

东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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

送出日期：二〇一九年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 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.....	42
7.9 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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
11.1 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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴中证新兴产业指数证券投资基金
基金简称	东吴中证新兴指数
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
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
报告期末基金份额总额	77,675,583.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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增长所带来的投资收益。
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	贺倩
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	95599
传真	021-50509888-8211	010-68121816
注册地址	上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海浦东源深路 279 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200135	100031
法定代表人	王炯	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	231,332.56
本期利润	11,753,229.87
加权平均基金份额本期利润	0.1480
本期加权平均净值利润率	14.77%
本期基金份额净值增长率	16.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	652,742.54
期末可供分配基金份额利润	0.0084
期末基金资产净值	78,328,325.93
期末基金份额净值	1.008
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.80%

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

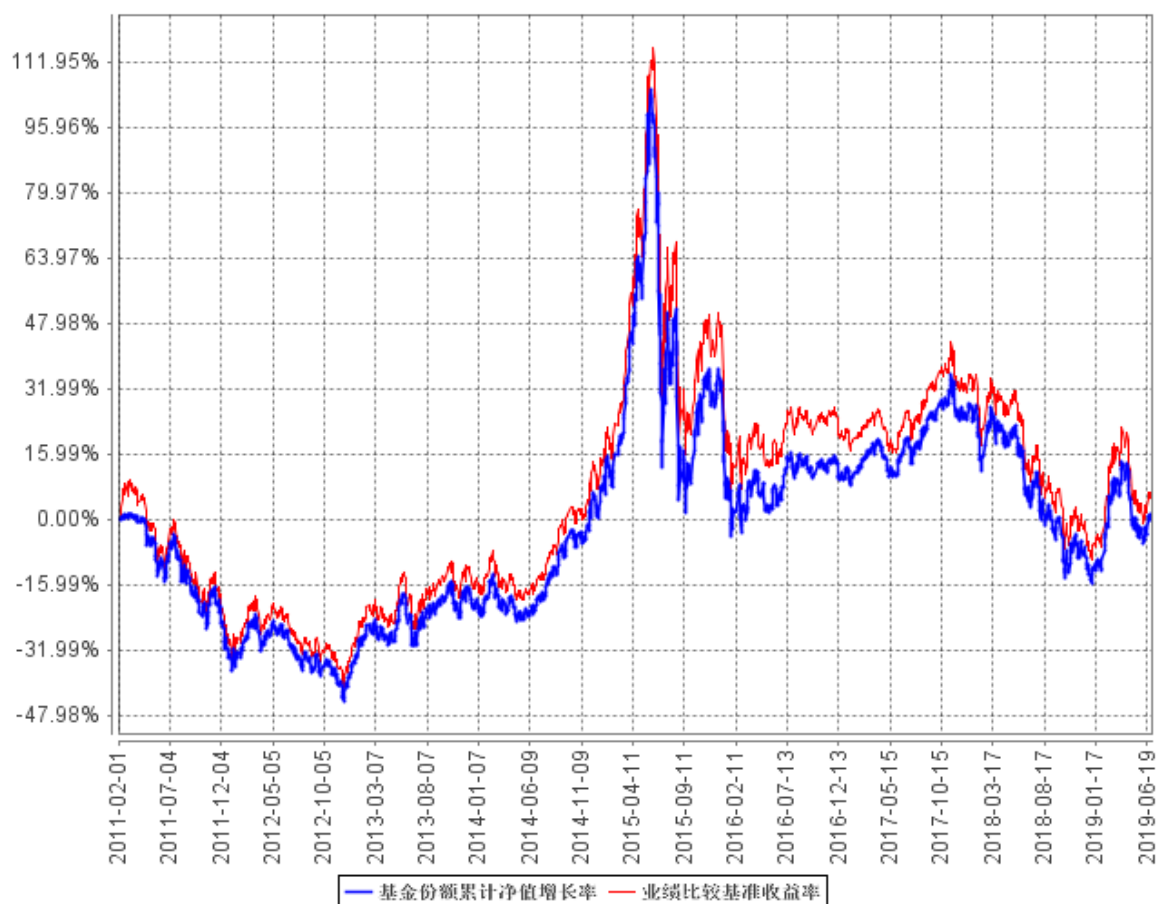
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.81%	1.14%	3.33%	1.16%	0.48%	-0.02%
过去三个月	-7.35%	1.59%	-8.90%	1.61%	1.55%	-0.02%
过去六个月	16.26%	1.62%	14.76%	1.63%	1.50%	-0.01%
过去一年	-6.58%	1.59%	-7.40%	1.58%	0.82%	0.01%
过去三年	-6.75%	1.21%	-10.79%	1.20%	4.04%	0.01%
自基金合同	0.80%	1.62%	6.14%	1.59%	-5.34%	0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

