

东吴双三角股票型证券投资基金

2018 年年度报告 摘要

2018 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十九日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴双三角股票	
基金主代码	005209	
交易代码	005209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 5 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	300,787,091.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	东吴双三角股票 A	东吴双三角股票 C
下属分级基金的交易代码：	005209	005210
报告期末下属分级基金的份额总额	262,431,677.59 份	38,355,414.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于注册地、办公地点所在地或主营业务所在地在长江三角洲地区、珠江三角洲地区或直接受益于上述两地区经济发展的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。本基金对于注册地、办公地点所在地或主营业务所在地在长江三角洲地区、珠江三角洲地区（即“双三角”）或直接受益于上述两地区经济发展的个股选择将采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	田青
	联系电话	021-50509888-8206	010-67595096
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096

传真	021-50509888-8211	010-66275853
----	-------------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年		2017 年 12 月 5 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	东吴双三角股票 A	东吴双三角股票 C	东吴双三角股票 A	东吴双三角股票 C
本期已实现收益	-69,512,170.24	-9,474,495.03	1,567,118.80	305,867.44
本期利润	-81,653,953.85	-9,979,854.16	1,567,253.30	305,893.55
加权平均基金份额本期利润	-0.2574	-0.2350	0.0037	0.0034
本期加权平均净值利润率	-29.80%	-27.44%	0.37%	0.34%
本期基金份额净值增长率	-24.80%	-25.32%	0.37%	0.34%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	-64,346,466.49	-9,615,442.13	1,567,118.80	305,867.44
期末可供分配基金份额利润	-0.2452	-0.2507	0.0037	0.0034
期末基金资产净值	198,085,211.10	28,739,972.16	422,187,613.07	91,111,329.21
期末基金份额净值	0.7548	0.7493	1.0037	1.0034
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	-24.52%	-25.07%	0.37%	0.34%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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，例如基金的认购、申购、赎回费等，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 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

东吴双三角股票 A

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	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	-2.54%	1.79%	-8.47%	1.31%	5.93%	0.48%
过去六个月	-9.27%	1.64%	-13.78%	1.16%	4.51%	0.48%
过去一年	-24.80%	1.58%	-21.23%	1.05%	-3.57%	0.53%
自基金合同生效起至今	-24.52%	1.52%	-21.25%	1.02%	-3.27%	0.50%

东吴双三角股票 C

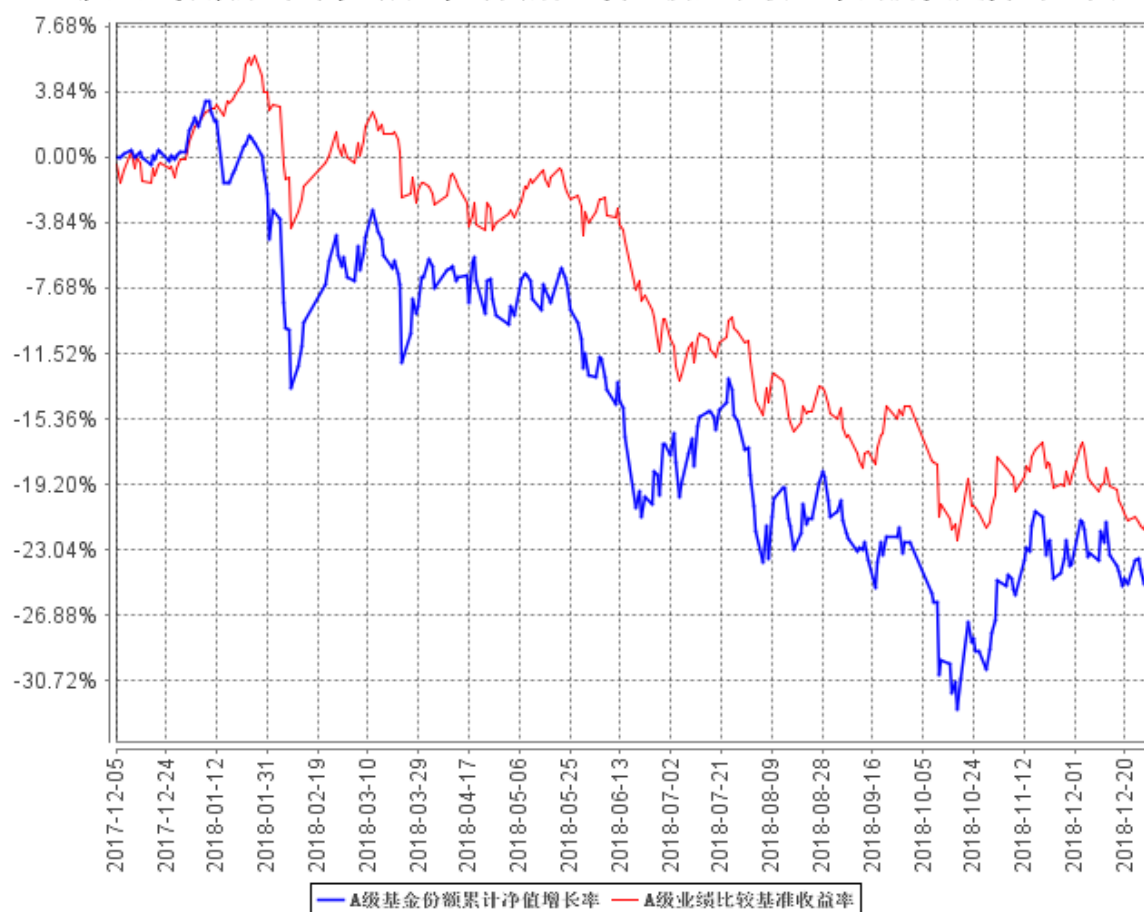
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-2.66%	1.79%	-8.47%	1.31%	5.81%	0.48%
过去六个月	-9.49%	1.64%	-13.78%	1.16%	4.29%	0.48%
过去一年	-25.32%	1.58%	-21.23%	1.05%	-4.09%	0.53%
自基金合同生效起至今	-25.07%	1.52%	-21.25%	1.02%	-3.82%	0.50%

