东吴双三角股票型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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
送出日期：二〇一九年八月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴双三角股票	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	260,245,479.66份	
基金合同存续期	不定期	
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	229,070,761.98份	31,174,717.68份

2.2 基金产品说明

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	本基金业绩比较基准=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%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	田青
	联系电话	021-50509888-8206	010-67595096
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴双三角股票A	东吴双三角股票C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	28,325,453.97	3,873,026.87
本期利润	27,364,748.54	4,283,525.88
加权平均基金份额本期利润	0.1122	0.1269
本期基金份额净值增长率	12.49%	12.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1509	-0.1592
期末基金资产净值	194,500,957.73	26,212,003.56
期末基金份额净值	0.8491	0.8408

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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，例如基金的认购、申购、赎回费等，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 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

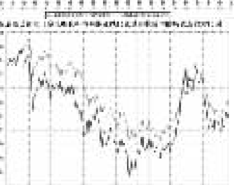
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.54%	1.33%	3.82%	0.85%	-2.28%	0.48%
过去三个月	-11.02%	1.77%	-5.40%	1.08%	-5.62%	0.69%
过去六个月	12.49%	1.71%	13.64%	1.11%	-1.15%	0.60%
过去一年	2.07%	1.67%	-2.70%	1.14%	4.77%	0.53%
自基金合同生效起至今	-15.09%	1.58%	-11.76%	1.06%	-3.33%	0.52%

东吴双三角股票C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.50%	1.34%	3.82%	0.85%	-2.32%	0.49%
过去三个月	-11.14%	1.77%	-5.40%	1.08%	-5.74%	0.69%
过去六个月	12.21%	1.71%	13.64%	1.11%	-1.43%	0.60%
过去一年	1.56%	1.67%	-2.70%	1.14%	4.26%	0.53%
自基金合同生效起至今	-15.92%	1.58%	-11.76%	1.06%	-4.16%	0.52%

注：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份额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：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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于2004年8月27日获证监基字［2004］32号开业批文，并于2004年9月2日正式成立。注册资本1亿元人民币，公司所在地为上海市浦东新区源深路279号。目前由东吴证券股份有限公司和海澜集团有限公司分别控股70%和30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来，始终坚守"待人忠、办事诚、共享共赢"的东吴文化，追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来，在泛资管大背景下，公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展，进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至2019年6月末，公司旗下管理着29只公募基金，资产管理总规模688亿元（包括专户、专项资产管理规模），涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线，可满足不同类型投资者的投资需求。自2015年以来，公司在成长股投资的传统优势基础上，进一步引入了量化投资策略，并在业内率先成立了绝对收益部，谋求穿越牛熊的长期业绩回报。

经过多年积累和布局，公司的公募业务已形成三大投研"特色"：1.权益投资坚持自下而上精选优质成长股，把握中国经济转型升级机遇；2.绝对收益提倡"用权益投资做绝对收益"的理念，借助量化模型进行择时和选股；3.固定收益以稳健为本，兼顾流动性与收益率，为大类资产配置提供基础性工具。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	-	17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、国信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	2019年5月13日	12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，曾任基金经理，其中，2017年4月14日至2019年5月13日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，2017年12月5日至2019年5月13日任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
胡启聪	基金经理	2019年6月21日	-	4.5年	胡启聪，2012年11月毕业于香港科技大学，获硕士学位。2012年08月至2014年06月就职于国信证券深圳红岭分公司，从事机构相关业务；2014年06月至2014年09月实业企业学习深造；2014年09月至2016年12月就职于宝盈基金管理有限公司，任投资部投研秘书。2016年12月至今就职于东吴基金管理有限公司，从事投资研究工作，现任基金经理，其中，自2019年6月21日起任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期及离任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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，未发现异常情况。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

19年二季度，市场在经历了年初一波的快速普涨后，进入震荡期，在内部流动性宽松的边际转向、重提去杠杆、和外部贸易战谈判进度不及预期等各种因素影响下，市场快速调整，半个月内各大主要指数下跌幅度超过10%。

