东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）

2018年第一季度报告

基金管理人：东吴基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年四月十九日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4月16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2018年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴深证100指数增强（LOF）
场内简称	东吴100
基金主代码	165806
交易代码	165806
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	5,212,597.25份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金主要采用指数复制的方法跟踪深证100价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）
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混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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（2018年1月1日－2018年3月31日）
1.本期已实现收益	37,688.10
2.本期利润	-237,212.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0455
4.期末基金资产净值	6,638,419.49
5.期末基金份额净值	1.274

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。

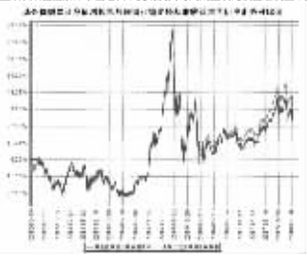
3.2 基金净值表现

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	-3.56%	1.42%	-2.91%	1.37%	-0.65%	0.05%

注：基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

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的比较



注：基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

§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	基金经理	2013年6月5日	-	11年	周健先生，硕士，南开大学毕业，11年证券从业经历。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，现任基金经理，自2012年05月03日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自2013年6月5日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理、自2016年6月3日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年8月11日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，其中，自2012年10月27日至2015年5月29日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理，2016年2月3日至2017年4月19日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年2月5日至2017年4月19日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
朱冰兵	基金经理	2017年3月9日	-	7年	朱冰兵同志，南京大学计算机应用专业，学士学位。曾任江苏省昆山市信托投资公司证券营业部、东吴证券营业部信息技术部系统工程师，自2003年10月参与我司筹建以来，一直就职于我司，其中2003年10月至2010年6月任系统工程师，2010年7至今，一直从事研究工作，历任助理研究员、研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中，自2017年3月9日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）、东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理。

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，本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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济数据平稳，但是国内、国外诸多事件带来市场的大幅波动。政府经济转型决心坚决，导致市场担心经济下滑；金融防风险、去杠杆，加强监管，以及中美之间贸易摩擦加剧、对抗升级，引起市场大幅下跌。蓝筹白马经过去年的估值修复后相对合理，短期利率高点回落，推迟注册制、对独角兽上市及科技创新的政策扶持，大大提升市场风险偏好，推动春节后创业板快速上涨。

报告期内，本基金主要采用复制指数配置与行业内量化选股的策略，密切跟踪指数，控制相对基准的偏离；适当增加旅游、医药等板块的配置；严格从基本面出发，坚持价值投资策略，精选估值低、业绩增长确定的优质公司做指数增强，通过公司的长期业绩增长来克服市场的波动。

4.5 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1.274元，基金份额净值为1.274元；本报告期基金份额净值增长率为-3.56%，业绩比较基准收益率为-2.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金于2018年1月1日至2018年3月31日出现基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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	6,296,346.42	92.93
	其中：股票	6,296,346.42	92.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
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	441,424.26	6.52
8	其他资产	37,356.19	0.55
9	合计	6,775,126.87	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	139,762.00	2.11
B	采矿业	24,304.00	0.37
C	制造业	3,855,182.66	58.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	84,505.00	1.27
F	批发和零售业	151,129.19	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	14,895.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	411,505.96	6.20
J	金融业	409,425.70	6.17
K	房地产业	458,192.16	6.90
L	租赁和商务服务业	102,088.80	1.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	77,456.64	1.17
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	72,856.00	1.10
S	综合	20,492.32	0.31
	合计	5,821,795.42	87.70

5.2.2 报告期末积极投资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	12,925.00	0.19
B	采掘业	-	-
C	制造业	121,147.00	1.82
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	60,555.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	11,850.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,059.00	0.53
J	金融业	129,488.00	1.95
K	房地产业	16,164.00	0.24
L	租赁和商务服务业	61,611.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	9,264.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	16,488.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	474,551.00	7.15

5.2.3 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。

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	000333	美的集团	8,256	450,199.68	6.78
2	000651	格力电器	8,732	409,530.80	6.17
3	002415	海康威视	6,171	254,862.30	3.84
4	000002	万科A	7,200	239,688.00	3.61
5	000725	京东方A	44,817	238,426.44	3.59
6	000858	五粮液	3,517	233,388.12	3.52
7	000001	平安银行	14,960	163,064.00	2.46
8	300498	温氏股份	6,700	139,762.00	2.11
9	000063	中兴通讯	4,336	130,730.40	1.97
10	002304	洋河股份	1,016	109,717.84	1.65

