东吴货币市场证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴货币
基金主代码	583001
交易代码	583001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月11日
报告期末基金份额总额	3,047,837,026.68份
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式管理及量化分析,为投资者提供稳定的收益。
投资策略	本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测;在此基础之上,确定组合久期和类别资产配置比例;在此框架之下,通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	东吴货币A	东吴货币B
下属分级基金的交易代码	583001	583101
报告期末下属分级基金的份额总额	145,210,507.30份	2,902,626,519.38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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	东吴货币A	东吴货币B
1.本期已实现收益	481,681.30	27,871,541.23
2. 本期利润	481,681.30	27,871,541.23
3. 期末基金资产净值	145,210,507.30	2,902,626,519.38

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5978%	0.0022%	0.3366%	0.0000%	0.2612%	0.0022%

注:1、比较基准=同期七天通知存款利率(税后)。

2、本基金收益分配按日结转份额。

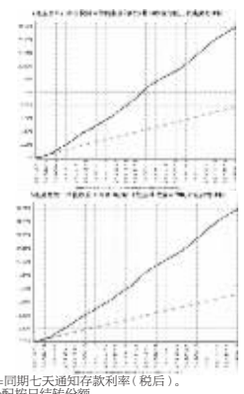
东吴货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6576%	0.0022%	0.3366%	0.0000%	0.3210%	0.0022%

注:1、比较基准=同期七天通知存款利率(税后)。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、比较基准=同期七天通知存款利率(税后)。
2、本基金收益分配按日结转份额。

§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		
邵笛	基金经理	2014年10月31日	-	12年	邵笛,硕士,上海财经大学工商管理专业。曾就职于上海文筑建筑咨询公司、上海永一房产咨询有限公司,自2006年9月起加入东吴基金管理有限公司,一直从事证券投资研究工作,曾任交易员、研究员、基金经理助理,自2014年10月31日起任东吴货币市场证券投资基金基金经理,自2018年4月11日起担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,自2018年4月23日起担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金,自2019年4月1日起担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理。
王文华	基金经理	2018年4月11日	-	12年	王文华,历任中诚信证券评估有限公司信贷评级分析员、联合证券股份有限公司投资银行高级项目经理、中诚信证券评估有限公司债券信用评级高级分析师。2012年3月至今就职于东吴基金管理有限公司,曾任固定收益部研究员、基金经理助理,现任基金经理,其中,自2014年10月16日起担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理,自2016年11月7日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,自2018年4月11日起担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期为对外公告之日。

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,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

3月底4月初,PMI数据超预期上行至50.5,中微观数据显示经济在逐步回暖,同时货币市场价格走高,引发市场对央行货币政策边际趋紧的猜测。债券市场调整,10年期国开债收益率最高上行至3.88%左右。4月末,央行加大公开市场力度,并开展定向中期借贷便利,货币市场价格回落。4月和5月,PMI逐步回落至50.1和49.40,工业增加值当月同比也大幅下滑至5.4%和5%,经济增速下滑的压力逐步显现,10年期国开债收益率逐步下行,6月末至3.6%附近。

本基金资产配置:以存款和存单为主,剩余期限适中。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期东吴货币A的基金份额净值收益率为0.5978%,本报告期东吴货币B的基金份额净值收益率为0.6576%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	固定收益投资	2,113,794,534.79	64.26
	其中:债券	2,113,794,534.79	64.26
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	803,539,661.31	24.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	352,113,705.99	10.70
4	其他资产	20,119,687.89	0.61
5	合计	3,289,567,589.98	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.45
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	239,999,680.00	7.87
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

本基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过120天,如有超过应当在10个交易日内调整。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	36.93	7.87
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	16.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.27	7.87