1季度市场的大幅上涨后，我们判断市场短期上涨过快，各种利好因素已经相对充分反映，继续向上的动力不足，随时有可能面临调整。基于这样的判断，4月份以来，我们适当降低了仓位，对前期涨幅较大的品种进行了减仓，转而配置一些基本面扎实、安全边际较高的低位品种。从二季度的具体操作来看，我们减持了前期涨幅较大的5G零部件厂商、互联网内容审核的龙头公司，加配了基本面好转的非银龙头、成长性突出的小银行龙头和公用事业领域的水电公司，使得整体组合的估值大幅下降，对基金净值的整体回撤做了正贡献。在具体行业配置上，我们从着眼于3-5年长期思路，坚持着以满足美好生活需求为核心的消费，以及建设科技强国为目标的创新产业投资主线，重点布局具备"新成长股"特征的优质标的，涵盖互联网云计算、基因检测、5G通信、新能源产业链后端服务、人工智能、高端装备制造等行业。在此前提下，根据市场环境的变化，灵活调整组合配置，适当选择估值低、业绩增长确定性强的周期行业品种。

从长期来看，我们认为"以满足人们各种需求和提高生活品质的新消费方式和产品、以人工智能、新能源为主线，新技术新产品的探索、以自主可控、自强为目标的核心技术与设备的研发制造"等会是未来经济发展的中流砥柱，这些行业的优质公司也会成为资本市场的中坚力量。在经历了外部和内部冲击过后，中国社会从上至下更加意识到创新的力量，拥有核心技术的重要性，伴随着科创板的推出，我们有信心未来科技创新将会在社会进步、经济发展中扮演愈发重要的角色。

4.4.2 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0.8491元，本报告期基金份额净值增长率为12.49%；截至本报告期末东吴双三角股票C基金份额净值为0.8408元，本报告期基金份额净值增长率为12.21%；同期业绩比较基准收益率为13.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，在中美贸易战出现缓和、预期基本面触底走平和政策支持力度加大的背景下，我们预计A股市场将会出现阶段性的投资机会。

从外部环境来看，6月G20峰会后中美两国都同意重启谈判，美国不再对中国出口产品加征新的关税，且华为事件也出现了一定转机。虽然目前看尚未达成明确的共识，但重启谈判本身就是市场悲观预期的修复。

从国内情况来看，截止7月15日约45%的A股上市公司披露了中报预告，可比口径下，预计主板（剔除中兴通讯）/中小板/创业板 /全部 A 股 2019H1净利润增速分别为+8.6%/-6.0%/-3.0%/+1.0%。对应Q2单季度盈利增速分别为2.9%/+5.4%/+7.9%/+5.0%，环比分别-13.4 %/+27.4 %/+22.2%/+9.0%。主板二季度盈利下滑趋势依旧，而中小板和创业板的环比上升则主要受益于基数影响，但板块中大市值个股业绩明显超过中小市值。虽然披露的公司数量有限，但管中规豹上市公司基本面的压力还是比较大的。在这样的背景下，市场预期一系列的支撑和促进政策将会出台，叠加前期对冲政策的效果逐步显现和外部环境的好转，投资者对于基本面的预期边际改善，有利于整体市场信心的恢复。

从政策力度来看，下半年一系列刺激和激励政策有望持续。首先，国内宏观流动性持续充裕，预计7月中旬会再次降准；其次，调结构和开放类政策的会持续推出；再次，积极的财政政策也会择机调整。

虽然内外部的压力依然很大，但本基金管理人认为经济将在多重政策支持下企稳，A股市场也会有结构性机会。经历了过去经济的高速发展，下一阶段改革创新将会是中国经济新的核心动力，在科技进步、产业升级的背景下，我们对未来充满信心。中长期来看，我们认为"以满足人们各种需求和提高生活品质的新消费方式和产品、以人工智能、新能源为主线，新技术新产品的探索、以自主可控、自强为目标的核心技术与设备的研发制造"等会是未来经济发展的中流砥柱，这些行业的优质公司也会成为资本市场的中坚力量。在经历了外部和内部冲击过后，中国社会从上至下更加意识到创新的力量，拥有核心技术的重要性，伴随着科创板的推出，我们有信心未来科技创新将会在社会进步、经济发展中扮演愈发重要的角色。