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：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。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 2019 年 6 月末, 公司旗下管理着 29 只公募基金, 资产管理总规模 688 亿元 (包括专户、专项资产管理规模), 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。

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		
朱冰兵	基金经理	2017 年 3 月 9 日	—	8 年	朱冰兵同志, 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 月至今，一直从事研究工作，历任助理研究员、研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中，自 2018 年 7 月 11 日起担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金（2018 年 7 月 11 日由原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型）、自 2017 年 3 月 9 日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理。
周鑫怵	基金经理	2018 年 6 月 4 日	-	6 年	周鑫怵，学士。2008 年 09 月至 2012 年 7 月，就职于交通银行，从事数据分析工作。2012 年 08 月加入东吴基金，从事股票投资研究交易与数据分析工作，自 2018 年 6 月 4 日起任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 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。

4.3.2 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 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

2019 年上半年，在经历了经济高开低走，流动性由松至紧，贸易谈判从达成到破裂后重启的多重变量影响后，市场情绪跌宕起伏，呈现大涨后的快速调整，上证指数上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，创业板指数上涨 20.87%，中证新兴 15.52%，其中食品饮料、非银、农业、家电、计算机等板块有较好的相对收益。

在出口和投资受限的背景下，经济增长的驱动力主要来自于消费和产业转型升级，减税降费收入再分配为鼓励居民消费升级创造条件。从历史数据和商业模式分析，消费的内生性、盈利的持续性和稳定性决定能够有效消除外需的不确定性和经济的周期性波动；我们看到存量市场中，强者恒强的趋势明显，在经济下行周期中，风险偏好降低、对企业盈利的追求使蓝筹白马的风险收益比更好。因此基于业绩增长确定性的投资逻辑，我们投资组合主要围绕消费与创新、优选行业龙头展开并不断优化，看好消费、医药、免税、保险、5G、云计算、光伏等板块的龙头公司的投资机会。

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，控制相对基准的偏离，严格控制仓位，积极申购新股。坚持价值投资和行业龙头策略，从相对中长线周期来自下而上精选有核心竞争力、估值匹配、业绩增长确定的优质公司，通过公司的长期业绩增长来克服市场的波动，获得超额收益。

4.4.2 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 1.008 元；本报告期基金份额净值增长率为 16.26%，业绩比较基准收益率为 14.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 GDP 增速 6.3%，处于合理区间；社零增速 8.4%，消费对经济增长贡献率 60.1%，第三

产业占比 54.9%，显示中国经济的韧性强，经济结构中持续优化。展望 2019 年下半年，我们认为经济仍处于底部位置，基建维持稳定，进出口略有下滑，房地产投资将放缓，消费则由于基数较低表现较好，战略性新兴产业保持高速增长，呈现稳中求进态势。四月份政治局会议上政策收紧流动性总闸门后，七月份又到了政策调整的窗口期，鉴于美联储已经释放宽松预期，中国的政策空间打开。未来有望通过积极财政政策、稳健货币政策来维持稳定就业、稳定经济，通过时间来消化一些存量的问题。通过进一步加快改革、开放步伐，降低中小企业融资成本，减税降费、鼓励消费和创新等，加快新旧动能转换，释放市场潜力，实现经济增长方式的转型升级。