注:本基金合同约定本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天。

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	69,375,352.55	2.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	380,273,844.52	12.48
	其中:政策性金融债	279,890,108.27	9.18
4	企业债券	77,741,323.39	2.55
5	企业短期融资券	1,178,703,583.11	38.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	407,700,431.22	13.38
8	其他	-	-
9	合计	2,113,794,534.79	69.35
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1628017	16民生银行01	1,000,000	100,383,736.25	3.29
2	071900023	19浙商证券CP001	1,000,000	100,086,036.27	3.28
3	011901403	19苏交通SCP014	1,000,000	99,964,611.85	3.28
4	011901343	19华能SCP005	1,000,000	99,900,604.68	3.28
5	011901182	19苏交通SCP008	1,000,000	99,878,742.42	3.28
6	071900036	19中信CP005	1,000,000	99,772,445.14	3.27
7	011900396	19中电信SCP003	1,000,000	99,691,808.54	3.27
8	011900728	19南电SCP014	1,000,000	99,592,434.46	3.27
9	111909154	19浦发银行CD154	1,000,000	99,538,969.50	3.27
10	111994117	19南京银行CD020	1,000,000	99,358,709.08	3.26

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1797%
报告期内偏离度的最低值	0.1020%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1340%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为1.0000元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,652.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,968,818.73
4	应收申购款	3,146,217.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,119,687.89

5.9.4 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	东吴货币A	东吴货币B
报告期期初基金份额总额	75,936,135.83	4,877,039,162.66
报告期期间基金总申购份额	168,230,348.03	4,419,261,905.14
报告期期间基金总赎回份额	98,955,976.56	6,393,674,548.42
报告期期末基金份额总额	145,210,507.30	2,902,626,519.38

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、份额级别调整和转换入份额,基金总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§7 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	20190627 - 20190630	652,207,471.34	5,088,325.93	-	657,295,797.27	21.57%	
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 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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货币市场证券投资基金设立的文件;

2、《东吴货币市场证券投资基金基金合同》;

3、《东吴货币市场证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5、报告期内东吴货币市场证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

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
2019年7月18日

东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴配置优化混合
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月25日
报告期末基金份额总额	123,429,832.17份
投资目标	本基金根据不同市场情况变化,对股票、债券及其他投资品种的配置进行优化调整,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金在严格风险控制的基础上,追求稳健收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,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	中国农业银行股份有限公司

§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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	1,731,430.72
2.本期利润	1,862,937.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0299
4.期末基金资产净值	128,983,781.50
5.期末基金份额净值	1.0450

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。

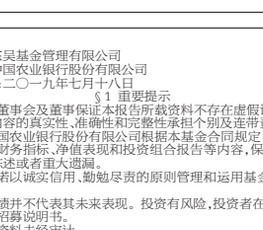
3.2 基金净值表现

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	1.68%	0.46%	-0.72%	0.75%	2.40%	-0.29%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%

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. 业绩比较基准=沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%

2.本基金转型日为2017年12月25日。

§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		
程涛	公司总经理助理兼投资总监、基金经理	2018年4月19日	2019年4月30日	15年	程涛,博士,曾任联合证券有限责任公司投资银行部高级经理,泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理,农银汇理基金管理有限公司基金经理、投资部总经理;2013年3月起程涛同志加入东吴基金管理有限公司,曾任公司基金经理、总经理助理、首席投资官、专户投资总监等职,现任公司总经理助理兼投资总监、基金经理。其中,2013年8月1日至2015年2月6日任东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理,2013年10月1日至2015年2月6日任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理,2013年8月13日至2015年2月6日任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理,2014年3月19日至2015年4月14日任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年6月21日至2019年4月30日担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年2月27日至2019年4月30日担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年4月19日至2019年4月30日担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(2017年12月25日由原东吴配置优化混合型证券投资基金转型)基金经理。
戴斌	权益投资总部副总经理、基金经理	2019年4月29日	-	12年	戴斌,博士,中国人民大学金融学专业毕业。自2007年1月起加入东吴基金管理有限公司一直从事证券投资研究工作,曾任研究部宏观经济、金融工程研究员、产品策划部产品设计研究员、基金经理助理,现任权益投资总部副总经理、基金经理,其中,自2014年12月12日起担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理,自2019年4月29日起担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(原东吴配置优化混合型证券投资基金)基金经理。其中,2015年5月27日至2017年5月6日担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年8月19日至2017年7月29日担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理,2015年7月1日至2017年12月18日担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2013年12月24日至2018年12月5日担任东吴新产业精选混合型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,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