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

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	600030	中信证券	4,000	74,320.00	1.12
2	300413	快乐购	1,500	60,555.00	0.91
3	601688	华泰证券	3,200	55,168.00	0.83
4	601888	中国国旅	900	47,619.00	0.72
5	603589	口子窖	900	38,835.00	0.59

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有股指期货。

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持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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基础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	1,225.09
2	应收证券清算款	36,033.52
3	应收股利	-
4	应收利息	97.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,356.19

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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	5,337,370.87
报告期期间基金总申购份额	173,752.26
减：报告期期间基金总赎回份额	298,525.88
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	5,212,597.25

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018年4月3日，徐军女士因工作调动辞去公司督察长职务，由吕晖先生担任公司督察长职务，同时吕晖先生辞去其所担任的公司副总经理职务。

§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深证100指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；

2.《东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）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.报告期内东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）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
2018年4月19日

东吴双三角股票型证券投资基金

2018年第一季度报告

基金管理人：东吴基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年四月十九日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4月16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2018年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴双三角股票
基金主代码	005209
交易代码	005209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月5日
报告期末基金份额总额	429,463,126.33份
投资目标	本基金主要投资于注册地、办公地点所在地或主营业务所在地在长江三角洲地区、珠江三角洲地区或直接受益于上述两地区经济发展的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。本基金对于注册地、办公地点所在地或主营业务所在地在长江三角洲地区、珠江三角洲地区（即"双三角"）或直接受益于上述两地区经济发展的个股选择将采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。
业绩比较基准	中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	东吴双三角股票A　东吴双三角股票C
下属分级基金的交易代码	005209　005210
报告期末下属分级基金的份额总额	386,268,047.44份　43,195,078.89份

§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（2018年1月1日－2018年3月31日）	
	东吴双三角股票A	东吴双三角股票C
1. 本期已实现收益	-14,336,590.37	-1,768,609.35
2. 本期利润	-28,953,083.91	-2,835,250.53
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0734	-0.0553
4. 期末基金资产净值	359,099,187.58	40,053,922.16
5. 期末基金份额净值	0.9297	0.9273

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

东吴双三角股票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
过去三个月	-7.37%	1.61%	-1.39%	0.96%	-5.98%	0.65%

东吴双三角股票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	-7.58%	1.61%	-1.39%	0.96%	-6.19%	0.65%

注：1.本基金成立于2017年12月5日，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期；

2.基金业绩比较基准=中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%。

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.本基金成立于2017年12月5日，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期；

2.基金业绩比较基准=中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%。

§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		
彭敢	首席投资官兼权益投资总部总经理、基金经理	2017年12月5日	-	16年	彭敢，硕士研究生。曾任大鹏证券研究所研究员、银华基金有限公司投资部研究员、银华基金管理有限公司投资管理部研究员、万联证券有限责任公司研发中心首席分析师、财富证券有限责任公司证券投资部投资经理、宝盈基金管理有限公司基金经理等职，2017年2月28日加入我司，现任公司首席投资官兼权益投资总部总经理，自2017年7月14日起担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，自2017年12月5日起担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
曹松涛	基金经理	2017年12月5日	-	11年	曹松涛，金融学博士。2004年4月至2005年12月在招商证券总裁办工作，任研究员，2006年9月至2007年7月脱产读博士一年，2007年9月至2011年3月在招商证券战略发展部工作，历任高级研究员，总经理助理，2011年4月至2014年8月在招商证券股票投资部工作，任海外投资董事。2014年8月至2016年12月在宝盈基金管理有限公司工作，任专户投资部投资经理。2017年1月3日加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理，其中，自2017年4月14日起任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，自2017年12月5日起担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。

