东海祥龙定增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：东海基金管理有限责任公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月27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2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海祥龙定增混合
场内简称	东海祥龙
交易代码	168301
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月21日
报告期末基金份额总额	863,058,457.47份
投资目标	本基金将在严格控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	报告期内通过选择优质项目积极参与定向增发项目报价。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。
基金管理人	东海基金管理有限责任公司
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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	-1,824,284.84
2.本期利润	12,245,931.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0142
4.期末基金资产净值	873,621,987.57
5.期末基金份额净值	1.0122

注：（1）所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。

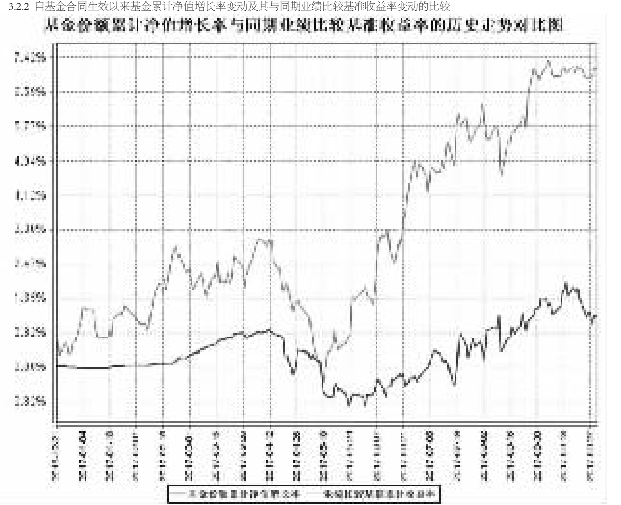
（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.41%	0.23%	2.24%	0.29%	-0.83%	-0.06%

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）本基金基金合同生效日为2016年12月21日，截止本报告期期末未满一年；

（2）本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债）、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相关规定）。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%，非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

（3）本基金的建仓期为本基金合同生效日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3.3 其他指标

-

§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		
胡德军	本基金的基金经理	2016年12月21日	-	8年	国籍：中国。上海交通大学生物医学工程博士，曾任齐鲁证券有限公司研究所医药行业研究员，2013年6月加入东海基金，历任公司研究开发部高级研究员、专户理财部投资经理等职。现任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金的基金经理。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策与执行、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。公司利用公平交易分析系统，对组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为0次。

本报告期内，各组合投资交易未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济景气相比前两个季度有所回落，各类主要宏观经济指标都明显趋缓，受房地产销售延续性走弱影响，8月社会消费品总额增速小幅下滑0.3个百分点，不及市场预期，创6个月以来新低。房地产宏观调控政策的作用下，房地产销售逐步冷却，最终通过产业链传导对房地产投资增速带来下行压力。根据房地产周期判断，地产投资与地产消费之间的时滞大概在2年左右，这也预示随着地产调控趋严、房贷利息上行以及信用贷等短期贷款转入楼市的渠道斩断，未来房地产行业无论是投资端，还是消费端对经济的拉动作用都将进一步减弱。但9月主要发达经济体PMI景气度高位上行，外需改善趋势延续，因此短期国内经济韧性仍然较强。三季度东海祥龙持有的定增项目有银星能源、同力水泥、皖维高新和长荣股份，具体信息可参见东海基金官方公司网站。三季度东海祥龙定增基金剩余资金主要以现金管理和二级投资为主。

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1.0122元；本报告期基金份额净值增长率为1.41%，业绩比较基准收益率为2.24%。

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，本基金未有连续二十个交易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的情况。

§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	290,163,167.75	33.16
	其中：股票	290,163,167.75	33.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	399,492,000.00	45.65
	其中：债券	399,492,000.00	45.65
	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	30,000,000.00	3.43
	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	148,649,738.45	16.99
8	其他资产	6,801,576.43	0.78
9	合计	875,106,482.63	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	-	-
C	制造业	209,289,348.56	23.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,802,648.25	8.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,219,383.60	0.48
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	-	-
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	2,851,787.34	0.33
S	综合	-	-
	合计	290,163,167.75	33.21

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	300195	长荣股份	5,351,386	78,611,860.34	9.00
2	000862	银星能源	9,647,405	73,802,648.25	8.45
3	000885	同力水泥	4,000,000	68,440,000.00	7.83
4	600063	皖维高新	12,903,226	57,677,420.22	6.60
5	600297	广汇汽车	500,520	4,219,383.60	0.48
6	601689	拓普集团	106,400	3,055,808.00	0.35
7	300364	中文在线	217,031	2,851,787.34	0.33
8	000568	泸州老窖	26,700	1,497,870.00	0.17
9	002903	宇环数控	500	6,390.00	0.00

