票池(I)”。
其次,在“备选股票池(I)”基础上,根据东吴基金企业竞争优势评价体系精选具有竞争优势的上市公司股票作为“备选股票池(II)”。东吴基金企业竞争优势评价体系是围绕财务的五项能力(盈利能力、偿债能力、以及企业能力)和成长能力和企业资源结构等构建的,用来评价上市公司的竞争优势和未来成长能力。东吴基金企业竞争优势评价体系具体包括以下五方面内容:战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势、资源及其它附加优势。行业研究员对不同竞争优势进行打分,并统计计算出上市公司竞争优势综合评分=战略管理优势+技术优势+市场优势+管理运营优势+附加优势,作为上市公司竞争优势的排序。最后,精选竞争优势综合得分排名最靠前的上市公司股票作为“备选股票池(II)”。
第三,本基金根据内在价值和相对价值相结合的估值方法评价“备选股票池(II)”股票投资价值,其中内在价值采取现金流贴现方法,相对价值评估主要采取PE、PB和PS等指标。最后精选出“备选股票池(II)”中具有投资价值的股票作为“第三新股票池”。
(四)新股投资策略
从我国资本市场证券市场的发展来看,新股发行仍然会保持一定的数量与规模,在目前政策条件下,由于一、二级市场价格的差,参与新股申购能够取得较高的固定收益。通过对过往新股发行上市的数据分析,我们发现,申购新股可获得股票市场无风险收益的固定收益。
本基金作为固定收益类产品,为获得目前股市场存在的固定收益,将在充分研究新股投资基本面的前提下,参与新股的申购。
(五)固定收益类资产
本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系,具体如下:
1.投资决策委员会:决策基金总体战略、资产配置、审议基金的投资(股票)、对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策,就风险事项与风险管理委员会沟通;
2.基金经理:参与构建基金的债券(股票)池,提出资产配置方案,实施具体投资计划。基金经理必须严格按照《投资管理流程》进行操作,资产配置方案经投资决策委员会审议通过后,以《资产配置方案决议》的形式形成书面结果,作为基金经理投资的依据,同时投资总监、风险控制部门等备案,以便监控。
3.集中交易室:执行基金经理的交易指令、反交易指令的执行情况、监督交易指令的合规性;
4.研究平台:构建债券(股票)池,为投资决策委员会提供投资决策咨询支持、为基金经理提供投资建议;
5.金融工程小组:通过对投资组合的跟踪与评估,为投资决策委员会和基金经理提供投资效果反馈的意见,以优化投资决策;
6.风险控制部门:由风险管理委员会、合规风控部等构成。合规风控部对投资决策及实际投资过程进行监督和定期或不定期向风险管理委员会提供相关报告,定期评估投资组合风险等级,对基金业绩标准不再适用,基金管理人可提前变更业绩标准。
九、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证全债指数。
本基金业绩比较基准为80%-100%,根据相关法律法规定义,本基金为债券型基金。由于本基金股票投资只是作为债券投资的有益补充,比例相对较低,所以以基金基准里不考虑股票部分。由于本基金债券投资范围不仅包括国债,而且也包括企业债和金融债等,中证全债指数由中证指数公司编制的综合反映银行间市场和沪深交易所债券市场的债券市场指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,能够反应本基金资产配置的范围。
若未来市场出现更权威、更能反映本基金业绩标准的指数,基金管理人可提前变更业绩标准,但须事先公告并报中国证监会备案,调整该基金的业绩比较基准。业绩标准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。
十、基金的风险收益特征
本基金主要投资于高信用等级、投资级范围的债券资产,属证券投资基金中的低风险品种,长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金、高于货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告
东吴优信稳健债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人于2019年12月31日披露的本基金投资组合报告不存在虚假记载、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。
本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合相关情况,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告投资组合报告所载数据截至2019年3月31日(未经审计)
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 2,040,330.00 14.62
其中:股票 2,040,330.00 14.62
2 基金投资 - - -
3 固定收益投资 9,885,376.94 70.82
其中:债券 9,885,376.94 70.82
4 资产支持证券 - - -
5 金融衍生品投资 - - -
6 买入返售金融资产 - - -
其中:买断式回购的买入返售金融资产 - - -
7 银行存款和结算备付金合计 1,708,690.68 12.24
8 其他资产 323,921.58 2.32
9 合计 13,958,319.20 100.00
2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
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 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 652,050.00 5.40
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 572,320.00 4.74
J 金融业 402,919.00 3.34
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 210,650.00 1.75
N 水利、环境和公共设施管理业 - -
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 - -
S 综合 - -
2,040,330.00 16.91
2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票
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
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 601336 新华保险 5,000 268,450.00 2.23
2 300759 康龙化成 5,000 210,650.00 1.75
3 605888 友邦保险 6,000 205,400.00 1.69
4 002727 一心堂 8,000 202,400.00 1.68
5 000977 浪潮信息 8,000 200,000.00 1.66
6 300059 东方财富 10,000 193,800.00 1.61
7 600570 恒生电子 2,000 175,120.00 1.45
8 603589 口子窖 3,000 163,170.00 1.35
9 300457 联合科技 6,000 147,900.00 1.23
10 002371 北方创业 2,000 140,980.00 1.17
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 1,869,139.20 15.49
2 央行票据 - -
3 金融债 3,069,148.00 25.44
其中:政策性金融债 3,069,148.00 25.44
4 企业债 - -
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 - -
7 可转债(可交换债) - -
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 9,885,376.94 81.93
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 010107 21国债(7) 16,800 1,733,424.00 14.37
2 180805 国债(170) 14,800 1,480,148.00 12.27
3 136192 16国债(01) 20,000 1,408,000.00 11.67
4 112196 15国债(18) 11,070 1,125,051.50 9.31
5 108602 国债(1704) 7,000 709,700.00 5.88
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。