注：1. 本基金成立于 2017 年 12 月 5 日，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同规定；

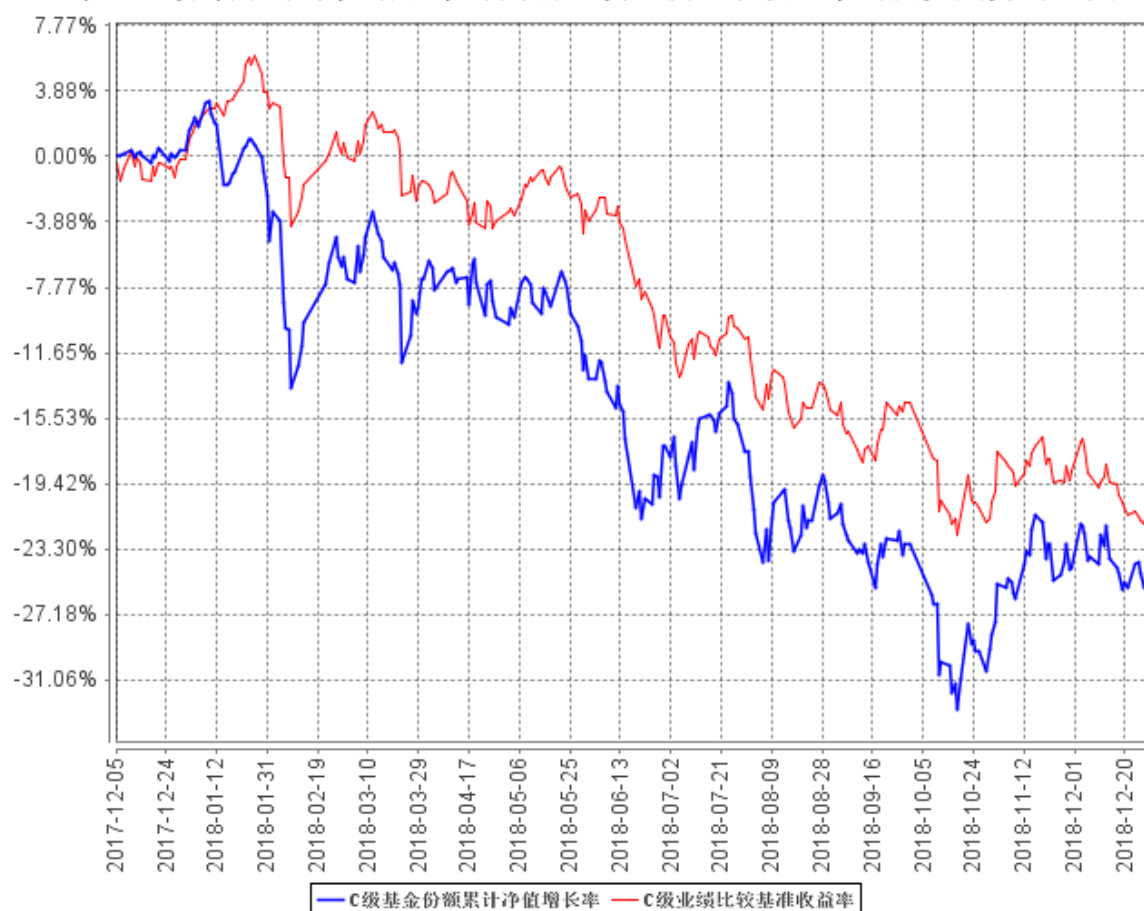
2. 基金业绩比较基准=中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级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



