

东吴移动互联网灵活配置混合型证券投资基金
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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|------------|
| 基金简称 | 东吴移动互联 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 001323 | |
| 交易代码 | 001323 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 5 月 27 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 252,482,674.63 份 | |
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于移动互联主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。 | |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。 | |
| 业绩比较基准 | 中证移动互联网指数 × 50% + 中债综合指数 × 50% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 | |
| 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 | 东吴移动互联混合 A | 东吴移动互联混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001323 | 002170 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 252,481,675.63 份 | 999.00 份 |

§ 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 ） | |
|-----------------|---|------------|
| | 东吴移动互联混合 A | 东吴移动互联混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 9,212,925.40 | 33.10 |
| 2. 本期利润 | 6,155,550.57 | 22.23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0235 | 0.0223 |
| 4. 期末基金资产净值 | 283,193,533.57 | 1,113.73 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.122 | 1.115 |

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、本基金于 2015 年 5 月 27 日成立，于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

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

东吴移动互联混合 A

| 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 | 2.19% | 0.64% | 3.19% | 0.50% | -1.00% | 0.14% |

东吴移动互联混合 C

| 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 | 2.01% | 0.65% | 3.19% | 0.50% | -1.18% | 0.15% |

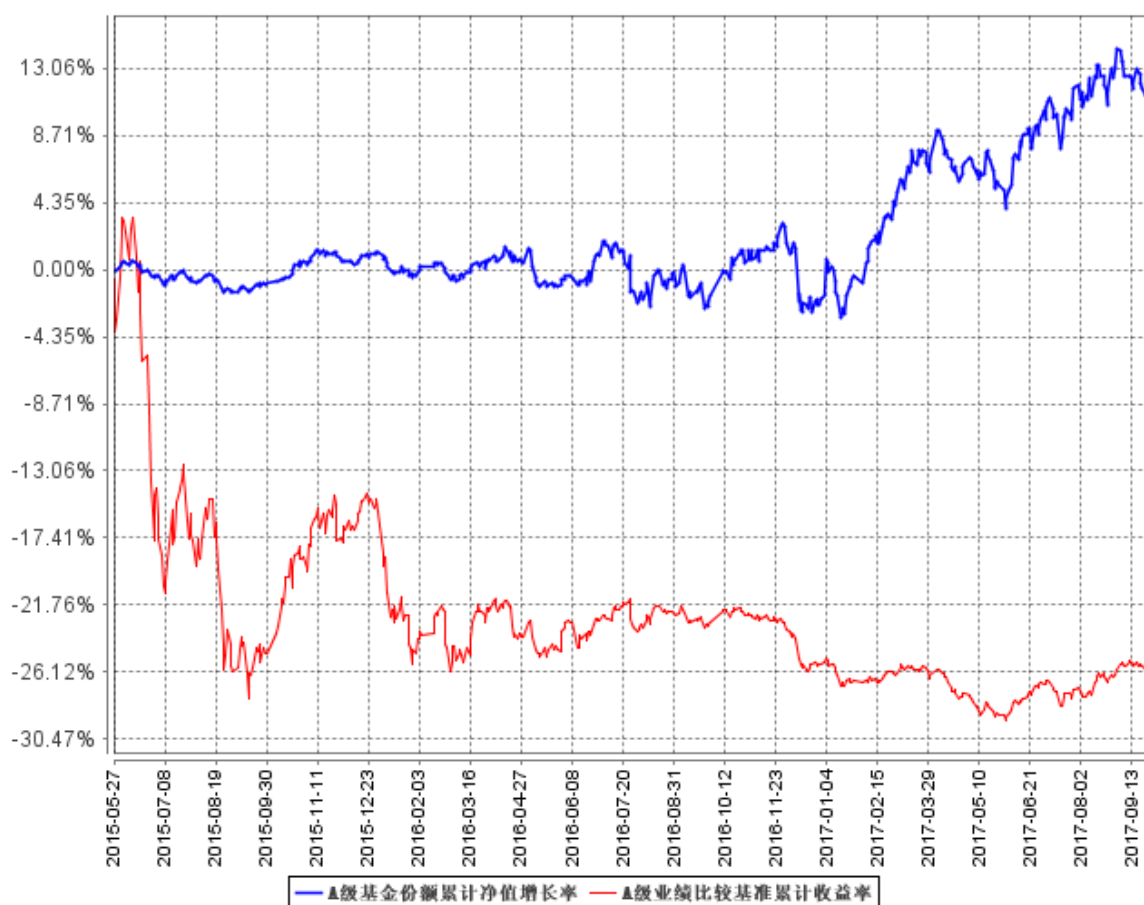
注：1、比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%