从流动性来看，流动性仍将充裕，有利于市场上涨。从企业盈利来看，我们认为创业板盈利底部已在 18 年四季度见到，主板盈利可能由于下半年 PPI 的拖累而进一步下滑，或对市场上涨形成一定压力。从结构来看，行业龙头盈利确定性和稳定性较好，且估值相对合理偏低。中美贸易摩擦已预期较为充分，即使后续有所反复，对市场边际影响趋弱，市场往下的概率和空间都不大。相比成熟市场，中国资产收益率高，随着 MSCI、富时罗素等指数纳入 A 股的权重不断提升，外资将持续流入 A 股从而逐渐成为市场重要的力量，其投资风格对市场影响进一步加深，对蓝筹白马的配置将稳定市场波动。因此市场整体将呈现区间波动和结构性特征，等待企业盈利的修复向上。

我们长期看好消费和创新，捕捉行业的变化，自下而上挖掘出能够符合未来发展趋势、护城河不断加宽的、能穿越周期的优质公司，给投资者好的回报，不负投资者所托。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴中证新兴产业指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,329,059.40	3,865,304.87
结算备付金		14,831.79	8,435.36
存出保证金		4,559.10	6,620.79
交易性金融资产	6.4.7.2	74,199,759.54	66,522,927.07
其中：股票投资		74,199,759.54	66,522,927.07
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	268,344.24
应收利息	6.4.7.5	784.94	776.26
应收股利		-	-
应收申购款		303,349.73	14,207.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		78,852,344.50	70,686,616.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		161,608.34	-
应付赎回款		150,887.64	-
应付管理人报酬		62,439.20	62,393.73
应付托管费		9,365.89	9,359.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,695.24	27,939.00

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,022.26	180,000.00
负债合计		524,018.57	279,691.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	77,675,583.39	81,230,442.25
未分配利润	6.4.7.10	652,742.54	-10,823,517.51
所有者权益合计		78,328,325.93	70,406,924.74
负债和所有者权益总计		78,852,344.50	70,686,616.54

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.008 元，基金份额总额 77,675,583.39 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴中证新兴产业指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		12,429,152.65	-13,975,508.81
1.利息收入		16,031.10	21,617.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,031.10	21,617.75
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		888,495.30	-6,356,193.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	330,326.09	-6,917,623.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	558,169.21	561,430.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	11,521,897.31	-7,649,149.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,728.94	8,215.94

减：二、费用		675,922.78	1,001,686.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	393,259.49	541,327.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	58,988.95	81,199.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	45,889.08	125,340.65
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	6.4.7.19	177,785.26	253,819.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,753,229.87	-14,977,195.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,753,229.87	-14,977,195.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴中证新兴产业指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	81,230,442.25	-10,823,517.51	70,406,924.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,753,229.87	11,753,229.87
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）	-3,554,858.86	-276,969.82	-3,831,828.68
其中：1.基金申购款	2,542,052.09	28,695.19	2,570,747.28
2.基金赎回款	-6,096,910.95	-305,665.01	-6,402,575.96
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）	77,675,583.39	652,742.54	78,328,325.93

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	95,096,726.63	24,044,351.59	119,141,078.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,977,195.45	-14,977,195.45
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）	-11,725,741.23	-2,440,328.40	-14,166,069.63
其中：1.基金申购款	3,073,008.67	669,471.20	3,742,479.87
2.基金赎回款	-14,798,749.90	-3,109,799.60	-17,908,549.50
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）	83,370,985.40	6,626,827.74	89,997,813.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴中证新兴产业指数证券投资基金（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[2010]1792 号文）《关于核准东吴中证新兴产业指数证券投资基金募集的批复》批准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 2 月 1 日正式生效。首次设立募集规模为 1,976,549,775.28 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、新股（一级

市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,中证新兴产业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,329,059.40
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	4,329,059.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		80,895,340.44	74,199,759.54	-6,695,580.90
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		80,895,340.44	74,199,759.54	-6,695,580.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	777.02
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	6.03
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1.89
合计	784.94

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	21,695.24
银行间市场应付交易费用	—
合计	21,695.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	322.00
应付指数使用费	50,000.00