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	89,988,000.00	10.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	309,504,000.00	35.43
	其中：政策性金融债	-	-
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	399,492,000.00	45.73

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	150207	15国开07	800,000	80,176,000.00	9.18
2	110223	11国开23	800,000	79,336,000.00	9.08
3	150309	15进出09	600,000	60,042,000.00	6.87
4	170408	17农发08	600,000	59,892,000.00	6.86
5	150409	15农发09	500,000	50,020,000.00	5.73

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	846.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,775,666.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,063.20
8	其他	-
9	合计	6,801,576.43

5.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.3 报告期末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	300195	长荣股份	78,611,860.34	9.00	非公开发行
2	000862	银星能源	73,802,648.25	8.45	非公开发行
3	000885	同力水泥	68,440,000.00	7.83	非公开发行
4	600063	皖维高新	57,677,420.22	6.60	非公开发行
5	002903	宇环数控	6,390.00	0.00	新股锁定

5.11.4 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，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	863,058,457.47
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
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	863,058,457.47

§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

注：本报告期，本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

注：本报告期，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

注：本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

东海基金管理有限责任公司
2017年10月27日

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

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：平安银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年十月二十七日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴转债		
场内简称	东吴转债		
基金主代码	165809		
交易代码	165809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年5月9日		
报告期末基金份额总额	59,658,101.76份		
投资目标	本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制法的投资策略，按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金为债券指数基金，对指数投资部分，采用最优复制法的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。		
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%		
风险收益特征	本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。		
基金管理人	东吴基金管理有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	可转债A	可转债B	东吴转债
下属分级基金的场内简称	可转债A	可转债B	东吴转债
下属分级基金的交易代码	150164	150165	165809
报告期末下属分级基金的份额总额	32,775,868.00份	14,046,800.00份	12,835,433.76份
下属分级基金的风险收益特征	可转债A份额为约定收益，将表现出预期低风险、预期收益相对稳定的明显特征。	可转债B份额获得产品剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险高、预期收益高的显著特征。	东吴转债是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。

§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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	-565,777.68
2.本期利润	1,840,181.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0284
4.期末基金资产净值	55,070,837.26
5.期末基金份额净值	0.923

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。

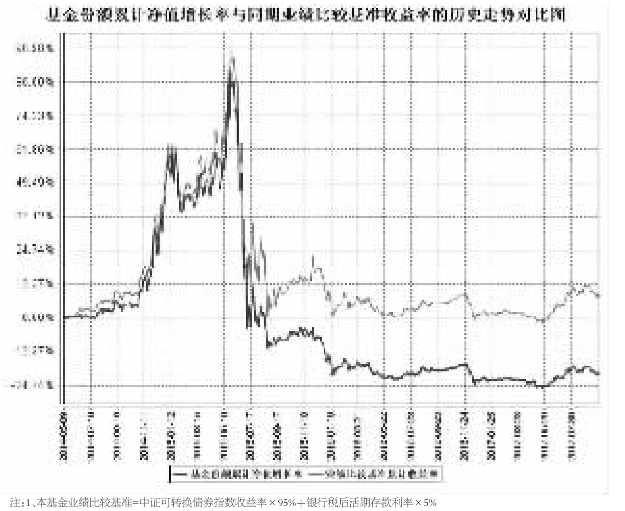
3.2 基金净值表现

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	2.44%	0.50%	4.05%	0.53%	-1.61%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×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、本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

2、本基金于2014年5月9日成立。按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
可转债A与可转债B基金份额配比	7:3
期末可转债A份额参考净值	1.037
期末可转债A份额累计参考净值	1.174
期末可转债B份额参考净值	0.657
期末可转债B份额累计参考净值	0.250
报告期末可转债A的预计年收益率	0.0450

注：可转债A约定年收益率＝一年期银行定期存款年利率（税后）+3.0%。

§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、固定收益部总经理、本基金基金经理	2014年5月9日	-	11年	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、固定收益部总经理，其中自2015年6月8日起担任东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)(原东吴鼎利分级债券型证券投资基金)基金经理、自2014年5月9日起担任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金经理、自2014年6月28日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自2015年8月19日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理、自2016年5月19日起担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理。