C级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

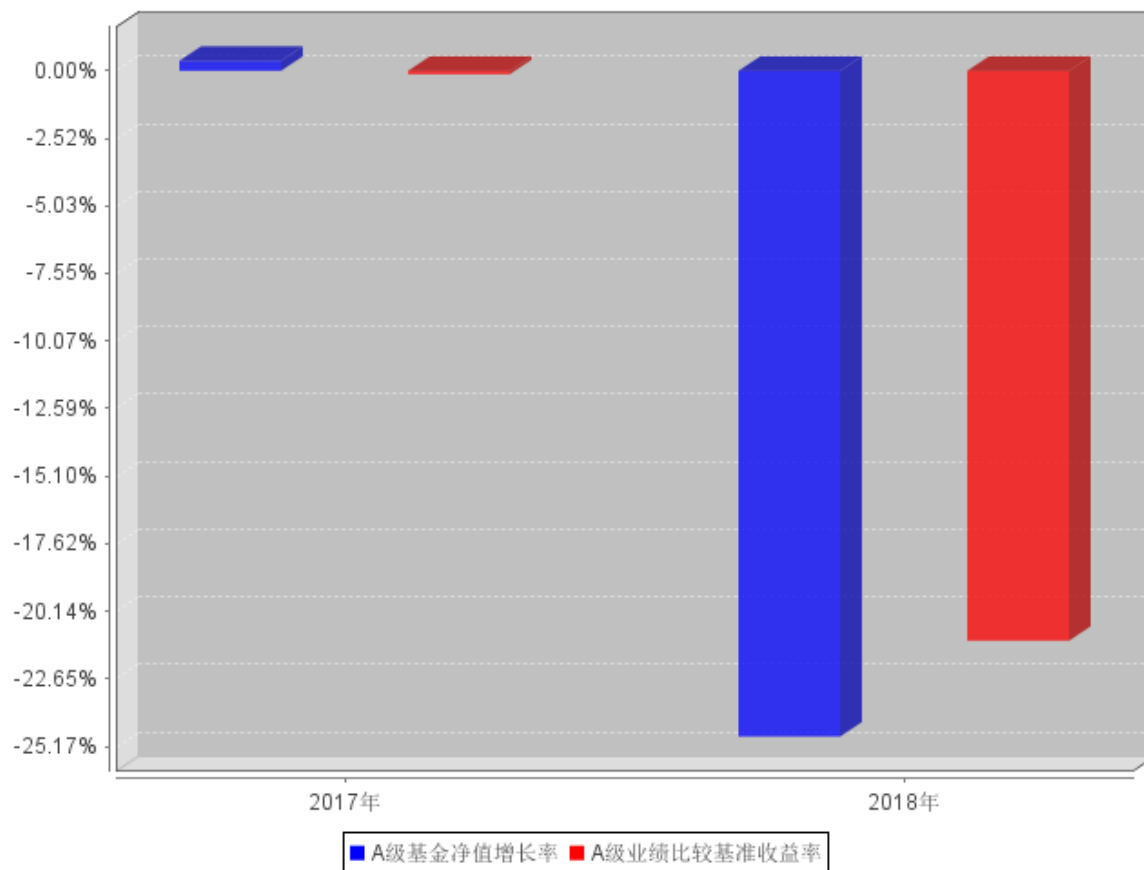


注：1. 本基金成立于 2017 年 12 月 5 日，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同规定；

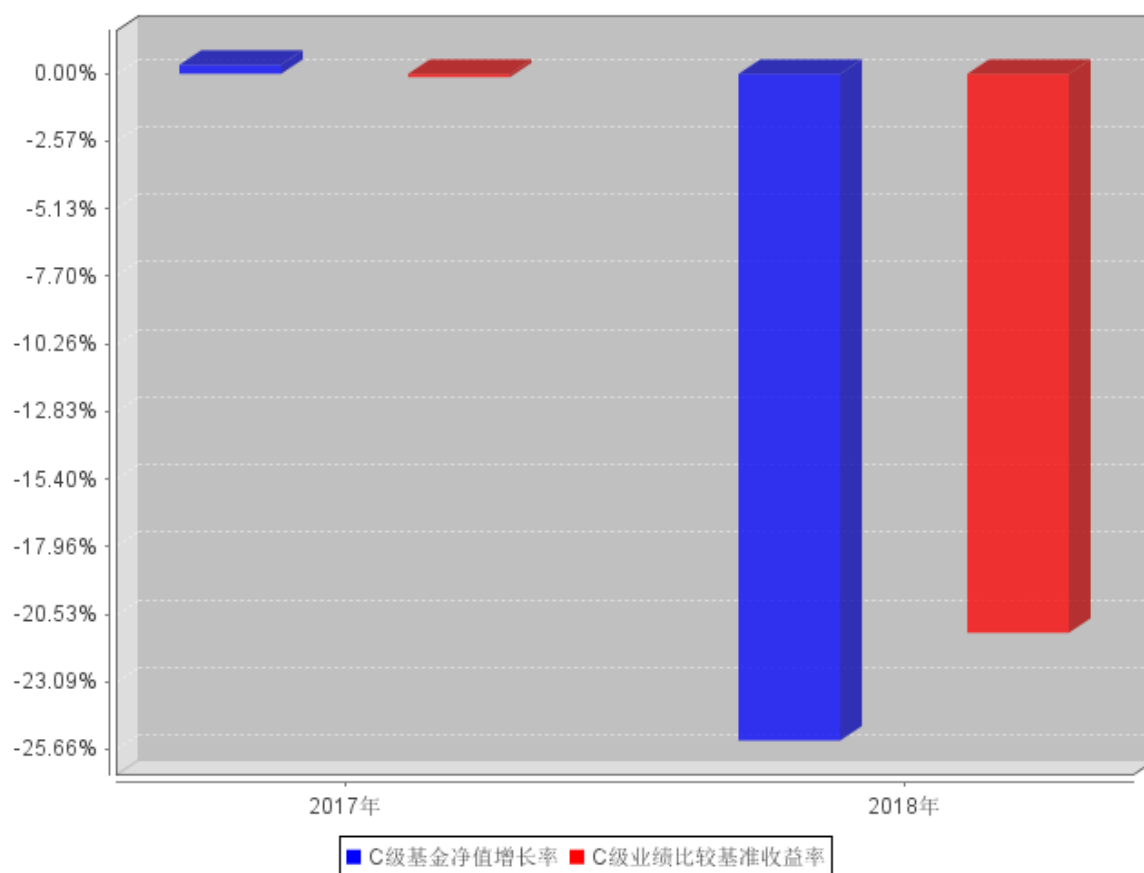
2. 基金业绩比较基准=中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2017 年 12 月 5 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地为上海市浦东新区源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和海澜集团有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2018 年年末,公司整体资产管理规模近 587.35 亿元,其中公募基金 232.14 亿元,专户业务 310.24 亿元,子公司 44.97 亿元;旗下管理着 29 只公募基金,69 只存续专户资产管理计划,24 项存续专项资产管理计划(子公司),涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求。

