东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31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:二〇一八年一月十九日

§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2018年1月16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10月1日起至12月31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	36,406,983.21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、市场波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	12,406,496.00份	5,317,069.00份	18,683,418.21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,将表现出固定风险、预期收益相对稳定的固定特征。	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10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-534,211.50
2.本期利润	-3,309,390.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0641
4.期末基金资产净值	36,271,340.27
5.期末基金份额净值	0.996

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	-6.68%	0.44%	-6.32%	0.48%	-0.36%	-0.04%

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10月1日-2017年12月31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	1.003
期末可转债A份额累计参考净值	1.186
期末可转债B份额参考净值	0.980
期末可转债B份额累计参考净值	0.014
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,太平洋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日起担任东吴优益稳健债券型证券投资基金基金经理,自2015年8月19日任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(原东吴配置优化混合型证券投资基金)的2016年5月19日起担任东吴顺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

今年前3季度GDP增速分别录得6.9%、6.9%、6.8%,下半年工业生产增速虽有小幅回落但仍高于6%,CPI增速在1%-2%区间波动,整体来看,经济增速整体仍较平稳,通胀水平维持温和。

在基本面平稳的背景下,4季度债券市场却仍然延续2016年末以来的调整趋势,监管成为今年债券市场的核心影响因素。2016年下半年以来金融去杠杆政策逐步推进,2017年监管则是贯穿全年;各部委相继出台相关监管政策,金融工作会议及十九大中均强调金融监管的协调,金稳会也在11月成立。从货币政策来看,2016年底中央经济工作会议确定货币政策中性稳健基调,2017年货币政策整体维持偏紧。

转债发行对定向增发有较强的替代效应,4季度转债一级市场发行速度与发行规模继续上升,共有33只总计超过500亿元转债发行。在申购方式改为信用申购后,投资者对转债市场的关注度与参与度有所提升,同时由于部分品种上市首日破发,转债一级市场出出现较多弃购现象。二级市场方面,受债市下跌及股市调整影响,转债市场4季度表现不佳,中证转债指数下跌6.65%,同时估值水平不断压缩,历史对比来看,转债市场整体估值水平已处于偏低区域。

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0.996元,累计净值0.835元;本报告期份额净值增长率-6.68%,同期业绩比较基准收益率为-6.32%。

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2017年11月14日至2017年12月31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

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	33,537,709.74	92.04
	其中:债券	33,537,709.74	92.04
	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	2,739,037.88	7.52
8	其他资产	160,420.69	0.44
9	合计	36,437,168.31	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	2,963,668.00	8.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	199,961.70	0.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	30,374,080.04	83.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,537,709.74	92.46

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	102,720	10,720,886.40	29.56
2	113008	电气转债	26,850	2,652,243.00	7.31
3	113013	国君转债	23,150	2,428,203.50	6.69
4	019563	17国债09	17,680	1,765,348.00	4.87
5	110032	三一转债	14,140	1,715,464.80	4.73

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

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	13,965.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	146,455.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,420.69

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	10,720,886.40	29.56
2	113008	电气转债	2,652,243.00	7.31
3	110032	三一转债	1,715,464.80	4.73
4	113009	广汽转债	1,692,011.10	4.66
5	110031	航信转债	1,439,186.20	3.97
6	123001	蓝标转债	731,034.90	2.02
7	110033	国贸转债	701,267.10	1.93
8	128013	洪涛转债	692,625.00	1.91
9	128016	雨虹转债	685,620.80	1.89
10	128012	辉丰转债	681,001.60	1.88
11	110034	九州转债	533,432.80	1.47
12	110030	格力转债	488,406.40	1.35
13	128010	顺昌转债	474,124.52	1.31
14	128015	久其转债	446,331.60	1.23
15	127003	海印转债	416,043.32	1.15
16	113010	江南转债	373,752.00	1.03
17	113012	骆驼转债	325,994.40	0.90
18	127004	模塑转债	325,605.00	0.90
19	128014	永东转债	186,858.00	0.52

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	32,775,868.00	14,046,800.00	12,835,433.76
报告期期间基金总申购份额	-	-	346,379.92
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	16,263,162.61
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-20,369,372.00	-8,729,731.00	21,764,767.14
报告期末基金份额总额	12,406,496.00	5,317,069.00	18,683,418.21

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
2018年1月19日

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31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:二〇一八年一月十九日

§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2018年1月16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10月1日起至12月31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	95,096,726.63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10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	5,129,627.72
2.本期利润	-930,268.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0096
4.期末基金资产净值	119,141,078.22
5.期末基金份额净值	1.253