应付审计费	24,795.19
应付账户维护费	-
应付信息披露费	42,905.07
合计	118,022.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,230,442.25	81,230,442.25
本期申购	2,542,052.09	2,542,052.09
本期赎回(以“-”号填列)	-6,096,910.95	-6,096,910.95
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	77,675,583.39	77,675,583.39

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	87,269,821.31	-98,093,338.82	-10,823,517.51
本期利润	231,332.56	11,521,897.31	11,753,229.87
本期基金份额交易产生的变动数	-3,795,240.07	3,518,270.25	-276,969.82
其中：基金申购款	2,721,752.40	-2,693,057.21	28,695.19
基金赎回款	-6,516,992.47	6,211,327.46	-305,665.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,705,913.80	-83,053,171.26	652,742.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,733.78
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	260.25
其他	37.07
合计	16,031.10

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,004,285.60
减：卖出股票成本总额	16,673,959.51
买卖股票差价收入	330,326.09

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	558,169.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	558,169.21

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,521,897.31
——股票投资	11,521,897.31
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	—
合计	11,521,897.31

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,134.49
基金转换费收入	594.45
合计	2,728.94

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	45,889.08
银行间市场交易费用	—
合计	45,889.08

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	42,905.07
银行汇划费	1,085.00
指数使用费	100,000.00
账户维护费	9,000.00
银行手续费	-
上市费	-
合计	177,785.26

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国农业银行股份有限公司	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

注：本报告期基金关联方未发生变化。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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	393,259.49	541,327.00
其中：支付销售机构的客户维护费	206,356.22	284,409.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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，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，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	58,988.95	81,199.06

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，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付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,329,059.40	15,733.78	4,771,817.48	21,000.07

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大资产重组	6.28	2019 年 7 月 12 日	13.86	78,750	2,288,523.37	494,550.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为进行被动指数化投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种，获得证券市场平均收益率，本基金的运作涉及的金融工具主要标的指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，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。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金

管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,329,059.40	-	-	-	-	-	4,329,059.40
结算备付金	14,831.79	-	-	-	-	-	14,831.79
存出保证金	4,559.10	-	-	-	-	-	4,559.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	74,199,759.54	74,199,759.54
应收利息	-	-	-	-	-	784.94	784.94
应收申购款	-	-	-	-	-	303,349.73	303,349.73
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,348,450.29	-	-	-	-	74,503,894.21	78,852,344.50
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	161,608.34	161,608.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	150,887.64	150,887.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,439.20	62,439.20
应付托管费	-	-	-	-	-	9,365.89	9,365.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,695.24	21,695.24

其他负债	-	-	-	-	-	118,022.26	118,022.26
负债总计	-	-	-	-	-	524,018.57	524,018.57
利率敏感度缺口	4,348,450.29	-	-	-	-	73,979,875.64	78,328,325.93
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,865,304.87	-	-	-	-	-	3,865,304.87
结算备付金	8,435.36	-	-	-	-	-	8,435.36
存出保证金	6,620.79	-	-	-	-	-	6,620.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	66,522,927.07	66,522,927.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	268,344.24	268,344.24
应收利息	-	-	-	-	-	776.26	776.26
应收申购款	-	-	-	-	-	14,207.95	14,207.95
资产总计	3,880,361.02	-	-	-	-	66,806,255.52	70,686,616.54
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,393.73	62,393.73
应付托管费	-	-	-	-	-	9,359.07	9,359.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	27,939.00	27,939.00
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	279,691.80	279,691.80
利率敏感度缺口	3,880,361.02	-	-	-	-	66,526,563.72	70,406,924.74

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	74,199,759.54	94.73	66,522,927.07	94.48
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	74,199,759.54	94.73	66,522,927.07	94.48

注：本基金投资于中证新兴产业指数成份股及备选股的比例不低于基金资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2019 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2018 年 12 月 31 日 ）
	1. 业绩基准下跌 1%	-775, 450. 43	-718, 150. 63
	2. 业绩基准下跌 5%	-3, 877, 252. 13	-3, 590, 753. 16
	3. 业绩基准下跌 10%	-7, 754, 504. 27	-7, 181, 506. 32