自 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,进一步引入了量化投资策略,并在业内率先成立了绝对收益部,谋求穿越牛熊的长期业绩回报。

经过多年积累和布局,公司的公募业务已形成三大投研“特色”:1.权益投资坚持自下而上精选优质成长股,把握中国经济转型升级机遇;2.绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念,借助量化模型进行择时和选股;3.固定收益以稳健为本,兼顾流动性与收益率,为大类资产配置提供基础性工具。

海通证券固定收益类资产业绩排行榜的最新数据显示,截至 2018 年年末,东吴旗下的固定收益类基金以 12.59%的最近三年的净值增长率,位列 81 家入选基金公司的第六位。

近年来,公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩,斩获了诸多奖项,比如 2018 东方财富风云榜连续三年稳回报基金*东吴增利债券基金(东方财富网)、第十五届“金基金”奖债券基金奖*东吴增利债券基金(《上海证券报》)、2017 年度三年持续回报普通债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2017 年度最受欢迎新发基金*东吴双三角股票型基金(东方财富风云榜)、2016 年度积极债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金

*东吴鼎利债券基金 L0F（东方财富风云榜）等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭敢	首席投资官兼权益投资总部总经理、基金经理	2017 年 12 月 5 日	-	17 年	彭敢，硕士。曾任大鹏证券研究所研究员、银华基金管理有限公司投资部研究员、银华基金管理有限公司投资管理部研究员、万联证券有限责任公司研发中心首席分析师、财富证券有限责任公司证券投资部投资经理、宝盈基金管理有限公司基金经理等职，2017 年 2 月 28 日加入我司，现任公司首席投资官兼权益投资总部总经理，自 2017 年 7 月 14 日起担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 5 日起担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
曹松涛	基金经理	2017 年 12 月 5 日	-	12 年	曹松涛，博士。2004 年 4 月至 2005 年 12 月在招商证券总裁办工作，任研究员，2006 年 9 月至 2007 年 7 月脱产读博士一年，2007 年 9 月至 2011 年 3 月在招商证券战略发展部工作，历任高级研究员，总经理助理，2011 年 4 月至 2014 年 8 月在招商证券股票投资部工作，任海外投资董事。

					2014 年 8 月至 2016 年 12 月在宝盈基金管理有限公司工作，任专户投资部投资经理。2017 年 1 月 3 日加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理，其中，自 2017 年 4 月 14 日起任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 5 日起担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、彭敢与曹松涛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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行

信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，未发现异常情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

由于对宏观经济和中美贸易战的悲观预期，并叠加美股大跌影响，2018 年是中国证券市场历史上跌幅较大的年份，市场整体疲弱，各类指数反复创出新低并几乎以全年最低点收市。本基金投资上坚持以长三角、珠三角地区相关上市公司为主要投资标的，双三角地区尤其民营经济受宏观经济影响较大，股票表现也因此相对较弱，全年亏损 24.8%。

本年度排名上看，双三角表现中等，全年表现前低后高，全年的相对排名拉回到前 40%左右。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴双三角股票 A 基金份额净值为 0.7548 元，本报告期基金份额净值增长率为 -24.80%；截至本报告期末东吴双三角股票 C 基金份额净值为 0.7493 元，本报告期基金份额净值增长率为 -25.32%；同期业绩比较基准收益率为 -21.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、经济尤其是民营经济的快速下滑引起政府的高度重视，并开始多方位的全面政策救市。目前政策的主要着力点在减税降费，由于目前减税降费的着力点更多是企业而非个人，且幅度不大，减税降费对市场的长期影响大于短期影响。

2、救市不能简单的理解为救资本市场，只是目前的资本市场已经成为了经济的一个重要节点和枢纽。拯救资本市场也就成了拯救经济最重要的一环，尤其是对民营企业和民营企业大股东的信用支持，不能简单理解为避免市场崩溃，而是为了改善民营企业家的预期和信心，提升民间投资获利和稳定就业。

