

# 信息披露 disclosure

## 东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金

### 2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

重要提示  
基金管理人及基金托管人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10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。  
本报告日期为2018年7月1日起至9月30日止。



4.1 基金概况 (或基金基本情况) 简介

基金名称 东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人 东吴基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

基金合同生效日期 2017年11月12日

报告期末基金份额总额 11,881,767.13份

投资目标 本基金采用资产配置策略,对股票、债券及其他投资品种进行优化配置,追求基金资产长期增值。

投资策略 本基金采用资产配置策略,追求基金资产长期增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%

风险收益特征 本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,541,389.91
2.本期利润	-1,266,956.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1038
4.期末基金资产净值	11,723,852.76
5.期末基金份额净值	0.9867

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列示数据。

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	-9.82%	1.69%	-0.74%	0.67%	-8.70%	0.99%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金成立时间为2017年12月12日,截至本报告期末已完成建仓,建仓期间本基金各项资产配置比例符合合同约定。  
2.本基金投资于沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%业绩比较基准的偏离度为-0.0003。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
曹蔚	基金经理	2017年12月12日至今	16年	曹蔚,金融学硕士,2004年毕业于2006年12月在招商证券研究所担任研究员,2006年12月至2007年7月担任招商证券研究所研究员,2007年7月至2011年3月担任招商证券研究所研究员,2011年3月至2017年11月担任招商证券研究所研究员,2017年11月加入东吴基金管理有限公司,担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2017年11月12日起负责东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的日常投资管理。

## 东吴双三角股票型证券投资基金

### 2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

重要提示  
基金管理人及基金托管人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10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。  
本报告日期为2018年7月1日起至9月30日止。



4.1 基金概况 (或基金基本情况) 简介

基金名称 东吴双三角股票型证券投资基金

基金管理人 东吴基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

基金合同生效日期 2017年11月12日

报告期末基金份额总额 310,070,187.28份

投资目标 本基金主要投资于在国内市场具有良好发展前景的上市公司股票,追求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金采用资产配置策略,追求基金资产长期增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%

风险收益特征 本基金为股票型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-26,301,482.12
2.本期利润	-18,389,248.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0603
4.期末基金资产净值	299,829,887.76
5.期末基金份额净值	0.9746

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列示数据。

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	-6.09%	1.69%	-6.00%	1.01%	-0.90%	0.68%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金成立时间为2017年12月12日,截至本报告期末已完成建仓,建仓期间本基金各项资产配置比例符合合同约定。  
2.本基金投资于沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%业绩比较基准的偏离度为-0.0003。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
曹蔚	基金经理	2017年12月12日至今	16年	曹蔚,金融学硕士,2004年毕业于2006年12月在招商证券研究所担任研究员,2006年12月至2007年7月担任招商证券研究所研究员,2007年7月至2011年3月担任招商证券研究所研究员,2011年3月至2017年11月担任招商证券研究所研究员,2017年11月加入东吴基金管理有限公司,担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2017年11月12日起负责东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的日常投资管理。

## 东吴新兴产业精选混合型证券投资基金

### 2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

重要提示  
基金管理人及基金托管人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10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。  
本报告日期为2018年7月1日起至9月30日止。



4.1 基金概况 (或基金基本情况) 简介

基金名称 东吴新兴产业精选混合型证券投资基金

基金管理人 东吴基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

基金合同生效日期 2017年11月12日

报告期末基金份额总额 94,405,588.91份

投资目标 本基金为混合型基金,主要投资于新兴产业相关上市公司,分享新兴产业长期成长的投资机会,追求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金采用资产配置策略,追求基金资产长期增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%

风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-9,436,796.88
2.本期利润	-2,589,241.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0288
4.期末基金资产净值	130,513,428.18
5.期末基金份额净值	1.3846

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列示数据。

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	-1.84%	1.60%	-4.77%	1.07%	2.93%	0.53%