注：1、杨庆定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

从三季度已公布的经济数据来看，7、8两月生产和需求均较上半年大幅走弱，一部分是受到夏季高温和洪涝灾害的影响，另一部分是由于地产和基建融资受限带动的投资下滑，但9月中国制造业PMI和进出口数据仍然强劲，显示经济短期具有较强韧性。通胀方面，虽然CPI同比增速持续低于2%，但3季度较上半年有所反弹，且9月PPI同比增速反弹至6.9%的高位。金融数据方面，季度内信贷、社融数据逐月走强，显示实体经济对资金需求仍旧旺盛，且9月金融数据显示非标融资普遍回暖，居民举债仍偏快。

三季度央行货币政策继续维持稳健中性，在超储率持续处于低位的情况下，央行公开市场继续以逆回购和MLF等货币政策工具进行基础货币投放。三季度以来，央行实行"削峰填谷"的投放方式，货币政策不松不紧。9月30日，央行宣布对普惠金融领域实施定向降准，同时也意味着年内货币政策将继续维持稳健中性，宽松空间有限。

债券市场来看，三季度长久期利率债收益率呈现高位窄幅波动，10年期国债收益率围绕3.6%震荡，而短久期利率债收益率呈现先下行后上行的走势，国债收益率曲线逐步平坦化。信用债方面，资金紧张明显制约了债券市场需求，债市收益率中枢抬升后发债主体融资需求也有明显转弱，信用债呈现供需均弱格局。

本基金在报告期内保持对指数的较好跟踪。

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0.923元，累计净值0.897元；本报告期份额净值增长率2.44%，同期业绩比较基准收益率为4.05%。

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 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,584,635.60	93.07
	其中：债券	51,584,635.60	93.07
	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	3,000,000.00	5.41
	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	688,333.70	1.24
8	其他资产	150,300.27	0.27
9	合计	55,423,269.57	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	2,964,836.00	5.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	201,509.90	0.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	48,418,289.70	87.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,584,635.60	93.67

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	113011	光大转债	195,720	21,807,122.40	39.60
2	113013	国君转债	44,710	5,599,480.40	10.17
3	113008	电气转债	38,660	4,116,130.20	7.47
4	110032	三一转债	30,260	3,572,495.60	6.49
5	113009	广汽转债	21,510	2,725,532.10	4.95

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末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	18,307.36
2	应收证券清算款	6,493.15
3	应收股利	-
4	应收利息	125,499.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,300.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	21,807,122.40	39.60
2	113008	电气转债	4,116,130.20	7.47
3	110032	三一转债	3,572,495.60	6.49
4	113009	广汽转债	2,725,532.10	4.95
5	110033	国贸转债	1,917,281.50	3.48
6	110031	航信转债	1,532,487.80	2.78
7	110034	九州转债	1,095,614.40	1.99
8	127003	海印转债	860,669.28	1.56
9	123001	蓝标转债	810,372.20	1.47
10	128013	洪涛转债	758,925.00	1.38
11	128012	辉丰转债	740,517.10	1.34
12	110030	格力转债	516,617.60	0.94
13	128010	顺昌转债	477,366.12	0.87
14	127004	模塑转债	382,445.00	0.69
15	113012	骆驼转债	381,911.40	0.69
16	113010	江南转债	380,448.00	0.69
17	128016	雨虹转债	1,000.00	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

项目	可转债A	可转债B	东吴转债
报告期期初基金份额总额	43,777,985.00	18,761,993.00	13,220,178.83
报告期期间基金总申购份额	-	-	463,046.61
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	16,565,101.68
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-11,002,117.00	-4,715,193.00	15,717,310.00
报告期期末基金份额总额	32,775,868.00	14,046,800.00	12,835,433.76

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。

3、报告期间拆分变动包括日常拆分合并和折算产生的份额变动。

§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

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 。

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中证可转换债券指数分级证券投资基金设立的文件；

2、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》；

3、《东吴中证可转换债券指数分级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、报告期内东吴中证可转换债券指数分级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

基金管理人处、基金托管人处。

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
2017年10月27日

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年十月二十七日

§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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴中证新兴指数
场内简称	-
基金主代码	585001
交易代码	585001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年2月1日
报告期末基金份额总额	99,901,829.55份
投资目标	本基金采用指数化投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金通过采用指数化投资策略，选择中证新兴产业指数作为跟踪基准，按照指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，为投资者获取新兴产业高速成长所带来的投资收益。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率 +5%*银行同业存款利率
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货币市场基金、债券型基金以及混合型基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪中证新兴产业指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。
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（2017年7月1日 - 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	-409,591.21
2.本期利润	7,002,774.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0699
4.期末基金资产净值	126,367,632.65
5.期末基金份额净值	1.265