注：1.彭敢与曹松涛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 报告期内基金投资策略和运作分析

双三角2017年11月底完成发行，12月初开始运作。1月初打开申购和赎回时，略有盈利。年初，管理人判断煤炭在供给侧改革后，在宏观经济总体保持稳定的情况下盈利能维持全年稳定增长，而估值显著低估，因而在煤炭股上有较重的配置。目前披露的一季报预告来看，判断基本正确。但在股价的市场表现看，煤炭股经历了一个初期大幅上涨，随后大幅下跌的过程，给净值带来较大的拖累。此外，由于国际市场的变化，港股市场也经历了一个大幅下跌的过程，本基金有较多的港股配置也显著拖累了业绩。

现在来看，煤炭股下跌后目前的估值有显著优势，但市场对传统产业的增长有较大的疑虑，而煤炭价格上涨后，产能恢复可能超预期，影响煤炭价格的稳定进而拖累盈利增长，这种疑虑是否会成为事实，目前还难以判断。近期，基于这种市场判断，管理人减持了部分煤炭股，但会密切关注煤炭供需的变化来决定煤炭持仓的操作。港股市场上，国际资金的流动和国内南下资金的流动是股票上涨下跌的主要因素，考虑到目前的政治经济形势，管理人倾向于认为港股上涨动力低于2017年，会适当降低在港股的持仓，但对一些优质成长公司，在估值有利的情况下，会积极调整仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴双三角股票A基金份额净值为0.9297元，基金累计份额净值为0.9297元，本报告期基金份额净值增长率为-7.37%；同期业绩比较基准收益率为-1.39%；截至本报告期末东吴双三角股票C基金份额净值为0.9273元，基金累计份额净值为0.9273元，本报告期基金份额净值增长率为-7.58%；同期业绩比较基准收益率为-1.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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的情形。

§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	372,643,008.42	87.01
	其中：股票	372,643,008.42	87.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
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	54,149,523.10	12.64
8	其他资产	1,483,488.77	0.35
9	合计	428,276,020.29	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	23,246,681.89	5.82
C	制造业	180,216,366.67	45.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,052,545.00	1.02
E	建筑业	14,352,542.00	3.60
F	批发和零售业	16,629,209.87	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	4,626,659.62	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,197,308.00	5.06
J	金融业	1,090,000.00	0.27
K	房地产业	4,120,000.00	1.03
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	10,525,075.20	2.64
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	-	-
	合计	279,056,388.25	69.91

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	19,226,843.08	4.82
B 消费者非必需品	10,616,402.25	2.66
C 消费者常用品	3,285,125.00	0.82
D 能源	6,650,375.00	1.67
E 金融	8,203,357.75	2.06
F 医疗保健	10,667,201.50	2.67
G 工业	7,388,417.59	1.85
H 信息技术	27,548,898.00	6.90
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	93,586,620.17	23.45

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

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	002215	诺普信	3,208,911	25,222,040.46	6.32
2	300613	富瀚微	115,400	20,197,308.00	5.06
3	600879	航天电子	2,107,410	16,732,835.40	4.19
4	603517	绝味食品	468,046	16,194,391.60	4.06
5	002023	海特高新	1,507,271	15,057,637.29	3.77
6	02018	瑞声科技	130,000	14,749,410.00	3.70
7	600477	杭萧钢构	1,570,300	14,352,542.00	3.60
8	600038	中直股份	275,300	13,310,755.00	3.33
9	300413	快乐购	321,100	12,962,807.00	3.25
10	00700	腾讯控股	39,000	12,799,488.00	3.21

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有股指期货。

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持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	294,277.58
2	应收证券清算款	1,172,885.10
3	应收股利	-
4	应收利息	11,608.23
5	应收申购款	4,717.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,483,488.77

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

	东吴双三角股票A	东吴双三角股票C
报告期期初基金份额总额	420,620,359.77	90,805,435.66
报告期期间基金总申购份额	102,174,702.28	10,985,272.37
减：报告期期间基金总赎回份额	136,527,014.61	58,595,629.14
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	386,268,047.44	43,195,078.89

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。

§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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比	
机构	1	20180319-20180331	86,453,044.33	-	-	86,453,044.33	20%	
个人	-	-	-	-	-	-	-	
产品特有风险								

1.巨额赎回风险

（1）本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

（2）单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

2.转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

3.流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

8.2 影响投资者