3、从目前的市场走势来看，可以大概率确认目前的市场底部较为明朗，年初的上升趋势较为明确并有望延续为全年趋势。2018 年系统性的大跌已经 price in 了对 2019 年宏观经济和企业盈利的悲观预期。所以虽然基本面仍然会影响市场信心，但货币政策和财政政策对市场的正面影响因素会是市场的主导因素。股市的系统性风险阶段已经过去。未来是真正考验投资选股能力的时候。

4、从之下而上来看，个股的投资价值大幅提升，简单的看已经有 200 多家公司市净率低于 1，绝对数和相对比例在中国证券历史上从来没有发生过，市盈率也站在历史的低点。上市公司的投资价值显著提升，上市公司的回购和大股东的增持也是大幅上升。

从中国过去 40 年的快速发展看，财富的不断累积产生居民资产配置的巨大需求，在经历了地产投资衰退、海外投资受限之后，权益市场已经成为极具性价比的投资标的。

以上因素的叠加，我们认为尽管经济宏观增速有下降压力，但经济的韧性仍在。个股价值的显著提升，为财富配置资金进入股市提供了良好的基础。

在投资板块的选择上，我们坚定看好双三角区域经济的活力和潜力，尽管贸易战也会带来冲击，全球化趋势受到挑战，2019 年中美之间关于贸易的谈判也更多的会朝着解决问题的方向发展，不至于形成死结。双三角区域的中国优势产业龙头仍然有较大的机会成长壮大。成长类公司比价值类和周期类公司有优势，尤其是有独到技术和产品的公司。

从行业分析来看，基因类公司生物医药类公司整数保持较高的水平，经过前期的持续下跌后，估值也到了合理的区间。我们也高度重视次新股中在弱的宏观环境下能保持良好业绩增长的一些个股，尤其是产品和技术有独特竞争力的公司，该类股票尚未被市场充分认知，有一定的估值折价和显著的增长潜力。

其他如农业服务业、中低端消费也将是我们重点关注的板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 根据法规要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据《公开募集开放式证券投资基金

流动性风险管理规定》要求持续关注流动性法规执行情况，从制度建设、系统控制、指标监测、部门间协作等方面，不断优化流动性管理工作流程，建立健全本基金管理人流动性风险管理内部控制体系。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 梳理信批流程，促进信息披露规范化。本基金管理人持续关注最新出台的法律法规，根据产品的不同信息披露要求切实做好信息披露要点汇总、节点提示及对外披露等工作，加强流程化、日志化管理，保障了信息披露工作的及时性以及准确性。

(4) 跟踪监管动态，及时落实新规。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求进行内部讨论，成立工作小组，制订落实方案。及时开展内部培训，修改相关制度与流程，升级业务系统并设置风控阈值，保障基金投资符合监管要求。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、绝对收益部、固定收益部、专户投资部）负责人、合规风控部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；公司副总经理、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估

值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了天衡审字（2019）00459 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴双三角股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	11,239,898.64	39,073,844.27
结算备付金	2,210,395.33	1,587,711.47
存出保证金	312,808.06	251,945.78
交易性金融资产	211,168,165.81	244,689,728.08
其中：股票投资	211,168,165.81	244,689,728.08
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	229,310,000.00
应收证券清算款	4,999,813.61	6,470,622.69
应收利息	3,059.39	582,618.70
应收股利	-	-
应收申购款	17,783.13	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	229,951,923.97	521,966,470.99
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	1,689,233.29	7,625,705.92
应付赎回款	112,181.77	-
应付管理人报酬	292,780.08	547,218.87
应付托管费	48,796.70	91,203.16
应付销售服务费	12,426.59	32,382.32
应付交易费用	751,322.28	371,018.44
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	220,000.00	-
负债合计	3,126,740.71	8,667,528.71
所有者权益：		
实收基金	300,787,091.88	511,425,795.43
未分配利润	-73,961,908.62	1,873,146.85
所有者权益合计	226,825,183.26	513,298,942.28
负债和所有者权益总计	229,951,923.97	521,966,470.99

报告截止日 2018 年 12 月 31 日，东吴双三角股票 A 基金份额净值 0.7548 元，基金份额总额 262,431,677.59 份；东吴双三角股票 C 基金份额净值 0.7493 元，基金份额总额 38,355,414.29 份。东吴双三角股票份额总额合计为 300,787,091.88 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴双三角股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-78,204,664.62	3,144,234.03
1.利息收入	405,535.22	1,201,049.92
其中：存款利息收入	301,572.01	52,522.33
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	103,963.21	1,148,527.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-66,837,769.43	1,902,105.22
其中：股票投资收益	-69,105,328.51	1,902,105.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,267,559.08	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-12,647,142.74	160.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	874,712.33	40,918.28
减：二、费用	13,429,143.39	1,271,087.18
1.管理人报酬	4,671,746.25	547,218.87
2.托管费	778,624.44	91,203.16
3.销售服务费	182,211.53	32,382.32
4.交易费用	7,411,403.68	567,840.83
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	385,157.49	32,442.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-91,633,808.01	1,873,146.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-91,633,808.01	1,873,146.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴双三角股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	511,425,795.43	1,873,146.85	513,298,942.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-91,633,808.01	-91,633,808.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-210,638,703.55	15,798,752.54	-194,839,951.01