我们相信，企业的持续盈利才是股票投资长期获利的根本来源；因此，我们将继续在自身能力圈范围以内，严格控制风险，维持稳定的投资风格，专注于自下而上的挑选行业发展空间大、具备竞争优势的龙头公司，分散持股，长期投资，力争通过分享企业价值来获取良好的长期投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、绝对收益部、固定收益部、专户投资部）负责人、合规风控部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；公司副总经理、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴双三角股票型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	24,728,895.62	11,239,898.64
结算备付金	737,059.07	2,210,395.33
存出保证金	744,244.73	312,808.06
交易性金融资产	196,163,390.52	211,168,165.81
其中：股票投资	196,163,390.52	211,168,165.81
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,123,367.67	4,999,813.61
应收利息	5,053.58	3,059.39
应收股利	135,875.80	-
应收申购款	19,093.12	17,783.13
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	224,656,980.11	229,951,923.97
负债和所有者权益	**本期末 2019年6月30日**	**上年度末 2018年12月31日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,613,154.50	1,689,233.29
应付赎回款	363,024.10	112,181.77
应付管理人报酬	269,149.77	292,780.08
应付托管费	44,858.28	48,796.70
应付销售服务费	10,663.37	12,426.59
应付交易费用	546,334.40	751,322.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	96,834.40	220,000.00
负债合计	3,944,018.82	3,126,740.71
所有者权益：		
实收基金	260,245,479.66	300,787,091.88
未分配利润	-39,532,518.37	-73,961,908.62
所有者权益合计	220,712,961.29	226,825,183.26
负债和所有者权益总计	224,656,980.11	229,951,923.97

注：本基金为分级基金，报告截止日2019年6月30日，份额总额为260,245,479.66份，其中东吴双三角股票A基金份额净值0.8491元，基金份额总额229,070,761.98份；东吴双三角股票C基金份额净值0.8408元，基金份额总额31,174,717.68份。

6.2 利润表

会计主体：东吴双三角股票型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	36,456,560.19	-58,581,380.66
1.利息收入	89,847.79	307,953.32
其中：存款利息收入	88,401.23	209,954.51
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,446.56	97,998.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	36,898,854.59	-23,235,453.71
其中：股票投资收益	35,774,142.12	-25,185,596.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,124,712.47	1,950,142.71
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-550,206.42	-36,519,400.49
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	18,064.23	865,520.22
减：二、费用	4,808,285.77	8,388,728.04
1. 管理人报酬	1,773,978.16	2,851,213.22
2. 托管费	295,663.02	475,202.27
3. 销售服务费	71,197.01	106,371.01
4. 交易费用	2,558,213.46	4,763,538.78
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	109,234.12	192,402.76
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	31,648,274.42	-66,970,108.70
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	31,648,274.42	-66,970,108.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴双三角股票型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	300,787,091.88	-73,961,908.62	226,825,183.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,648,274.42	31,648,274.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-40,541,612.22	2,781,115.83	-37,760,496.39
其中：1.基金申购款	11,771,220.70	-1,236,704.63	10,534,516.07
2.基金赎回款	-52,312,832.92	4,017,820.46	-48,295,012.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	260,245,479.66	-39,532,518.37	220,712,961.29
项目	**上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金**	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	511,425,795.43	1,873,146.85	513,298,942.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-66,970,108.70	-66,970,108.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-189,012,084.15	10,752,650.50	-178,259,433.65
其中：1.基金申购款	117,433,531.81	1,254,638.84	118,688,170.65
2.基金赎回款	-306,445,615.96	9,498,011.66	-296,947,604.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	322,413,711.28	-54,344,311.35	268,069,399.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____王炯____ ____徐明____ ____吴婷____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴双三角股票型证券投资基金（以下简称"本基金"），系经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2017]1573号文《关于准予东吴双三角股票型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于2017年12月5日正式生效，首次设立募集规模为511,425,795.43份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称"港股通标的股票"）、债券（含国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	184,811,711.06	11.09%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	95,826.80	6.60%	40,073.26	7.33%
关联方名称	**上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金**	**占当期佣金总量的比例**	**期末应付佣金余额**	**占期末应付佣金总额的比例**
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,773,978.16	2,851,213.22
其中：支付销售机构的客户维护费	870,563.22	1,533,092.48

注：基金管理费按前一日基金资产净值1.50%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	295,663.02	475,202.27