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。

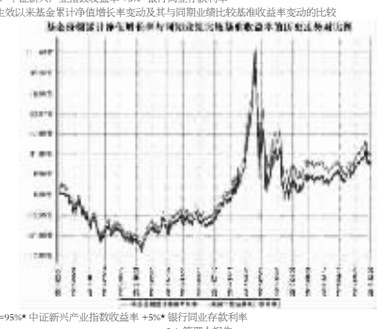
3.2 基金净值表现

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	-0.95%	1.03%	-1.37%	1.02%	0.42%	0.01%

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日起担任东吴安盈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,自2016年9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、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴安盈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。
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月参与投资筹建以来,一直跟踪于我司,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

四季度监管趋严,受金融去杠杆及海外市场加息收紧流动性等因素影响,利率在此期间快速上行,债券市场先行调整,11月底后资产抛售蔓延至股市。

10月以来,蓝筹权重指数迭创新高,截至11月22日上证50指数最高上涨12.72%,深圳100指数最高涨11.8%,沪深300指数最高上涨超10%,而此期间中证500指数下跌2.48%,中证1000指数下跌6.95%,此期间申万一级行业中,按个股等权平均涨幅来计算,仅电子(3.79%)、医药生物(2.28%)及银行(0.65%)三个行业有正收益,若按流通市值加权,涨幅最好的是行业家电(14.92%),食品饮料(13.78%),而医药(6.05%)排名第六,整体市场赚钱效应往大盘蓝筹集中,往业绩确定性一致预期好的股票集中,四季度中证500指数下跌5.54%,wind全A下跌2.14%,本基金净值回升2.2%。

在市场情绪低落期,资金更加拥挤进入业绩一致预期非常确定的少数蓝筹中,造成盈利效应分化极其尖锐的一个阶段。本基金采用量化选股进行配置,辅之以量化择时和资金管理,三季度后,本基金选股加大了对个股基本面业绩确定性及市场一致预期的权重,业绩相对强弱企稳,逐步走出困局。

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0.922元,累计净值0.922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-0.62%。

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	113,090,429.58	94.55
	其中:股票	113,090,429.58	94.55
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	6,196,364.14	5.18
8	其他资产	318,892.94	0.27
9	合计	119,605,686.66	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	1,191,196.08	1.00
B	采矿业	3,064,325.93	2.57
C	制造业	76,568,107.83	64.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	882,000.00	0.74
E	建筑业	3,471,997.00	2.91
F	批发和零售业	2,420,594.00	2.03
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	15,822,685.75	13.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,281,280.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,142,318.48	1.80
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	789,187.80	0.66
S	综合	-	-
	合计	107,633,692.87	90.34

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	5,195,062.16	4.36
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	261,674.55	0.22
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	5,456,736.71	4.58

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	600309	万华化学	44,381	1,683,815.14	1.41
2	600176	中国巨石	84,160	1,370,966.40	1.15
3	600196	复星医药	30,327	1,349,551.50	1.13
4	000333	美的集团	24,000	1,330,320.00	1.12
5	002027	分众传媒	91,000	1,281,280.00	1.08
6	002202	金风科技	67,652	1,275,240.20	1.07
7	000725	京东方A	219,000	1,268,010.00	1.06
8	000938	紫光股份	17,602	1,267,872.06	1.06
9	300017	网宿科技	117,546	1,250,689.44	1.05
10	600660	福耀玻璃	43,000	1,247,000.00	1.05

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	002366	台海核电	52,000	1,375,400.00	1.15
2	600666	奥瑞德	62,720	1,208,614.40	1.01
3	600150	中国船舶	46,251	1,141,012.17	0.96
4	300156	神雾环保	33,400	806,944.00	0.68
5	300159	新研股份	54,700	568,880.00	0.48

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	12,802.20
2	应收证券清算款	235,012.71
3	应收股利	-
4	应收利息	1,266.05
5	应收申购款	69,811.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,892.94

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

5.11.6 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	600309	万华化学	1,683,815.14	1.41	重大资产重组

5.11.7 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	002366	台海核电	1,375,400.00	1.15	重大资产重组
2	600150	中国船舶	1,141,012.17	0.96	重大资产重组
3	300156	神雾环保	806,944.00	0.68	重大资产重组
4	300159	新研股份	568,880.00	0.48	重大资产重组
5	600666	奥瑞德	1,208,614.40	1.01	重大资产重组

5.11.8 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	99,901,829.55
报告期期间基金总申购份额	7,954,792.66
减:报告期期间基金总赎回份额	12,759,895.58
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	95,096,726.63

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