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	123,561,483.93	-57,373.49	123,504,110.44
2.基金赎回款	-334,200,187.48	15,856,126.03	-318,344,061.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	300,787,091.88	-73,961,908.62	226,825,183.26
项目	上年度可比期间 2017年12月5日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益(基金净值)	511,425,795.43	-	511,425,795.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,873,146.85	1,873,146.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	511,425,795.43	1,873,146.85	513,298,942.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王炯
基金管理人负责人

徐明
主管会计工作负责人

吴婷
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴双三角股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1573 号文《关于准予东吴双三角股票型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于 2017 年 12 月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 511,425,795.43 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证长三角龙头企业指数收益率 $\times$ 30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率 $\times$ 30%+恒生综合指数收益率 $\times$ 20%+中债总指数收益率 $\times$ 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财

务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允

价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率

差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指期货/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去

每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海澜集团有限公司	基金管理人的股东

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
-------	--	--

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	402,911,415.56	8.54%	9,399,965.10	3.18%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	-	-	180,000,000.00	14.29%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	336,850.81	7.75%	618.39	0.08%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	16,167.74	4.36%	16,167.74	4.36%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,671,746.25	547,218.87
其中：支付销售机构的客户维护费	2,708,010.88	271,732.40

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	778,624.44	91,203.16

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴双三角股票 A	东吴双三角股票 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	8,971.38	8,971.38
中国建设银行股份有限公司	-	54,019.02	54,019.02
东吴证券股份有限公司	-	22,674.06	22,674.06
合计	-	85,664.46	85,664.46
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴双三角股票 A	东吴双三角股票 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	663.20	663.20
中国建设银行股份有限公司	-	6,321.76	6,321.76
东吴证券股份有限公司	-	6,356.30	6,356.30
合计	-	13,341.26	13,341.26

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 12 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	11,239,898.64	221,812.69	39,073,844.27	46,116.08

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖

出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	211,168,165.81	91.83
	其中：股票	211,168,165.81	91.83
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	13,450,293.97	5.85
8	其他各项资产	5,333,464.19	2.32
9	合计	229,951,923.97	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,642,925.13	3.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	100,384,099.76	44.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,190,061.46	5.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,193,639.50	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	811,339.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,986,331.60	14.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,881,468.06	3.92
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	13,438,580.00	5.92
N	水利、环境和公共设施管理业	9,222,980.70	4.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,369.48	0.00
R	文化、体育和娱乐业	9,999,616.00	4.41
S	综合	-	-
	合计	196,756,410.69	86.74

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	3,579,890.34	1.58
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	2,628,600.00	1.16
G 工业	4,869,744.36	2.15
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	3,333,520.42	1.47
合计	14,411,755.12	6.35

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300454	深信服	233,001	20,876,889.60	9.20
2	300252	金信诺	1,553,354	16,931,558.60	7.46
3	300624	万兴科技	205,000	11,082,300.00	4.89
4	600201	生物股份	650,288	10,794,780.80	4.76
5	000681	视觉中国	428,800	9,999,616.00	4.41
6	300676	华大基因	150,500	9,030,000.00	3.98
7	000791	甘肃电投	1,755,941	8,885,061.46	3.92
8	603506	南都物业	399,886	8,881,468.06	3.92
9	600879	航天电子	1,506,900	8,152,329.00	3.59
10	300655	晶瑞股份	567,922	7,689,663.88	3.39

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站

www.scfund.com.cn 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300252	金信诺	59,947,656.78	11.68
2	603517	绝味食品	59,648,958.31	11.62
3	002023	海特高新	56,563,747.97	11.02
4	600038	中直股份	52,801,710.50	10.29
5	600348	阳泉煤业	45,094,516.84	8.79
6	300454	深信服	44,101,904.12	8.59
7	600879	航天电子	43,319,842.00	8.44
8	600028	中国石化	42,367,000.00	8.25
9	002773	康弘药业	40,443,921.64	7.88
10	002368	太极股份	37,549,528.19	7.32
11	002745	木林森	36,704,043.96	7.15
12	002215	诺普信	36,166,011.65	7.05
13	300470	日机密封	34,114,956.85	6.65
14	600201	生物股份	34,102,883.98	6.64
15	002025	航天电器	33,667,150.28	6.56
16	02319	蒙牛乳业	32,399,319.45	6.31
17	603506	南都物业	32,305,777.10	6.29
18	300122	智飞生物	31,766,305.24	6.19
19	300142	沃森生物	31,414,035.48	6.12
20	300010	立思辰	29,093,798.42	5.67
21	300094	国联水产	28,451,464.35	5.54
22	603605	珀莱雅	28,201,254.51	5.49
23	300070	碧水源	28,167,392.36	5.49
24	300676	华大基因	25,711,821.00	5.01
25	600887	伊利股份	25,536,213.00	4.97
26	000681	视觉中国	24,671,832.16	4.81
27	600859	王府井	24,243,774.41	4.72
28	01208	五矿资源	23,985,151.77	4.67
29	603588	高能环境	23,635,965.00	4.60
30	601333	广深铁路	22,596,367.00	4.40