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。

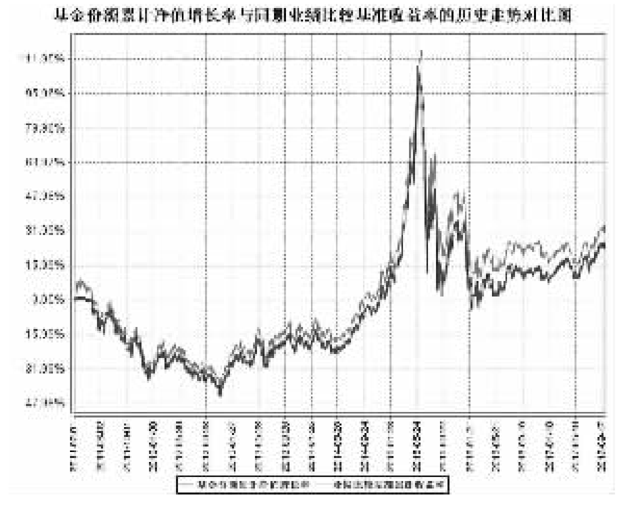
3.2 基金净值表现

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	6.04%	0.78%	6.41%	0.81%	-0.37%	-0.03%

注：比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率

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：业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率。

§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		
周健	本基金基金经理	2012年5月3日	-	10年	硕士，南开大学毕业。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05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日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理、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日担任东吴安盈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	本基金基金经理	2017年3月9日	-	6.5年	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月参与我司筹建以来，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，自2017年3月9日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期指公司对外公告之日。

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

7、8月由于环保限产、地产调控等因素对经济数据短期造成波动，但是9月进出口增速均有所加快，新增贷款等数据超市场预期，显示国内外经济复苏仍在延续，经济保持平稳增长。人民币对美元汇率大幅升值，从季度初6.78升至6.43，后反弹至6.65，表现出较强的灵活性。PPI维持在5%以上高位，CPI维持在2%以上，企业盈利的改善，以及十九大之前稳定的市场预期，提振了市场信心，市场活跃度提升，板块轮动加快。创业板在中报暴跌后，部分调整充分的成长股相比上半年涨幅较大的消费股有较好的性价比。

报告期内，本基金主要采用复制指数配置与行业内量化选股的策略，密切跟踪指数，严格控制仓位，在日常的基金操作中积极应对申购赎回。在确定性个股配置上积极调整，进行适度增强；加强新股申购，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1.265元，累计净值1.265元；本报告期份额净值增长率6.04%，同期业绩比较基准收益率为6.41%。

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 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	119,880,465.36	94.40
	其中：股票	119,880,465.36	94.40
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	7,024,831.69	5.53
8	其他资产	83,172.31	0.07
9	合计	126,988,469.36	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	2,720,480.43	2.15
B	采矿业	2,218,734.76	1.76
C	制造业	87,564,690.28	69.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,031,080.00	0.82
F	批发和零售业	-	-
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	20,963,644.39	16.59
J	金融业	-	-
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	2,218,720.93	1.76
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	998,945.61	0.79
S	综合	-	-
	合计	117,716,296.40	93.15

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	2,164,168.96	1.71
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	-	-
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	-	-
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	2,164,168.96	1.71

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	002460	赣锋锂业	25,905	2,261,506.50	1.79
2	600309	万华化学	46,081	1,942,314.15	1.54
3	601012	隆基股份	65,400	1,927,338.00	1.53
4	002230	科大讯飞	34,603	1,856,450.95	1.47
5	002466	天齐锂业	24,203	1,701,228.87	1.35
6	600498	烽火通信	50,338	1,641,018.80	1.30
7	600487	亨通光电	47,700	1,640,880.00	1.30
8	002405	四维图新	62,409	1,598,918.58	1.27
9	000063	中兴通讯	55,931	1,582,847.30	1.25
10	600111	北方稀土	94,971	1,531,882.23	1.21

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	600666	奥瑞德	62,720	1,237,465.60	0.98
2	002129	中环股份	112,464	926,703.36	0.73

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末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	8,644.08
2	应收证券清算款	64,125.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,241.35
5	应收申购款	9,161.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,172.31

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

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	600666	奥瑞德	1,237,465.60	0.98	重大资产重组
2	002129	中环股份	926,703.36	0.73	重大资产重组

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	101,792,215.04
报告期期间基金总申购份额	5,422,748.58
减：报告期期间基金总赎回份额	7,313,134.07
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	99,901,829.55

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。

§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

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 。

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中证新兴产业指数证券投资基金设立的文件；

2.《东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金合同》；

3.《东吴中证新兴产业指数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.报告期内东吴中证新兴产业指数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

基金管理人处、基金托管人处。

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
2017年10月27日