

东吴增利债券型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十七日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月24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预示其未来表现,投资者有较高风险,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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告日期为2017年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 东吴增利债券 (Dongwu Zhenli Bond). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易币种 (Currency), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

3.1 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
报告期:2017年7月1日至2017年9月30日

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Rows include 本期利润总额 (Current Period Profit), 本期净利润 (Current Period Net Profit), etc.

3.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较
东吴增利债券C



注:1.比较基准=中国债券综合全价指数。
2.本基金于2011年7月27日成立。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 王元月, 性别: 女, 国籍: 中国, 学历: 硕士, 从业年限: 10年。

注:1.最近的任职日期指对外公告之日。
2.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明。

4.3 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
6月上旬央行超预期降准,MLF、资金面迅速宽松,市场认为货币政策已由原来的偏紧转为不松不紧,10年期国债收益率自3.68%左右的高点下行至最低3.48%,7月初央行逐步回笼资金,体现了“精准滴灌”的操作思路。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,东吴增利债券A份额净值为1.060元,累计净值1.400;本报告期份额净值增长率为1.34%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%;东吴增利债券B份额净值为1.051元,累计净值1.361;本报告期份额净值增长率为1.15%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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出现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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号: 1, 项目: 权益投资, 金额(元): -, 占基金资产净值比例(%): -.

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
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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
5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

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
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

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
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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注
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。

5.12 开放式基金资产变动
单位:份

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 东吴增利债券A (Dongwu Zhenli Bond A). Rows include 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares), 期初基金份额总额 (Start Total Shares), etc.

注:1.如果本报告期间发生申购赎回业务,则申购赎回份额中包含该业务;
2.如果本报告期间发生转出业务,则转出份额中包含该业务。

5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
单位:份

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 东吴增利债券A (Dongwu Zhenli Bond A). Rows include 报告期末持有本基金基金份额 (Report End Fund Shares), 期初持有本基金基金份额 (Start Fund Shares), etc.

5.4 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
单位:份

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额(份) (Transaction Amount), 适用费率 (Applicable Rate).

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者名称 (Investor Name), 期初 (Start), 期末 (End), 期初占比 (Start Ratio), 期末占比 (End Ratio).

注:1.此表的统计日期为公司对外公告之日;
2.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明。

4.2 公平交易专项说明
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人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
6月上旬央行超预期降准,MLF、资金面迅速宽松,市场认为货币政策已由原来的偏紧转为不松不紧,10年期国债收益率自3.68%左右的高点下行至最低3.48%,7月初央行逐步回笼资金,体现了“精准滴灌”的操作思路。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,东吴增利债券A份额净值为1.060元,累计净值1.400;本报告期份额净值增长率为1.34%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%;东吴增利债券B份额净值为1.051元,累计净值1.361;本报告期份额净值增长率为1.15%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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出现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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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
5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
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
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
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
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
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11 投资组合报告附注

东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十七日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月24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预示其未来表现,投资者有较高风险,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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告日期为2017年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 东吴智慧医疗 (Dongwu Wisdom Medical). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易币种 (Currency), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2017年7月1日至2017年9月30日

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Rows include 本期利润总额 (Current Period Profit), 本期净利润 (Current Period Net Profit), etc.

3.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金业绩比较基准=65%×中证医药指数收益率+35%×中证综合全价(总值)指数收益率。
2.本基金于2016年8月11日成立,截至本报告期末已完成建仓,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 王元月, 性别: 女, 国籍: 中国, 学历: 硕士, 从业年限: 10年。

注:1.最近的任职日期指对外公告之日;
2.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明。

4.2 公平交易专项说明
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人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
六月以来,市场因央行降准,整体情绪有所回升,从“一九”逐步过渡到“二七”,有色、钢铁等周期板块走出了反转行情,煤炭、煤炭的强势反弹,9月下旬,周期类大幅下跌,市场风格再度切换,上行的周期板块先跌后涨,整体依然保持向上趋势,同时热点逐渐向中盘蓝筹扩散,二季度中期股性活跃,上证指数和创业板指双双收涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,本基金资产净值为0.900元,累计净值0.900元;本报告期份额净值增长率为-0.99%,同期业绩比较基准收益率为-1.60%。

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出现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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号: 1, 项目: 权益投资, 金额(元): 2,966,678.28, 占基金资产净值比例(%): 48.27.