31	300212	易华录	22,429,621.80	4.37
32	600967	内蒙一机	21,833,693.00	4.25
33	600183	生益科技	21,514,623.07	4.19
34	02018	瑞声科技	20,746,563.84	4.04
35	603882	金域医学	20,625,132.42	4.02
36	300388	国祯环保	20,531,997.75	4.00
37	000791	甘肃电投	20,523,175.96	4.00
38	01211	比亚迪股份	20,439,781.65	3.98
39	00700	腾讯控股	19,844,662.09	3.87
40	002653	海思科	19,727,831.00	3.84
41	300047	天源迪科	19,456,424.00	3.79
42	300624	万兴科技	19,401,197.30	3.78
43	000710	贝瑞基因	18,758,437.30	3.65
44	002549	凯美特气	18,725,549.23	3.65
45	002370	亚太药业	17,835,810.00	3.47
46	00386	中国石油化工股份	17,733,918.67	3.45
47	601225	陕西煤业	17,174,946.40	3.35
48	300463	迈克生物	17,112,482.00	3.33
49	300413	芒果超媒	17,075,662.00	3.33
50	603019	中科曙光	16,765,321.51	3.27
51	000983	西山煤电	16,643,000.00	3.24
52	02899	紫金矿业	16,513,234.71	3.22
53	603369	今世缘	16,269,012.98	3.17
54	300525	博思软件	15,817,403.62	3.08
55	600271	航天信息	15,515,797.40	3.02
56	603027	千禾味业	14,986,018.48	2.92
57	600787	中储股份	14,636,585.52	2.85
58	300394	天孚通信	14,593,108.00	2.84
59	300101	振芯科技	14,239,852.00	2.77
60	300456	耐威科技	14,015,405.41	2.73
61	002396	星网锐捷	13,361,920.78	2.60
62	300136	信维通信	13,316,817.15	2.59
63	300088	长信科技	13,052,407.80	2.54
64	300342	天银机电	12,788,831.00	2.49
65	002727	一心堂	12,639,339.00	2.46
66	002821	凯莱英	12,524,833.46	2.44

67	300747	锐科激光	12,426,361.97	2.42
68	603010	万盛股份	11,994,769.50	2.34
69	002925	盈趣科技	11,819,949.00	2.30
70	00525	广深铁路股份	11,593,093.45	2.26
71	000069	华侨城 A	11,104,962.96	2.16
72	300324	旋极信息	10,964,667.48	2.14
73	002769	普路通	10,878,308.00	2.12
74	300159	新研股份	10,814,266.00	2.11
75	300451	创业软件	10,787,287.42	2.10
76	601021	春秋航空	10,621,774.97	2.07
77	01458	周黑鸭	10,564,445.23	2.06
78	300568	星源材质	10,417,801.60	2.03
79	01776	广发证券	10,285,385.68	2.00

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002023	海特高新	60,676,656.84	11.82
2	603517	绝味食品	58,611,022.77	11.42
3	600038	中直股份	52,835,034.69	10.29
4	600348	阳泉煤业	51,373,287.44	10.01
5	300252	金信诺	44,842,584.00	8.74
6	600028	中国石化	44,239,000.00	8.62
7	002368	太极股份	37,903,852.56	7.38
8	002773	康弘药业	35,839,772.18	6.98
9	002215	诺普信	34,234,654.40	6.67
10	002745	木林森	34,147,713.00	6.65
11	600879	航天电子	34,010,220.94	6.63
12	300142	沃森生物	33,990,810.50	6.62
13	002025	航天电器	33,500,215.63	6.53
14	01171	兖州煤业股份	29,462,804.46	5.74
15	300010	立思辰	29,014,713.78	5.65
16	603605	珀莱雅	28,723,500.73	5.60
17	02319	蒙牛乳业	27,719,433.66	5.40

18	300470	日机密封	27,622,546.80	5.38
19	300613	富瀚微	27,522,274.00	5.36
20	01208	五矿资源	26,676,094.55	5.20
21	300122	智飞生物	26,260,847.02	5.12
22	600887	伊利股份	25,356,656.00	4.94
23	01211	比亚迪股份	25,337,991.33	4.94
24	600201	生物股份	24,081,337.09	4.69
25	300070	碧水源	23,500,227.00	4.58
26	600967	内蒙一机	23,113,253.10	4.50
27	300212	易华录	22,497,338.20	4.38
28	600183	生益科技	21,727,896.00	4.23
29	000791	甘肃电投	21,721,403.16	4.23
30	600859	王府井	21,578,779.28	4.20
31	603588	高能环境	21,295,735.00	4.15
32	603506	南都物业	20,865,811.14	4.07
33	00386	中国石油化工股份	20,245,937.69	3.94
34	300454	深信服	19,954,021.00	3.89
35	02018	瑞声科技	19,860,830.54	3.87
36	603882	金域医学	19,772,934.00	3.85
37	300047	天源迪科	19,576,312.55	3.81
38	300394	天孚通信	19,556,114.80	3.81
39	601333	广深铁路	18,884,254.00	3.68
40	00700	腾讯控股	18,556,716.20	3.62
41	002653	海思科	18,540,580.00	3.61
42	002477	雏鹰农牧	18,526,732.00	3.61
43	601699	潞安环能	18,341,673.42	3.57
44	300388	国祯环保	17,748,215.82	3.46
45	603019	中科曙光	16,988,086.00	3.31
46	02899	紫金矿业	16,800,150.73	3.27
47	600567	山鹰纸业	16,662,444.00	3.25
48	002245	澳洋顺昌	16,484,294.52	3.21
49	300413	芒果超媒	16,354,922.00	3.19
50	300094	国联水产	16,340,692.41	3.18
51	601225	陕西煤业	16,044,747.00	3.13
52	300463	迈克生物	15,762,026.00	3.07
53	02208	金风科技	15,007,434.70	2.92
54	002643	万润股份	14,842,193.64	2.89
55	300101	振芯科技	14,617,876.00	2.85