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。
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。
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
9.1 本期国债期货投资策略
本基金本报告期末未持有国债期货。
9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
9.3 本期国债期货投资情况
本基金本报告期末未持有国债期货。
10. 投资组合报告附注
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。
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。
3) 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 14,105.45
2 应收证券清算款 105,600.00
3 应收利息 -
4 应收股利 -
5 应收中购款 204,216.13
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 323,921.58
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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
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。
十二、基金业绩
本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,也不保证最低收益。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请仔细阅读本基金的招募说明书。
1) 东吴优信稳健基金历史时间净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较
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
2008.11.05-2008.12.31 2.44% 0.17% 2.25% 0.11% 0.19% 0.06%
2009.01.01-2009.12.31 0.27% 0.20% 0.27% 0.06% 0.00% 0.14%
2010.01.01-2010.12.31 3.58% 0.37% 2.00% 0.07% 1.58% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -8.93% 0.34% 3.79% 0.06% -12.72% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.81% 0.13% 4.03% 0.04% 3.78% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.18% 0.18% 1.78% 0.05% -5.96% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.96% 0.26% 9.41% 0.16% 5.55% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 3.04% 0.50% 6.53% 0.07% -3.49% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -5.77% 0.43% 2.00% 0.09% -7.77% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 3.00% 0.15% -0.34% 0.06% 3.34% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.43% 0.39% 8.85% 0.07% -14.28% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.16% 0.74% 1.42% 0.60% -5.58% 0.14%
2008.11.05-2019.03.31 4.31% 0.33% 50.32% 0.08% -46.01% 0.25%
注:1.比较基准=中证全债指数。
2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类
2) 东吴优信稳健债券基金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
2009.06.15-2009.12.31 0.28% 0.24% -0.19% 0.05% 0.47% 0.19%
2010.01.01-2010.12.31 3.14% 0.37% 2.00% 0.07% 1.14% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -9.19% 0.34% 3.79% 0.06% -12.98% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.45% 0.13% 4.03% 0.04% 3.42% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.62% 0.18% 1.78% 0.05% -6.40% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.47% 0.26% 9.41% 0.16% 5.06% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 2.73% 0.50% 6.53% 0.07% -3.80% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -6.12% 0.43% 2.00% 0.09% -8.12% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 2.57% 0.15% -0.34% 0.06% 2.91% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.79% 0.39% 8.85% 0.07% -14.64% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.24% 0.74% 1.42% 0.60% -5.66% 0.68%
2008.11.05-2019.03.31 -1.67% 0.34% 46.35% 0.08% -48.02% 0.26%
注:1.比较基准=中证全债指数。
2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类
2) 东吴优信稳健债券基金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
2009.06.15-2009.12.31 0.28% 0.24% -0.19% 0.05% 0.47% 0.19%
2010.01.01-2010.12.31 3.14% 0.37% 2.00% 0.07% 1.14% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -9.19% 0.34% 3.79% 0.06% -12.98% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.45% 0.13% 4.03% 0.04% 3.42% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.62% 0.18% 1.78% 0.05% -6.40% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.47% 0.26% 9.41% 0.16% 5.06% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 2.73% 0.50% 6.53% 0.07% -3.80% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -6.12% 0.43% 2.00% 0.09% -8.12% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 2.57% 0.15% -0.34% 0.06% 2.91% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.79% 0.39% 8.85% 0.07% -14.64% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.24% 0.74% 1.42% 0.60% -5.66% 0.68%