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
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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
5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

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
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

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
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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注
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。

5.12 开放式基金资产变动
单位:份

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 东吴智慧医疗 (Dongwu Wisdom Medical). Rows include 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares), 期初基金份额总额 (Start Total Shares), etc.

注:1.如果本报告期间发生申购赎回业务,则申购赎回份额中包含该业务;
2.如果本报告期间发生转出业务,则转出份额中包含该业务。

5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
单位:份

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 东吴智慧医疗 (Dongwu Wisdom Medical). Rows include 报告期末持有本基金基金份额 (Report End Fund Shares), 期初持有本基金基金份额 (Start Fund Shares), etc.

5.4 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
单位:份

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额(份) (Transaction Amount), 适用费率 (Applicable Rate).

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者名称 (Investor Name), 期初 (Start), 期末 (End), 期初占比 (Start Ratio), 期末占比 (End Ratio).

注:1.此表的统计日期为公司对外公告之日;
2.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明。

4.2 公平交易专项说明
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人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
六月以来,市场因央行降准,整体情绪有所回升,从“一九”逐步过渡到“二七”,有色、钢铁等周期板块走出了反转行情,煤炭、煤炭的强势反弹,9月下旬,周期类大幅下跌,市场风格再度切换,上行的周期板块先跌后涨,整体依然保持向上趋势,同时热点逐渐向中盘蓝筹扩散,二季度中期股性活跃,上证指数和创业板指双双收涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,本基金资产净值为0.900元,累计净值0.900元;本报告期份额净值增长率为-0.99%,同期业绩比较基准收益率为-1.60%。

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出现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。

东吴增鑫宝货币市场基金

2017 第三季度 报告

2017年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十七日

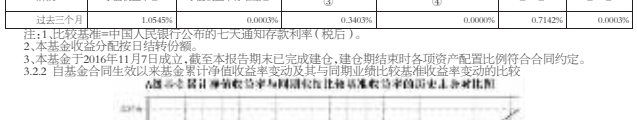
重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者有较高风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告日期为2017年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 东吴增鑫宝 (Dongwu Zhenxinbao). Rows include 基金代码 (Fund Code), 交易币种 (Currency), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2017年7月1日至2017年9月30日

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Rows include 本期利润总额 (Current Period Profit), 本期净利润 (Current Period Net Profit), etc.

3.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)。
2.本基金于2016年11月17日成立,截至本报告期末已完成建仓,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 王元月, 性别: 女, 国籍: 中国, 学历: 硕士, 从业年限: 10年。

注:1.最近的任职日期指对外公告之日;
2.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明。

4.2 公平交易专项说明
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人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
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 东吴增鑫宝 (Dongwu Zhenxinbao). Rows include 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares), 期初基金份额总额 (Start Total Shares), etc.

注:1.如果本报告期间发生申购赎回业务,则申购赎回份额中包含该业务;
2.如果本报告期间发生转出业务,则转出份额中包含该业务。

5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
单位:份

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 东吴增鑫宝 (Dongwu Zhenxinbao). Rows include 报告期末持有本基金基金份额 (Report End Fund Shares), 期初持有本基金基金份额 (Start Fund Shares), etc.

5.4 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
单位:份

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额(份) (Transaction Amount), 适用费率 (Applicable Rate).

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者名称 (Investor Name), 期初 (Start), 期末 (End), 期初占比 (Start Ratio), 期末占比 (End Ratio).

注:1.此表的统计日期为公司对外公告之日;
2.管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明。

4.2 公平交易专项说明
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人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
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,严格执行公平交易管理制度,加强对投资管理的不当投资行为分析,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环节和环节得到公平对待。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,本基金资产净值为0.900元,累计净值0.900元;本报告期份额净值增长率为-0.99%,同期业绩比较基准收益率为-1.60%。

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出现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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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
5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
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
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
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
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
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11 投资组合报告附注