东吴安享量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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	东吴安享量化
基金主代码	580007
交易代码	580007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月22日
报告期末基金份额总额	155,769,741.16份
投资目标	本基金在充分控制风险的前提下,采用定量、定性相结合的策略进行资产配置,追求持续的资产增值。
投资策略	本基金主要采用“自上而下”的投资思路进行大类资产及行业配置,并使用量化模型控制组合回撤,优化基金的风险收益结构。本基金一方面参考量化择时指标进行股票组合的开平仓和止损等投资交易,另一方面通过行业模型和多因子选股模型进行分散化投资,以期为投资者带来稳健收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中国债券综合全价指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益较高的基金产品。本基金力争通过资产配置,精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,741,262.64
2.本期利润	-8,191,636.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0525
4.期末基金资产净值	148,763,557.51
5.期末基金份额净值	0.955

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	-5.26%	1.16%	-0.87%	0.74%	-4.39%	0.42%

注:比较基准=沪深300指数收益率×55%+中国债券综合全价指数收益率×45%

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:比较基准=沪深300指数收益率×55%+中国债券综合全价指数收益率×45%

§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		
徐赠	基金经理	2015年5月29日	-	8年	徐赠先生,硕士,香港中文大学毕业。2009年7月至2010年12月就职于埃森哲咨询公司上海分公司任行业研究员,自2011年1月起加入东吴基金管理有限公司,一直从事投资研究工作,曾任研究员、基金经理助理,现任基金经理,其中自2015年5月12日起担任东吴多策略灵活配置型证券投资基金(2017年12月13日由原东吴内需增长混合型证券投资基金转型),自2015年5月29日起担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理,自2015年5月29日起担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年2月22日由原东吴新创业混合型证券投资基金基金经理转型)。

注:1、此处的任职日期及离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《证券从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

市场在过去的一个季度里呈现下跌走势。最终上证综指下跌0.92%,创业板指下跌12.16%。期间,金融股和石油石化等周期股良好的表现限制了上证综指的跌幅,而创业板指由于权重股的大幅下挫而出现大幅下跌。

东吴安享量化基金3季度重点布局价值白马股和优质成长股,但由于仓位较高且金融石化等权重股配置较少,导致跑输上证综指,下跌5.26%。

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0.955元;本报告期基金份额净值增长率为-5.26%,业绩比较基准收益率为-0.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内,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	120,149,833.08	80.49
	其中:股票	120,149,833.08	80.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,611,504.00	5.77
	其中:债券	8,611,504.00	5.77
	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	15,000,000.00	10.05
	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	5,333,426.35	3.57
8	其他资产	184,307.41	0.12
9	合计	149,279,070.84	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	1,673,881.32	1.13
B	采矿业	6,221,328.60	4.18
C	制造业	54,680,025.70	36.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,911,378.40	6.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,594,267.00	5.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,846,114.29	1.24
H	住宿和餐饮业	2,175,360.00	1.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,946,870.80	8.03
J	金融业	11,600,547.91	7.80
K	房地产业	1,812,780.00	1.22
L	租赁和商务服务业	4,621,551.52	3.11
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	1,256,730.20	0.84
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,808,997.34	3.23
S	综合	-	-
	合计	120,149,833.08	80.77

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	002353	杰瑞股份	91,600	3,092,416.00	2.08
2	601888	中国国旅	41,836	2,895,691.72	1.95
3	002801	沧州明珠	200,000	2,750,000.00	1.85
4	300003	乐普医疗	86,420	2,622,847.00	1.76
5	600886	国投电力	380,500	2,615,040.00	1.76
6	600028	中国石化	364,380	2,594,388.60	1.74
7	000895	双汇发展	96,779	2,530,770.85	1.70
8	300696	爱丽康视	70,416	2,503,288.80	1.68
9	601100	恒立液压	109,826	2,462,414.58	1.65
10	002179	中航光电	58,683	2,446,400.00	1.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,611,504.00	5.79
	其中:政策性金融债	8,611,504.00	5.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,611,504.00	5.79

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	85,000	8,551,000.00	5.75
2	018002	国开1302	600	60,504.00	0.04

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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	18,528.68
2	应收证券清算款	13,787.67
3	应收股利	-
4	应收利息	151,002.48
5	应收申购款	988.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	184,307.41

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

报告期期初基金份额总额	155,907,271.91
报告期期间基金总申购份额	168,277.68
减:报告期期间基金总赎回份额	305,808.43
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	155,769,741.16

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	20180701-20180930	144,000,000.00	-	-	144,000,000.00	92.44%	
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新创业股票型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴新创业混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴新创业混合型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、《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

6、《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

7、报告期内东吴安享量化灵活配置混合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

东吴安鑫量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:江苏银行股份有限公司
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。