56	603369	今世缘	14,247,754.14	2.78
57	600271	航天信息	14,216,461.00	2.77
58	002549	凯美特气	14,066,870.93	2.74
59	300676	华大基因	13,998,873.00	2.73
60	01513	丽珠医药	13,923,930.35	2.71
61	600477	杭萧钢构	13,877,628.78	2.70
62	300525	博思软件	13,827,110.00	2.69
63	000710	贝瑞基因	13,642,709.00	2.66
64	002396	星网锐捷	13,242,065.78	2.58
65	000681	视觉中国	12,886,972.00	2.51
66	300747	锐科激光	12,797,162.66	2.49
67	000983	西山煤电	12,796,017.00	2.49
68	300088	长信科技	12,327,531.20	2.40
69	002370	亚太药业	11,903,733.80	2.32
70	002402	和而泰	11,825,674.00	2.30
71	300136	信维通信	11,819,499.00	2.30
72	600856	中天能源	11,637,753.00	2.27
73	002727	一心堂	11,500,822.00	2.24
74	600787	中储股份	11,383,631.28	2.22
75	002925	盈趣科技	11,378,381.00	2.22
76	002821	凯莱英	11,294,586.00	2.20
77	603027	千禾味业	11,003,506.00	2.14
78	300456	耐威科技	10,889,387.00	2.12
79	300159	新研股份	10,426,001.00	2.03
80	01458	周黑鸭	10,316,699.24	2.01

注：本项的“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,385,854,464.46
卖出股票收入（成交）总额	2,337,623,555.48

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未投资债券。

8.6 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

本基金报告期末未投资债券。

8.7 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	312,808.06
2	应收证券清算款	4,999,813.61
3	应收股利	-
4	应收利息	3,059.39
5	应收申购款	17,783.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,333,464.19

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东吴双三角股票 A	3,587	73,161.88	0.00	0.00%	262,431,677.59	100.00%
东吴双三角股票 C	695	55,187.65	0.00	0.00%	38,355,414.29	100.00%
合计	4,282	70,244.53	0.00	0.00%	300,787,091.88	100.00%

注：基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴双三角股票 A	-	-
	东吴双三角股票 C	1,141.68	0.0004%
	合计	1,141.68	0.0004%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴双三角股票 A	东吴双三角股票 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 5 日）基金份额总额	420,620,359.77	90,805,435.66
本报告期期初基金份额总额	420,620,359.77	90,805,435.66
本报告期期间基金总申购份额	108,769,477.51	14,792,006.42
减:本报告期期间基金总赎回份额	266,958,159.69	67,242,027.79
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	262,431,677.59	38,355,414.29

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

本基金管理人于 2018 年 4 月 3 日发布公告,徐军女士不再担任公司督察长职务,由吕晖先生担任公司督察长职务,同时吕晖先生不再担任公司副总经理职务。本基金管理人于 2018 年 8 月 16 日发布公告,由徐明先生担任公司副总经理职务。本基金管理人于 2018 年 8 月 31 日发布公告,由马震亚先生担任公司董事长职务,同时范力先生不再担任公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天衡会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期内支付审计费 70000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,上海证监局对公司采取责令改正的决定。公司高度重视,按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程,针对性的制定、落实整改措施,并将及时向监管部门提交整改报告。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	22,195,053,221.29	46.53%	2,051,976.35	47.20%	-
天风证券	2	1,195,816,919.34	25.35%	1,110,400.76	25.54%	-
东吴证券	2	402,911,415.56	8.54%	336,850.81	7.75%	-
海通证券	2	343,125,991.99	7.27%	313,114.45	7.20%	-
恒泰证券	2	179,972,118.53	3.81%	165,800.51	3.81%	-
兴业证券	1	177,304,411.98	3.76%	165,123.63	3.80%	-
国泰君安	2	165,260,851.66	3.50%	150,768.81	3.47%	-
招商证券	1	58,452,613.16	1.24%	53,267.59	1.23%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增两个交易单元，分别为国泰君安与天风证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	7,000,000.00	100.00%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20180319 - 20180506	0.00	86,453,044.33	86,453,044.33	0.00	0%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日