注:业绩比较基准=75%\*沪深300指数收益率+25%\*中国债券综合指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金成立时间为2017年12月12日,截至本报告期末已完成建仓,建仓期间本基金各项资产配置比例符合合同约定。  
2.本基金投资于沪深300指数收益率\*70%+中国债券综合指数收益率\*30%业绩比较基准的偏离度为-0.0003。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
曹蔚	基金经理	2018年3月12日至今	16年	曹蔚,金融学硕士,2004年毕业于2006年12月在招商证券研究所担任研究员,2006年12月至2007年7月担任招商证券研究所研究员,2007年7月至2011年3月担任招商证券研究所研究员,2011年3月至2017年11月担任招商证券研究所研究员,2017年11月加入东吴基金管理有限公司,担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2017年11月12日起负责东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的日常投资管理。

5.1 投资组合报告

5.1.1 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	121,324,727.86	92.30
2	其中:股票	121,324,727.86	92.30
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	3,000,000.00	2.29
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	6,706,417.54	5.11
9	其他资产	126,209.00	0.10
10	合计	131,156,348.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股权投资投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股权投资投资组合

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	7,468,262.64	63.62
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	463,388.60	3.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	2,797,944.00	23.87
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、环境和公共设施服务业	-	-
O	国防军工、修和基础设施服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	医疗保健业	-	-
S	综合	-	-
合计		10,720,015.04	91.44

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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	300476	远光软件	70,900	1,089,024.00	9.29
2	002815	捷达技术	62,500	1,069,620.00	9.05
3	300623	安联科技	16,200	1,066,944.00	9.01
4	603019	中研股份	22,400	1,050,112.00	8.96
5	601799	华泰股份	20,001	1,047,252.36	8.92
6	603888	石基股份	80,400	934,200.00	8.13
7	002630	福瑞泰科	75,500	934,200.00	7.99
8	300277	珈伟股份	74,000	921,300.00	7.88
9	300470	巨帆新材	32,000	922,120.00	7.79
10	300166	万邦医药	40,800	820,080.00	6.99

5.2.3 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组合

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	300476	远光软件	70,900	1,089,024.00	9.29
2	002815	捷达技术	62,500	1,069,620.00	9.05
3	300623	安联科技	16,200	1,066,944.00	9.01
4	603019	中研股份	22,400	1,050,112.00	8.96
5	601799	华泰股份	20,001	1,047,252.36	8.92
6	603888	石基股份	80,400	934,200.00	8.13
7	002630	福瑞泰科	75,500	934,200.00	7.99
8	300277	珈伟股份	74,000	921,300.00	7.88
9	300470	巨帆新材	32,000	922,120.00	7.79
10	300166	万邦医药	40,800	820,080.00	6.99

5.2.4 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债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160000	16国债01	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
2	160001	16国债02	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
3	160002	16国债03	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
4	160003	16国债04	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
5	160004	16国债05	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
6	160005	16国债06	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
7	160006	16国债07	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
8	160007	16国债08	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
9	160008	16国债09	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
10	160009	16国债10	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010001	上证50ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
2	010002	沪深300ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
3	010003	创业板ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
4	010004	上证180ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
5	010005	上证380ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
6	010006	上证500ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
7	010007	上证800ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
8	010008	上证900ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
9	010009	上证1000ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
10	010010	上证1200ETF权证	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74

5.2.6 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

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160000	16国债01	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
2	160001	16国债02	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
3	160002	16国债03	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
4	160003	16国债04	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
5	160004	16国债05	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
6	160005	16国债06	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
7	160006	16国债07	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
8	160007	16国债08	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
9	160008	16国债09	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
10	160009	16国债10	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74

5.2.7 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股指期货投资

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1809	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
2	IF1810	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
3	IF1811	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
4	IF1812	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
5	IF1901	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74

5.2.8 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国债期货投资

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1809	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
2	TF1810	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
3	TF1811	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74
4	TF1812	1,000,000.00	1,000,000.00	0.74