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	74,199,759.54	94.10
	其中：股票	74,199,759.54	94.10
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	4,343,891.19	5.51
8	其他各项资产	308,693.77	0.39
9	合计	78,852,344.50	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,460,421.00	1.86
C	制造业	54,077,199.51	69.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,117,226.00	2.70
E	建筑业	1,944,707.00	2.48
F	批发和零售业	1,572,365.16	2.01
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	8,615,355.87	11.00
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	708,225.20	0.90

M	科学研究和技术服务业	814,792.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	722,896.42	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	760,313.50	0.97
R	文化、体育和娱乐业	702,564.00	0.90
S	综合	-	-
	合计	73,496,065.66	93.83

7.2.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	41,932.60	0.05
C	制造业	605,652.20	0.77
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	33,002.48	0.04
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	23,106.60	0.03
S	综合	-	-
	合计	703,693.88	0.90

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

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	600516	方大炭素	75,835	932,012.15	1.19
2	000063	中兴通讯	28,331	921,607.43	1.18
3	600276	恒瑞医药	13,927	919,182.00	1.17
4	603160	汇顶科技	6,600	916,080.00	1.17
5	600309	万华化学	20,691	885,367.89	1.13
6	000661	长春高新	2,600	878,800.00	1.12
7	300033	同花顺	8,900	875,404.00	1.12
8	300142	沃森生物	30,800	873,488.00	1.12
9	600588	用友网络	32,230	866,342.40	1.11
10	600570	恒生电子	12,369	842,947.35	1.08
11	300122	智飞生物	19,528	841,656.80	1.07
12	300450	先导智能	25,000	840,000.00	1.07
13	601012	隆基股份	36,086	833,947.46	1.06
14	603986	兆易创新	9,600	832,320.00	1.06
15	002202	金风科技	66,936	832,014.48	1.06
16	600867	通化东宝	53,976	831,230.40	1.06
17	002230	科大讯飞	24,804	824,484.96	1.05
18	002007	华兰生物	27,000	823,230.00	1.05
19	603259	药明康德	9,400	814,792.00	1.04
20	002241	歌尔股份	91,200	810,768.00	1.04
21	002153	石基信息	22,200	803,418.00	1.03
22	300059	东方财富	58,764	796,252.20	1.02
23	002236	大华股份	54,800	795,696.00	1.02
24	002415	海康威视	28,774	793,586.92	1.01
25	600703	三安光电	70,019	789,814.32	1.01
26	002624	完美世界	30,600	789,786.00	1.01
27	002179	中航光电	23,590	789,321.40	1.01
28	600196	复星医药	31,127	787,513.10	1.01
29	000963	华东医药	30,321	787,133.16	1.00
30	601989	中国重工	141,488	786,673.28	1.00
31	300408	三环集团	40,400	785,780.00	1.00
32	002024	苏宁易购	68,400	785,232.00	1.00
33	600436	片仔癀	6,795	782,784.00	1.00

