东吴沪深300指数型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF))

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

§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。

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7月11日(基金合同生效日)起至9月30日止。(注:东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)报告期自2018年7月1日起至2018年7月10日止)。

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	东吴沪深300指数	
基金主代码	165806	
交易代码	165806	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年7月11日	
报告期末基金份额总额	5,208,612.38份	
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过紧密跟踪标的指数,力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。	
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法,进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来组合复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。	
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	东吴沪深300指数A	东吴沪深300指数C
下属分级基金的交易代码	165806	165810
报告期末下属分级基金的份额总额	5,208,612.38份	0.00份

转型前:

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	4,997,386.59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拟合、跟踪深证100价格指数,按照标准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(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月11日-2018年9月30日)	
	东吴沪深300指数A	东吴沪深300指数C
1.本期已实现收益	135,036.59	0.00
2.本期利润	-114,607.67	0.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0226	0.0000
4.期末基金资产净值	5,534,726.86	0.00
5.期末基金份额净值	1.0626	1.0626

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年7月10日)
1.本期已实现收益	-46,631.07
2.本期利润	-131,094.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0271
4.期末基金资产净值	5,428,014.45
5.期末基金份额净值	1.0960

3.2 基金净值表现(转型后)

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

东吴沪深300指数A

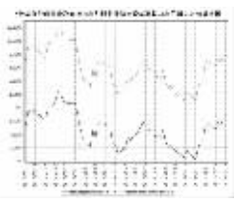
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.15%	1.29%	-0.78%	1.25%	-1.37%	0.04%

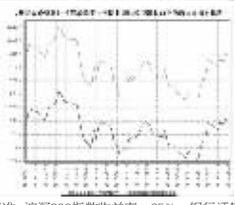
东吴沪深300指数C

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	-2.15%	1.29%	-0.78%	1.25%	-1.37%	0.04%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%;

2、东吴沪深300指数型证券投资基金由东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)变更而来,变更日期为2018年7月11日(即基金合同生效日)。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年,仍处于建仓期。

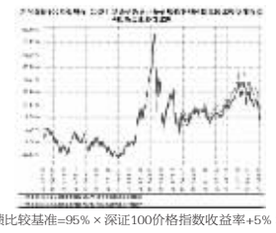
3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及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	-2.51%	2.02%	-2.01%	1.96%	-0.50%	0.07%

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变动的比较



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(转型前)

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	本基金基金经理	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06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日起担任东吴沪深300指数型证券投资基金(2018年7月11日由原东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)转型)、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,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	本基金基金经理	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月叁与我司筹建以来,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日起担任东吴沪深300指数型证券投资基金(2018年7月11日由原东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)转型)、自2017年3月9日起担任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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型后)

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	2018年7月11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06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日起担任东吴沪深300指数型证券投资基金(2018年7月11日由原东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)转型)、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日担任东吴安鑫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	2018年7月11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月叁与我司筹建以来,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日起担任东吴沪深300指数型证券投资基金(2018年7月11日由原东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)转型)、自2017年3月9日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期为基金合同生效日;

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

三季度国内外面临较大的困难。外部中美贸易摩擦不断反复、升级,长期化趋势明显。美国连续加息、缩表对全球,尤其是新兴市场流动性造成巨大影响,中国也不可避免受到冲击。国内经济数据相对平稳,但是去杠杆导致民营企业经营艰难,地方政府债务约束导致扩张受限,PM1、工业企业盈利增速、消费增速等高频数据显示经济下滑趋势已现,虽然政府出台稳增长政策,但是整体应对措施与市场预期之间有差距,加上汇率大幅贬值,引发对未来经济快速下滑、企业盈利下降的担忧及市场大幅波动。

报告期内,本基金主要采用复制指数配置策略,密切跟踪指数,控制相对基准的偏离;严格从基本面出发,坚持价值投资策略,从较长投资周期维度来精选有核心竞争力、估值低、业绩增长确定的优质公司,通过公司的长期业绩增长来克服市场的波动,获得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴沪深300指数A基金份额净值为1.0626元,本报告期基金份额净值增长率为-2.15%;截至本报告期末东吴沪深300指数C基金份额净值为1.0626元,本报告期基金份额净值增长率为-2.15%;同期业绩比较基准收益率为-0.78%。

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7月1日至2018年9月30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

转型后:

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	5,251,523.57	93.26
	其中:股票	5,251,523.57	93.26
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	327,166.33	5.81
8	其他资产	52,619.34	0.93
9	合计	5,631,309.24	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	7,868.40	0.14
B	采矿业	177,746.04	3.21
C	制造业	2,064,563.82	37.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	146,305.15	2.64
E	建筑业	170,770.71	3.09
F	批发和零售业	96,412.40	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	152,613.63	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,269.58	3.31
J	金融业	1,795,675.54	32.44
K	房地产业	269,222.53	4.86
L	租赁和商务服务业	75,859.63	1.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,345.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,481.58	0.48
R	文化、体育和娱乐业	70,399.56	1.27
S	综合	-	-
	合计	5,251,523.57	94.88