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 东吴双三角股票A	东吴双三角股票C	合计
东吴基金管理有限公司	-	4,791.80	4,791.80
东吴证券股份有限公司	-	8,484.81	8,484.81
中国建设银行股份有限公司	-	22,154.85	22,154.85
合计	-	35,431.46	35,431.46
获得销售服务费的各关联方名称	**上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 东吴双三角股票A**	**东吴双三角股票C**	**合计**
东吴基金管理有限公司	-	4,852.81	4,852.81
东吴证券股份有限公司	-	14,072.83	14,072.83
中国建设银行股份有限公司	-	30,036.58	30,036.58
合计	-	48,962.22	48,962.22

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	24,728,895.62	67,635.09	14,324,101.05	147,479.19

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
000791	甘肃电投	2019年6月11日	2019年12月11日	大宗交易买入	3.96	4.05	2,000,000	7,920,000.00	8,100,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	196,163,390.52	87.32
	其中：股票	196,163,390.52	87.32
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	25,465,954.69	11.34
8	其他各项资产	3,027,634.90	1.35
9	合计	224,656,980.11	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	17,452,576.89	7.91
B	采矿业	139,781.25	0.06
C	制造业	74,818,955.62	33.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,904,000.00	4.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,225,200.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	13,500.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,587,841.44	10.23
J	金融业	11,746,735.36	5.32
K	房地产业	6,459,297.60	2.93
L	租赁和商务服务业	2,392,800.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	12,075,368.00	5.47
N	水利、环境和公共设施管理业	7,864,257.75	3.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	64,346.80	0.03
R	文化、体育和娱乐业	3,317,706.60	1.50
S	综合	-	-
	合计	172,062,367.31	77.96

7.2.2 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	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	17,854,698.29	8.09
F 医疗保健	4,137,076.17	1.87
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	2,109,248.75	0.96
合计	24,101,023.21	10.92

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300676	华大基因	211,700	12,075,368.00	5.47
2	600201	生物股份	592,419	9,295,054.11	4.21
3	000791	甘肃电投	2,000,000	8,100,000.00	3.67
4	002488	金固股份	960,000	7,996,800.00	3.62
5	002549	凯美特气	1,367,697	7,864,257.75	3.56
6	01336	新华保险	200,000	6,685,416.00	3.03
7	603506	南都物业	265,160	6,459,297.60	2.93
8	002142	宁波银行	261,664	6,342,735.36	2.87
9	300624	万兴科技	113,800	5,488,574.00	2.49
10	601128	常熟银行	700,000	5,404,000.00	2.45

注：1、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站www.scfund.com.cn的半年度报告正文。