2019年二季度,宏观经济再次进入调整。6月份PMI指数录得49.4%,已经连续两个月位于50%的荣枯线以下;三驾马车中,投资数据继续回落,5月份固定资产投资回落至5.6%,环比下滑0.5个百分点;消费数据略有反弹,5月份社零数据录得8.6%,环比回升1.4个百分点,但依然难改趋势性下滑的态势;出口数据受到贸易战的扰动,5月份贸易顺差417亿元,同比增长77.9%。同时,货币供应量保持稳定,5月份M2增速8.5%,与4月份保持一致。

外部环境再起波澜。中美贸易谈判再次陷入僵局,以华为为代表的中国高科技公司被美方列入关注名单,导致市场风险偏好急速下降。同时,MSCI再次扩容,海外资金对国内股市的配置需求升温。

在这样的大环境下,二季度股票市场整体上表现为指数震荡调整,风格回归消费蓝筹的特征。上证综指下跌3.62%,创业板指数下跌10.75%。其中,申万二级指数的食品饮料板块二季度上涨13.16%,银行上涨3.18%,建材、家电、休闲服务均录得上涨;相对应的,传媒、轻工、电气设备、建筑、纺织服装、综合、电子、钢铁、计算机等板块跌幅靠前。

这一阶段,配置优化基金以稳健为主要考虑,配置上偏向于低估值大蓝筹,于市场调整阶段获得了相对收益。未来配置优化基金将在坚持稳健投资理念的同时,加强成长性板块的研究,在半导体、5G等新产业领域寻找机会。

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1.0450元;本报告期基金份额净值增长率为1.68%,业绩比较基准收益率为-0.72%。

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2019年4月1日至2019年5月21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	38,853,015.03	29.89
	其中:股票	38,853,015.03	29.89
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	56,074,051.17	43.13
8	其他资产	35,075,134.72	26.98
9	合计	130,002,200.92	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	2,774,936.05	2.15
C	制造业	8,230,736.26	6.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,741,185.75	4.45
E	建筑业	4,677,409.63	3.63
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,128,276.82	2.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	14,300,470.52	11.09
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	-	-
	合计	38,853,015.03	30.12

5.2.2 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。

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	601398	工商银行	700,300	4,124,767.00	3.20
2	601939	建设银行	549,000	4,084,560.00	3.17
3	601988	中国银行	1,016,900	3,803,206.00	2.95
4	600690	青岛海尔	160,394	2,773,212.26	2.15
5	601668	中国建筑	476,601	2,740,455.75	2.12
6	601328	交通银行	373,846	2,287,937.52	1.77
7	600011	华能国际	332,676	2,072,571.48	1.61
8	600019	宝钢股份	300,050	1,950,325.00	1.51
9	601800	中国交建	171,109	1,936,963.88	1.50
10	600027	华电国际	512,441	1,931,902.57	1.50

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	36,489.03
2	应收证券清算款	34,948,646.39
3	应收股利	-
4	应收利息	10,019.29
5	应收申购款	79,980.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,075,134.72

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,分项之和于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	13,758,527.67
报告期期间基金总申购份额	113,451,128.26
减:报告期期间基金总赎回份额	3,779,823.76
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	123,429,832.17

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交易明细

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	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	20190426 - 20190521	0.00	9,725,707.62	0.00	9,725,707.62	7.88%
个人	2	20190426 - 20190521	0.00	9,725,707.62	0.00	9,725,707.62	7.88%
	3	20190522 - 20190630	0.00	36,814,785.75	0.00	36,814,785.75	29.83%
产品	4	20190429 - 20190521	0.00	8,753,039.59	0.00	8,753,039.59	7.09%
产品	5	20190529 - 20190602	0.00	19,414,619.94	0.00	19,414,619.94	15.73%
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 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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保本混合型证券投资基金设立的文件(2015年8月19日起东吴保本混合型证券投资基金转型为"东吴配置优化混合型证券投资基金");

2、中国证监会批准东吴配置优化混合型证券投资基金设立的文件(2017年12月25日起东吴配置优化混合型证券投资基金转型为"东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金");

3、《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

4、《东吴配置优化灵