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601318	中国平安	5,483	375,585.50	6.79
2	600519	贵州茅台	243	177,390.00	3.21
3	600036	招商银行	5,256	161,306.64	2.91
4	601166	兴业银行	6,300	100,485.00	1.82
5	000651	格力电器	2,435	97,887.00	1.77
6	000333	美的集团	2,330	93,899.00	1.70
7	600016	民生银行	14,366	91,080.44	1.65
8	601328	交通银行	13,914	81,257.76	1.47
9	600887	伊利股份	3,132	80,429.76	1.45
10	601288	农业银行	19,400	75,466.00	1.36

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

本基金本报告期末未进行积极投资。

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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	2,153.11
2	应收证券清算款	45,421.54
3	应收股利	-
4	应收利息	67.31
5	应收申购款	4,977.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,619.34

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	93,899.00	1.70	重大资产重组

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

本基金本报告期末未进行积极投资。

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。

转型前:

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	4,596,716.00	82.55
	其中:股票	4,596,716.00	82.55
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	349,969.70	6.28
8	其他资产	622,010.45	11.17
9	合计	5,568,696.15	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	22,113.00	0.41
B	采矿业	16,875.00	0.31
C	制造业	2,929,772.37	53.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,814.00	0.66
F	批发和零售业	135,055.35	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	17,912.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	247,246.90	4.56
J	金融业	292,111.56	5.38
K	房地产业	310,113.24	5.71
L	租赁和商务服务业	116,267.20	2.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	49,787.38	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,150.00	1.53
R	文化、体育和娱乐业	52,878.00	0.97
S	综合	-	-
	合计	4,309,096.00	79.39

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	135,422.00	2.49
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	28,175.00	0.52
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	-	-
J	金融业	91,053.00	1.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	32,970.00	0.61
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	287,620.00	5.30

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	000651	格力电器	7,932	363,920.16	6.70
2	000333	美的集团	7,456	361,616.00	6.66
3	000858	五粮液	3,117	228,694.29	4.21
4	002415	海康威视	5,771	205,966.99	3.79
5	000002	万科A	6,300	152,145.00	2.80
6	000725	京东方A	39,917	137,314.48	2.53
7	002304	洋河股份	916	120,490.64	2.22
8	000001	平安银行	12,960	116,380.80	2.14
9	002027	分众传媒	11,864	116,267.20	2.14
10	000538	云南白药	830	84,909.00	1.56

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	66,080.00	1.22
2	600104	上汽集团	1,800	62,352.00	1.15
3	601888	中国国旅	500	32,970.00	0.61
4	600019	宝钢股份	4,000	30,440.00	0.56
5	300413	芒果超媒	700	28,175.00	0.52

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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	907.21
2	应收证券清算款	508,312.73
3	应收股利	-
4	应收利息	150.53
5	应收申购款	112,639.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	622,010.45

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(转型后)

单位:份

项目	东吴沪深300指数A	东吴沪深300指数C
基金合同生效日(2018年7月11日)基金份额总额	4,997,386.59	0.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	393,628.27	0.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	182,402.48	0.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	5,208,612.38	0.00

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。

§6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,786,774.76
报告期期间基金总申购份额	221,526.11
减:报告期期间基金总赎回份额	10,914.28
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	4,997,386.59

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(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型后)

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(转型后)

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型前)

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(转型前)

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	20180701-20180930	7,915,099.94	-	-	7,915,099.94	67.30%
	-	-	-	-	-	-	-
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,可能助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,或在基金合同约定,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.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。

5.《东吴沪深300指数型证券投资基金基金合同》;

6.《东吴沪深300指数型证券投资基金托管协议》;

7.基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

8.报告期内东吴沪深300指数型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
2018年10月25日

东吴优信稳健债券型证券投资基金

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

§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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴优信稳健债券
基金主代码	582001
交易代码	582001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月5日
报告期末基金份额总额	11,760,892.18份
投资目标	本基金属于债券型基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,在精选高信用等级债券基础上通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。
投资策略	本基金是一只债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅的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势企业股票作为投资对象。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金主要投资于高信用级别、投资价值高的债券资产,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。
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	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
下属分级基金的交易代码	582001	582201
报告期末下属分级基金的份额总额	11,349,834.69份	411,057.49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7月1日-2018年9月30日)	
	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
1. 本期已实现收益	-577,177.16	-18,072.29
2. 本期利润	-487,726.65	-36,460.70
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0428	-0.0638
4. 期末基金资产净值	12,667,996.62	442,644.73
5. 期末基金份额净值	1.1161	1.0768

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