

东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金

2017 年第 3 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	东吴安享量化
场内简称	-
基金主代码	580007
交易代码	580007
基金运作方式	契约型开放式
基金转型生效日	2017 年 2 月 22 日
报告期末基金份额总额	202,850,088.93 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，以期给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
-------	--------------

注：上表中“报告期末”为 2017 年 2 月 21 日。转换基准日为 2017 年 2 月 22 日，转换日日终，东吴新创业转换成东吴安享量化。

§ 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	5,199,683.58
2. 本期利润	9,960,775.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0490
4. 期末基金资产净值	240,167,223.20
5. 期末基金份额净值	1.184

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

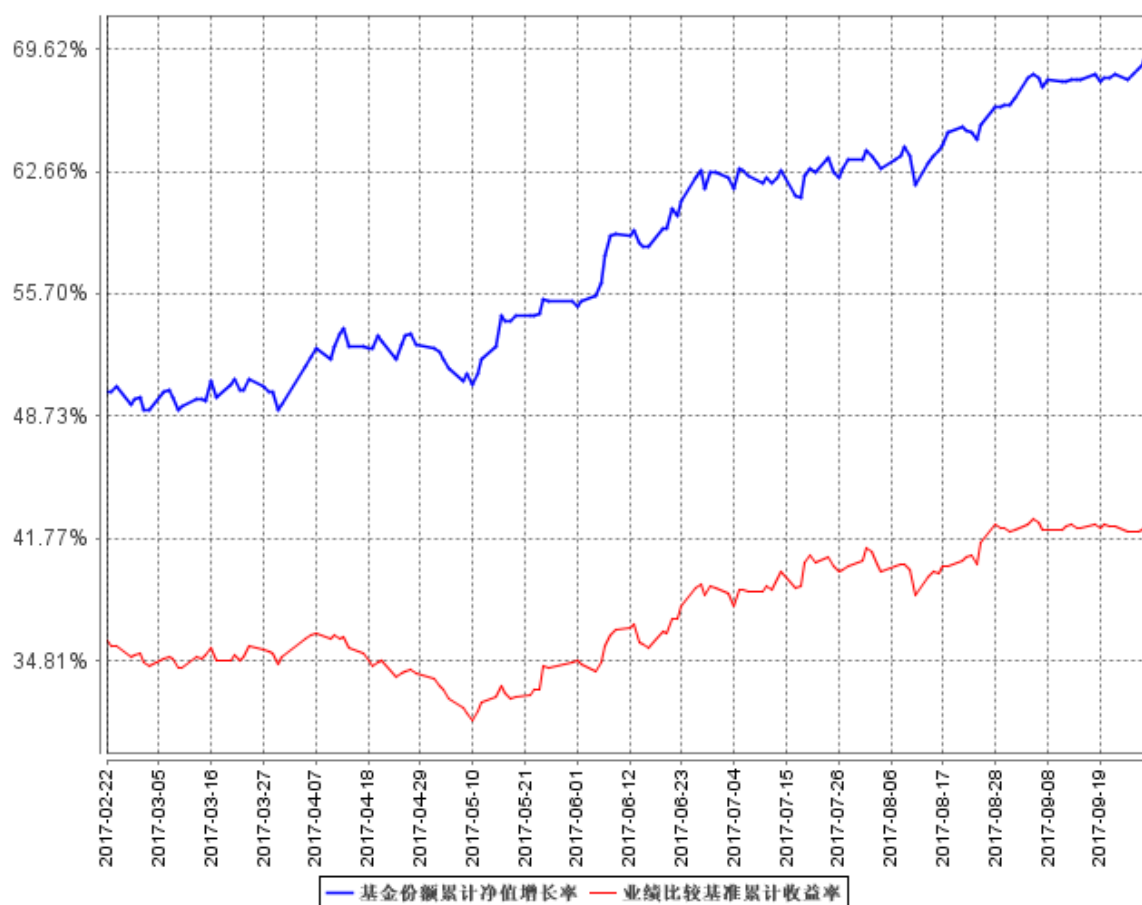
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	-	-
过去三个月	4.32%	0.34%	2.48%	0.32%	1.84%	0.02%

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 自基金转型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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 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%

2、本基金转型日为 2017 年 2 月 22 日；自本基金转型起至报告期末不满一年。

3、本报告期内，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

§ 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		
徐嵩	本基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	7 年	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 日起担任东吴内需增长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（原东吴新创业混合型证券投资基金基金经理）。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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上涨走势。最终上证综指上涨 4.9%，创业板指上涨 2.69%。期间，周期股中报业绩良好推升上证综指上涨，创业板指在 7 月中旬触底后随着市场风险偏好回暖而出现反弹。

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，基本符合市场风格，但由于仓位不高，导致超额收益不太明显。

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 1.1840 元，累计净值 1.6040 元；本报告期份额净值增长率 4.32%，同期业绩比较基准收益率为 2.48%

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	138,612,313.20	57.60
	其中：股票	138,612,313.20	57.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	53,309,970.00	22.15
	其中：债券	53,309,970.00	22.15
	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	40,000,000.00	16.62
	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	6,743,238.62	2.80
8	其他资产	1,999,391.91	0.83
9	合计	240,664,913.73	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	3,979,223.60	1.66
C	制造业	76,656,383.86	31.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,379,647.44	1.41

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,778,258.67	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	16,919,747.91	7.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
J	金融业	20,710,596.00	8.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,320,620.00	2.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,889,900.00	1.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,845,167.70	1.18
S	综合	-	-
	合计	138,612,313.20	57.71

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	000895	双汇发展	263,800	6,568,620.00	2.74
2	000063	中兴通讯	204,800	5,795,840.00	2.41
3	601318	中国平安	106,600	5,773,456.00	2.40
4	002003	伟星股份	517,954	5,604,262.28	2.33
5	000338	潍柴动力	632,600	4,738,174.00	1.97
6	000661	长春高新	31,662	4,703,390.10	1.96
7	600887	伊利股份	168,700	4,639,250.00	1.93
8	000429	粤高速 A	514,600	4,410,122.00	1.84
9	002008	大族激光	93,700	4,085,320.00	1.70
10	600036	招商银行	158,800	4,057,340.00	1.69

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	11,976,000.00	4.99
	其中：政策性金融债	11,976,000.00	4.99
4	企业债券	31,280,970.00	13.02
5	企业短期融资券	10,053,000.00	4.19
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,309,970.00	22.20

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	108601	国开 1703	120,000	11,976,000.00	4.99
2	011759003	17 人福 SCP001	100,000	10,053,000.00	4.19
3	112129	12 华锦债	100,000	10,002,000.00	4.16
4	112119	12 恒邦债	100,000	9,995,000.00	4.16
5	122212	12 京江河	73,000	7,291,970.00	3.04

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	19,735.41
2	应收证券清算款	358,617.23
3	应收股利	-
4	应收利息	1,618,473.04
5	应收申购款	2,566.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,999,391.91

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	203,412,862.34
报告期期间基金总申购份额	190,439.43
减：报告期期间基金总赎回份额	753,212.84
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	202,850,088.93

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	2017/07/01-2017/09/30	190,048,659.27	-	-	190,048,659.27	93.69%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
如开放期内上述持有人集中大额赎回,极端情况下本基金可能存在一定的流动性风险以及净值波动等情况。							

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新创业混合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、报告期内东吴新创业混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿；
- 6、中国证监会批准东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 7、《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金》；
- 8、《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 9、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