34	000538	云南白药	9,366	781,311.72	1.00
35	300003	乐普医疗	33,900	780,378.00	1.00
36	300072	三聚环保	97,731	775,006.83	0.99
37	600332	白云山	18,839	771,833.83	0.99
38	600031	三一重工	58,649	767,128.92	0.98
39	600176	中国巨石	79,872	761,180.16	0.97
40	300015	爱尔眼科	24,550	760,313.50	0.97
41	002399	海普瑞	36,200	759,838.00	0.97
42	000938	紫光股份	27,864	759,294.00	0.97
43	600487	亨通光电	45,280	758,892.80	0.97
44	000768	中航飞机	48,137	758,157.75	0.97
45	600406	国电南瑞	40,666	758,014.24	0.97
46	600482	中国动力	31,700	748,754.00	0.96
47	601808	中海油服	77,100	742,473.00	0.95
48	600085	同仁堂	25,598	742,342.00	0.95
49	000625	长安汽车	111,815	741,333.45	0.95
50	600760	中航沈飞	25,500	740,265.00	0.95
51	601727	上海电气	137,508	739,793.04	0.94
52	300433	蓝思科技	106,047	739,147.59	0.94
53	300136	信维通信	30,202	738,438.90	0.94
54	600535	天士力	44,594	738,030.70	0.94
55	600271	航天信息	32,000	737,600.00	0.94
56	600637	东方明珠	69,968	737,462.72	0.94
57	600104	上汽集团	28,896	736,848.00	0.94
58	600660	福耀玻璃	32,400	736,452.00	0.94
59	000333	美的集团	14,200	736,412.00	0.94
60	000100	TCL 集团	220,710	734,964.30	0.94
61	002008	大族激光	21,195	728,684.10	0.93
62	600050	中国联通	118,000	726,880.00	0.93
63	300070	碧水源	92,798	722,896.42	0.92
64	600019	宝钢股份	111,200	722,800.00	0.92
65	000413	东旭光电	140,600	722,684.00	0.92
66	600066	宇通客车	55,452	721,985.04	0.92
67	600089	特变电工	99,498	721,360.50	0.92
68	600522	中天科技	78,600	720,762.00	0.92
69	000725	京东方 A	209,500	720,680.00	0.92
70	600893	航发动力	31,676	719,361.96	0.92
71	601985	中国核电	129,200	718,352.00	0.92
72	603993	洛阳钼业	181,300	717,948.00	0.92

73	600025	华能水电	176,200	717,134.00	0.92
74	600111	北方稀土	55,771	716,099.64	0.91
75	300124	汇川技术	31,200	714,792.00	0.91
76	600498	烽火通信	25,638	714,274.68	0.91
77	000786	北新建材	39,300	712,509.00	0.91
78	601766	中国中车	87,671	709,258.39	0.91
79	002027	分众传媒	133,880	708,225.20	0.90
80	002594	比亚迪	13,932	706,631.04	0.90
81	000423	东阿阿胶	17,657	703,101.74	0.90
82	002739	万达电影	38,100	702,564.00	0.90
83	601877	正泰电器	30,400	701,936.00	0.90
84	002601	龙蟒佰利	47,000	697,010.00	0.89
85	600100	同方股份	76,777	694,831.85	0.89
86	600674	川投能源	76,600	681,740.00	0.87
87	603019	中科曙光	19,000	666,900.00	0.85
88	601633	长城汽车	79,300	655,811.00	0.84
89	601186	中国铁建	65,700	653,715.00	0.83
90	601800	中国交建	57,600	652,032.00	0.83
91	601390	中国中铁	98,000	638,960.00	0.82
92	002460	赣锋锂业	26,957	631,602.51	0.81
93	601360	三六零	27,800	594,364.00	0.76
94	002602	世纪华通	53,860	588,151.20	0.75
95	603799	华友钴业	26,260	559,600.60	0.71
96	002466	天齐锂业	20,313	513,512.64	0.66
97	002456	欧菲光	63,200	495,488.00	0.63
98	601600	中国铝业	78,000	305,760.00	0.39
99	002252	上海莱士	35,300	245,335.00	0.31

7.3.2 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所有股票投资明细

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	600485	*ST 信威	78,750	494,550.00	0.63
2	300782	卓胜微	495	53,915.40	0.07
3	600968	海油发展	11,812	41,932.60	0.05
4	601698	中国卫通	8,419	33,002.48	0.04
5	300594	朗进科技	685	30,215.35	0.04
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.03

7	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.03
---	--------	------	-------	-----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300033	同花顺	779,162.00	1.11
2	603019	中科曙光	759,898.60	1.08
3	002007	华兰生物	757,792.16	1.08
4	002739	万达电影	751,815.00	1.07
5	300450	先导智能	731,227.00	1.04
6	002399	海普瑞	729,335.00	1.04
7	601600	中国铝业	453,120.00	0.64
8	300433	蓝思科技	436,389.26	0.62
9	002252	上海莱士	361,450.00	0.51
10	300072	三聚环保	301,163.27	0.43
11	600516	方大炭素	294,834.00	0.42
12	600703	三安光电	292,322.00	0.42
13	600989	宝丰能源	270,838.72	0.38
14	600535	天士力	177,422.00	0.25
15	600867	通化东宝	173,772.96	0.25
16	600100	同方股份	168,818.00	0.24
17	300003	乐普医疗	164,018.00	0.23
18	600637	东方明珠	155,630.00	0.22
19	300070	碧水源	152,317.00	0.22
20	000063	中兴通讯	148,034.00	0.21