2008.11.05-2019.03.31 -1.67% 0.34% 46.35% 0.08% -48.02% 0.26%
注:1.比较基准=中证全债指数。
2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类
2) 东吴优信稳健债券基金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
2009.06.15-2009.12.31 0.28% 0.24% -0.19% 0.05% 0.47% 0.19%
2010.01.01-2010.12.31 3.14% 0.37% 2.00% 0.07% 1.14% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -9.19% 0.34% 3.79% 0.06% -12.98% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.45% 0.13% 4.03% 0.04% 3.42% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.62% 0.18% 1.78% 0.05% -6.40% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.47% 0.26% 9.41% 0.16% 5.06% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 2.73% 0.50% 6.53% 0.07% -3.80% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -6.12% 0.43% 2.00% 0.09% -8.12% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 2.57% 0.15% -0.34% 0.06% 2.91% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.79% 0.39% 8.85% 0.07% -14.64% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.24% 0.74% 1.42% 0.60% -5.66% 0.68%
2008.11.05-2019.03.31 -1.67% 0.34% 46.35% 0.08% -48.02% 0.26%
注:1.比较基准=中证全债指数。
2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类
2) 东吴优信稳健债券基金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
2009.06.15-2009.12.31 0.28% 0.24% -0.19% 0.05% 0.47% 0.19%
2010.01.01-2010.12.31 3.14% 0.37% 2.00% 0.07% 1.14% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -9.19% 0.34% 3.79% 0.06% -12.98% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.45% 0.13% 4.03% 0.04% 3.42% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.62% 0.18% 1.78% 0.05% -6.40% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.47% 0.26% 9.41% 0.16% 5.06% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 2.73% 0.50% 6.53% 0.07% -3.80% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -6.12% 0.43% 2.00% 0.09% -8.12% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 2.57% 0.15% -0.34% 0.06% 2.91% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.79% 0.39% 8.85% 0.07% -14.64% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.24% 0.74% 1.42% 0.60% -5.66% 0.68%
2008.11.05-2019.03.31 -1.67% 0.34% 46.35% 0.08% -48.02% 0.26%
注:1.比较基准=中证全债指数。
2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类
2) 东吴优信稳健债券基金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
2009.06.15-2009.12.31 0.28% 0.24% -0.19% 0.05% 0.47% 0.19%
2010.01.01-2010.12.31 3.14% 0.37% 2.00% 0.07% 1.14% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -9.19% 0.34% 3.79% 0.06% -12.98% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.45% 0.13% 4.03% 0.04% 3.42% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.62% 0.18% 1.78% 0.05% -6.40% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.47% 0.26% 9.41% 0.16% 5.06% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 2.73% 0.50% 6.53% 0.07% -3.80% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -6.12% 0.43% 2.00% 0.09% -8.12% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 2.57% 0.15% -0.34% 0.06% 2.91% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.79% 0.39% 8.85% 0.07% -14.64% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.24% 0.74% 1.42% 0.60% -5.66% 0.68%
2008.11.05-2019.03.31 -1.67% 0.34% 46.35% 0.08% -48.02% 0.26%
注:1.比较基准=中证全债指数。
2.本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类
2) 东吴优信稳健债券基金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
2009.06.15-2009.12.31 0.28% 0.24% -0.19% 0.05% 0.47% 0.19%
2010.01.01-2010.12.31 3.14% 0.37% 2.00% 0.07% 1.14% 0.30%
2011.01.01-2011.12.31 -9.19% 0.34% 3.79% 0.06% -12.98% 0.28%
2012.01.01-2012.12.31 7.45% 0.13% 4.03% 0.04% 3.42% 0.09%
2013.01.01-2013.12.31 -4.62% 0.18% 1.78% 0.05% -6.40% 0.13%
2014.01.01-2014.12.31 14.47% 0.26% 9.41% 0.16% 5.06% 0.10%
2015.01.01-2015.12.31 2.73% 0.50% 6.53% 0.07% -3.80% 0.43%
2016.01.01-2016.12.31 -6.12% 0.43% 2.00% 0.09% -8.12% 0.34%
2017.01.01-2017.12.31 2.57% 0.15% -0.34% 0.06% 2.91% 0.09%
2018.01.01-2018.12.31 -5.79% 0.39% 8.85% 0.07% -14.64% 0.32%
2019.01.01-2019.03.31 -4.24% 0.74% 1.42% 0.60% -5.66% 0.68%
2008.11