2、本基金报告期末持有甘肃电投（000791）上市流通及流通受限部分，上表中按同一股票合并计算。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002458	益生股份	24,224,785.28	10.68
2	603000	人民网	23,027,226.25	10.15
3	300001	特锐德	21,665,341.00	9.55
4	300655	晶瑞股份	20,230,474.28	8.92
5	300624	万兴科技	19,058,163.00	8.40
6	300684	中石科技	18,508,822.48	8.16
7	300348	长亮科技	16,904,348.00	7.45
8	02018	瑞声科技	16,449,056.24	7.25
9	300212	易华录	16,213,731.00	7.15
10	300047	天源迪科	15,988,821.04	7.05
11	300612	宣亚国际	15,645,960.50	6.90
12	000791	甘肃电投	15,359,264.00	6.77
13	603506	南都物业	15,209,192.07	6.71
14	300122	智飞生物	14,526,220.71	6.40
15	002549	凯美特气	14,349,890.79	6.33
16	300142	沃森生物	13,848,698.90	6.11
17	002118	紫鑫药业	13,528,217.00	5.96
18	000998	隆平高科	13,478,836.99	5.94
19	300761	立华股份	12,970,018.56	5.72
20	603043	广州酒家	12,748,849.95	5.62
21	600975	新五丰	12,732,623.62	5.61
22	002023	海特高新	12,327,402.14	5.43
23	600201	生物股份	12,291,305.32	5.42
24	01336	新华保险	12,284,387.34	5.42
25	002142	宁波银行	11,937,525.00	5.26
26	603882	金域医学	11,823,868.89	5.21
27	300676	华大基因	11,673,442.06	5.15
28	02196	复星医药	11,582,550.33	5.11
29	002488	金固股份	11,521,466.00	5.08
30	300252	金信诺	11,240,237.90	4.96
31	000681	视觉中国	9,952,089.00	4.39
32	601128	常熟银行	9,877,646.00	4.35
33	002234	民和股份	9,718,081.00	4.28
34	300253	卫宁健康	9,666,771.00	4.26
35	000766	通化金马	9,435,325.00	4.16
36	600572	康恩贝	9,269,558.50	4.09
37	300470	日机密封	9,210,426.10	4.06
38	300601	康泰生物	9,180,707.00	4.05
39	002182	云海金属	8,598,020.00	3.79
40	002215	诺普信	8,556,769.00	3.77
41	000786	北新建材	8,492,731.00	3.74
42	300125	易世达	7,901,282.00	3.48
43	002611	东方精工	7,679,300.00	3.39
44	300454	深信服	7,666,099.00	3.38
45	300681	英搏尔	6,992,923.87	3.08
46	300094	国联水产	6,923,763.12	3.05
47	002661	克明面业	6,810,601.00	3.00
48	02628	中国人寿	6,743,994.56	2.97
49	00285	比亚迪电子	6,666,402.88	2.94
50	603713	密尔克卫	6,448,591.00	2.84
51	600995	文山电力	6,275,751.00	2.77
52	300178	腾邦国际	6,097,187.00	2.69
53	000806	ST银河	6,025,573.00	2.66
54	002773	康弘药业	5,712,163.00	2.52
55	300498	温氏股份	5,685,450.94	2.51
56	603605	珀莱雅	5,623,116.00	2.48
57	002200	*ST云投	5,550,907.00	2.45
58	002041	登海种业	5,202,587.00	2.29
59	00525	广深铁路股份	5,051,259.10	2.23
60	00772	阅文集团	4,904,899.02	2.16
61	00511	电视广播	4,780,627.04	2.11
62	600486	扬农化工	4,731,898.97	2.09
63	002926	华西证券	4,566,705.00	2.01

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300655	晶瑞股份	28,278,851.36	12.47
2	300454	深信服	27,995,506.80	12.34
3	300624	万兴科技	26,680,473.00	11.76
4	300252	金信诺	25,932,244.64	11.43
5	002458	益生股份	20,656,591.50	9.11
6	603506	南都物业	19,631,208.30	8.65
7	000791	甘肃电投	19,158,466.58	8.45
8	300212	易华录	18,795,136.60	8.29
9	000681	视觉中国	18,687,339.25	8.24
10	300122	智飞生物	17,539,666.20	7.73
11	300142	沃森生物	16,626,119.00	7.33
12	300001	特锐德	16,500,685.36	7.27
13	002118	紫鑫药业	16,142,071.00	7.12
14	300047	天源迪科	15,961,749.00	7.04
15	02018	瑞声科技	15,749,429.65	6.94
16	300684	中石科技	15,586,841.80	6.87
17	600975	新五丰	14,286,002.00	6.30
18	02196	复星医药	13,718,330.45	6.05
19	600201	生物股份	13,591,643.00	5.99
20	300470	日机密封	13,413,248.20	5.91
21	002023	海特高新	13,255,197.40	5.84
22	603000	人民网	13,251,023.43	5.84
23	002773	康弘药业	13,204,027.29	5.82
24	603882	金域医学	13,013,203.00	5.74
25	300761	立华股份	11,230,213.93	4.95
26	300253	卫宁健康	11,073,064.40	4.88
27	002549	凯美特气	10,631,584.26	4.69
28	002234	民和股份	10,453,773.00	4.61
29	300348	长亮科技	10,447,610.50	4.61
30	00525	广深铁路股份	10,235,291.79	4.51
31	300612	宣亚国际	10,076,137.90	4.44
32	600572	康恩贝	9,704,767.65	4.28
33	000998	隆平高科	9,415,439.96	4.15
34	300676	华大基因	9,373,056.00	4.13
35	600879	航天电子	9,267,958.75	4.09
36	002611	东方精工	9,227,021.60	4.07
37	600995	文山电力	9,203,403.00	4.06
38	300094	国联水产	9,118,402.00	4.02
39	603043	广州酒家	9,118,134.00	4.02
40	002182	云海金属	9,023,365.28	3.98
41	300070	碧水源	8,999,962.00	3.97
42	000786	北新建材	8,545,411.00	3.77
43	000766	通化金马	8,456,385.00	3.73
44	300125	易世达	8,212,148.45	3.62
45	002810	山东赫达	7,584,675.60	3.34
46	000806	ST银河	7,263,869.98	3.20
47	300681	英搏尔	7,209,691.00	3.18
48	002661	克明面业	7,056,356.84	3.11
49	002215	诺普信	6,969,622.26	3.07
50	603713	密尔克卫	6,894,126.00	3.04
51	00285	比亚迪电子	6,821,858.20	3.01
52	02628	中国人寿	6,406,483.73	2.82
53	01336	新华保险	6,060,241.24	2.67
54	02319	蒙牛乳业	6,054,299.71	2.67
55	002041	登海种业	6,016,116.00	2.65
56	300601	康泰生物	6,009,097.00	2.65
57	000710	贝瑞基因	5,999,343.00	2.64
58	300498	温氏股份	5,805,406.00	2.56
59	002142	宁波银行	5,743,001.51	2.53
60	603517	绝味食品	5,141,901.00	2.27
61	300623	捷捷微电	5,126,668.78	2.26
62	002563	森马服饰	4,950,087.00	2.18
63	600486	扬农化工	4,859,298.50	2.14
64	00511	电视广播	4,767,446.65	2.10
65	00772	阅文集团	4,763,179.62	2.10
66	002926	华西证券	4,722,250.00	2.08
67	601128	常熟银行	4,715,000.00	2.08