基金托管人江苏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	东吴安鑫量化
基金主代码	002561
交易代码	002561
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月3日
报告期末基金份额总额	62,697,710.49份
投资目标	本基金采用量化策略进行选股和择时,控制风险,追求持续的资产增值。
投资策略	本基金采用以股票投资为主、固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略,进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损,另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合,以期为投资者带来稳定收益。
业绩比较基准	65%×中证800指数收益率+35%×中国债券综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

§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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,346,637.94
2.本期利润	8,829.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0001
4.期末基金资产净值	57,302,534.14
5.期末基金份额净值	0.914

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。

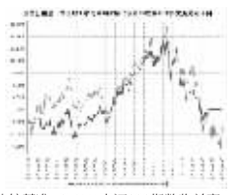
3.2 基金净值表现

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	0.00%	0.19%	-2.10%	0.85%	2.10%	-0.66%

注:本基金业绩比较基准=65%×中证800指数收益率+35%×中国债券综合全价(总值)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变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金业绩比较基准=65%×中证800指数收益率+35%×中国债券综合全价(总值)指数收益率

§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		
秦斌	基金经理	2016年7月7日	-	8年	秦斌同志,硕士,2009年07月至2015年6月就职于东吴证券股份有限公司。历任研究所金融工程分析师、投资总部数量化与衍生品交易研究员,2015年7月加入东吴基金管理有限公司,曾任研究策划部研究员,基金经理助理,现任基金经理,其中自2016年7月7日起担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金、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10月18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。
周健	基金经理	2016年6月3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2018年7月11日起担任东吴沪深300指数型证券投资基金(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。

注:1、周健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《证券从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,三驾马车都出现明显回落。地产、汽车及大众消费品的需求数据都出现走弱,但原油、猪疫等外生冲击造成通胀出现回升。固定资产投资继续下滑,中游钢铁、水泥受益基建拉动,略有改善。贸易环境恶化造成出口同比快速回落。货币信贷方面,央行继续维持中性偏松的政策,但是信用风险上升,不利于货币政策的传导。内部经济运行偏弱,而外围欧美经济已经步入过热,对新兴市场造成较大压力,A股估值和盈利皆不乐观。报告期内,本基金主要采用量化策略,严格控制仓位,在日常的基金操作中积极应对申购赎回,力争获得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.914元;本报告期基金份额净值增长率为0.00%,业绩比较基准收益率为-2.10%。

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18日至2018年9月30日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形,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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,936,234.90	92.91
	其中:债券	39,936,234.90	92.91
	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	279,760.84	0.65
8	其他资产	2,767,566.75	6.44
9	合计	42,983,562.49	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,241,881.10	5.76
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,852,909.50	7.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,936,234.90	102.62

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136192	16信威01	405,170	34,532,639.10	88.74
2	018002	国开1302	6,900	695,796.00	1.79
3	018005	国开1701	6,640	667,984.00	1.72
4	010303	03国债(3)	6,350	631,253.50	1.62
5	010107	21国债(7)	6,130	628,447.60	1.61

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 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,552.17
2	应收证券清算款	1,201,600.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,562,814.58
5	应收申购款	11,600.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,767,566.75

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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	176,082,398.54
报告期期间基金总申购份额	148,160.67
减:报告期期间基金总赎回份额	113,532,848.72
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	62,697,710.49

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	20180701-20180930	150,904,426.56	-	93,000,000.00	57,904,426.56	92.35%	
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安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东吴安鑫量化灵活配置混合型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、报告期内东吴安鑫量化灵活配置混合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

东吴鼎利债券型证券投资基金(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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	东吴鼎利(LOF)
场内简称	东吴鼎利
基金主代码	165807
交易代码	165807
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金转型生效日	2016年4月26日
报告期末基金份额总额	42,984,666.19份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动调整,力争提供稳健的投资收益。
投资策略	本基金为纯债基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动式管理,力争提供稳健的投资收益。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其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	交通银行股份有限公司

§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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	343,591.53
2.本期利润	-4,382,643.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1012
4.期末基金资产净值	38,915,183.64
5.期末基金份额净值	0.905

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。

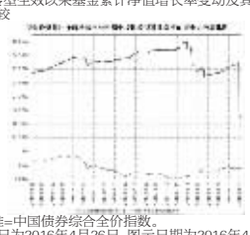
3.2 基金净值表现

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	-9.68%	1.55%	0.57%	0.07%	-10.25%	1.48%

注:比较基准=中国债券综合全价指数。

3.2.2 自基金转型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、比较基准=中国债券综合全价指数。

2、本基金转型日为2016年4月26日,图示日期为2016年4月26日至2018年09月30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		
杨庆定	固定收益总监兼固定收益总部总经理、基金经理	2013年6月25日	-	12年	杨庆定,博士,上海交通大学管理学专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理;2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理;2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司,现担任公司固定收益总监兼固定收益总部总经理、基金经理,其中,自2013年6月25日起