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。

7.4.2 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	002271	东方雨虹	1,037,866.00	1.47
2	002555	三七互娱	726,345.00	1.03

3	300296	利亚德	711,616.49	1.01
4	002044	美年健康	664,023.90	0.94
5	300251	光线传媒	644,939.78	0.92
6	002411	延安必康	595,305.00	0.85
7	600031	三一重工	429,393.00	0.61
8	002450	*ST 康得	404,041.20	0.57
9	000661	长春高新	383,553.00	0.54
10	600989	宝丰能源	379,953.60	0.54
11	601633	长城汽车	370,313.00	0.53
12	601012	隆基股份	365,355.00	0.52
13	000063	中兴通讯	353,997.00	0.50
14	603160	汇顶科技	346,652.00	0.49
15	600570	恒生电子	325,451.00	0.46
16	002252	上海莱士	288,834.00	0.41
17	600025	华能水电	285,418.00	0.41
18	000333	美的集团	281,733.00	0.40
19	600111	北方稀土	272,599.00	0.39
20	000100	TCL 集团	254,865.00	0.36

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。

7.4.3 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	12,828,894.67
卖出股票收入（成交）总额	17,004,285.60

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。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未投资债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	4,559.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	784.94
5	应收申购款	303,349.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	308,693.77

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	*ST 信威	494,550.00	0.63	重大资产重组

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,184	24,395.60	1,142,665.64	1.47%	76,532,917.75	98.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

8.3 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 2 月 1 日）基金份额总额	1, 976, 549, 775. 28
本报告期期初基金份额总额	81, 230, 442. 25
本报告期期间基金总申购份额	2, 542, 052. 09
减:本报告期期间基金总赎回份额	6, 096, 910. 95
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	77, 675, 583. 39

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本基金本报告期内管理人未发生重大的人事变动。

本基金本报告期内托管人发生以下人事变动：

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所。

10.6 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证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。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，制定相关整改措施，落实整改工作。

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
安信证券	1	12,426,825.85	43.37%	11,324.79	42.99%	—
兴业证券	1	8,415,777.91	29.37%	7,837.61	29.75%	—
宏源证券	1	3,242,060.56	11.31%	2,954.55	11.22%	—
平安证券	1	1,729,240.60	6.03%	1,610.54	6.11%	—
中泰证券	2	977,950.90	3.41%	891.16	3.38%	—
华信证券	1	918,765.03	3.21%	855.55	3.25%	—
东方证券	1	610,243.75	2.13%	556.13	2.11%	—
申港证券	2	232,821.00	0.81%	216.80	0.82%	—
光大证券	2	101,980.00	0.36%	94.98	0.36%	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
万联证券	2	—	—	—	—	—
首创证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
华泰联合	1	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
申银万国	1	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—
中银国际	2	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—

东吴证券	2	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：1、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

本基金本报告期退租 1 个交易单元：信达证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2018 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2019 年 1 月 2 日
2	东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有信威集团（600485）估值调整的公告	证券时报、公司网站	2019 年 2 月 28 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 3 月 8 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 3 月 8 日
6	东吴中证新兴产业指数证券投资基金更新招募说明书以及摘要	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 15 日
7	东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 29 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2019 年 3 月 30 日

9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2019 年 4 月 12 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 4 月 17 日
11	东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 20 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国民生银行直销银行基金通平台基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 5 月 15 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 6 月 14 日
14	东吴基金管理有限公司关于参加华瑞保险销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 6 月 14 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 6 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

12.3 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

2019 年 8 月 27 日