注：本项的"卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	808,766,703.90
卖出股票收入（成交）总额	858,995,414.89

注：本项的"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未投资债券。

7.6 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

本基金报告期末未投资债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	744,244.73
2	应收证券清算款	2,123,367.67
3	应收股利	135,875.80
4	应收利息	5,053.58
5	应收申购款	19,093.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,027,634.90

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000791	甘肃电投	8,100,000.00	3.67	大宗交易流通受限

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%；前款交易的受让方在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
东吴双三角股票A	3,193	71,741.55	0.00	0.00%	229,070,761.98	100.00%
东吴双三角股票C	609	51,190.01	0.00	0.00%	31,174,717.68	100.00%
合计	3,802	68,449.63	0.00	0.00%	260,245,479.66	100.00%

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。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴双三角股票A	30,783.26	0.0134%
	东吴双三角股票C	-	-
	合计	30,783.26	0.0118%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴双三角股票A	东吴双三角股票C
基金合同生效日（2017年12月5日）基金份额总额	420,620,359.77	90,805,435.66
本报告期期初基金份额总额	262,431,677.59	38,355,414.29
本报告期期间基金总申购份额	7,356,135.44	4,415,085.26
减：本报告期期间基金总赎回份额	40,717,051.05	11,595,781.87
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,070,761.98	31,174,717.68

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内管理人未发生重大的人事变动。

本基金本报告期内托管人发生以下人事变动：

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天衡会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。公司高度重视，按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程，制定相关整改措施，落实整改工作。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
招商证券	1	397,004,166.35	23.83%	361,790.22	24.91%	-
国泰君安	2	254,408,593.83	15.27%	232,198.07	15.99%	-
国盛证券	1	237,257,261.66	14.24%	220,957.86	15.22%	-
海通证券	2	221,052,075.49	13.27%	202,302.77	13.93%	-
东吴证券	2	184,811,711.06	11.09%	95,826.80	6.60%	-
中信证券	2	134,248,498.57	8.06%	122,340.59	8.42%	-
恒泰证券	2	99,156,047.14	5.95%	90,361.06	6.22%	-
天风证券	2	84,207,496.31	5.05%	76,738.78	5.28%	-
国信证券	1	30,235,570.71	1.81%	28,158.37	1.94%	-
华创证券	1	23,653,904.28	1.42%	21,555.82	1.48%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期新增五个交易单元，分别为国盛证券、东方证券、西南证券、华创证券和光大证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司
2019年8月27日