2、本基金于 2015 年 5 月 27 日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

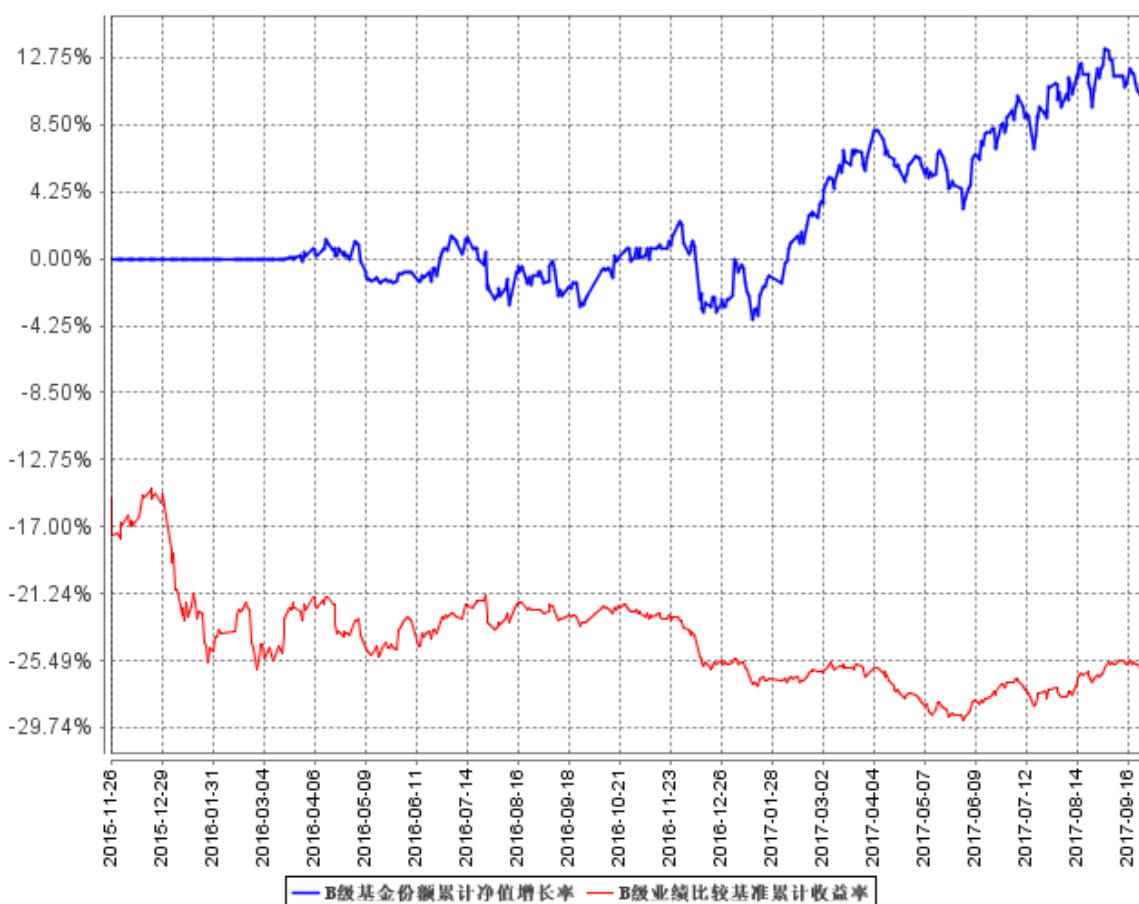
3、本基金于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

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

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



B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、比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%

2、本基金于2015年5月27日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3、本基金于2015年11月26日开始分为A、C两类。

§ 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 | | |
| 刘元海 | 绝对收益部总经理、本基金基金经理 | 2016年4月27日 | - | 12年 | 博士，同济大学毕业。2004年2月至2015年6月就职于东吴基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理等职务，2016年2 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 月再次加入我司，现任绝对收益部总经理，其中自 2016 年 4 月 27 日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 9 日起担任东吴优信稳健债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

3 季度，上证指数只在 7 月 17 日和 8 月 11 日两个交易日出现过较大幅度调整，呈现震荡上升趋势，整体走势要强于我们预期。特别是在 8 月 25 日市场有效站上 3300 点之后，本基金将之前已经降低的仓位提高到 6 成以上。当时仓位提高的理由主要有两个：一是，上证指数有效站上 3300 点是一个重要积极信号，将会有效提高市场做多风险偏好；二是，宏观经济和上市公司中报数据亮点还比较多，特别是周期型行业盈利情况大幅超市场预期。

行业配置上，主要以涨幅落后的行业为主如：传媒、计算机、医药、券商、环保、建筑（PPP）等，同时增加配置稳定增长型消费股。我们判断，越靠近年底考虑估值切换，以传媒、计算机和医药为代表的成长股投资机会将更大。4 季度如果经济存在下行风险，预计政府将加快推行 PPP，业绩快速增长且今年股价滞涨的建筑股和环保股投资机会就很大。券商最严厉的监管阶段也许已经过去，PB 也处在历史底部，2018 年随着 A 股市场加入 msci 指数，资本市场国际化以及财富管理兴起，券商行业收入增长点将明显增多，行业大拐点可能已经逐渐来临。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东吴移动互联 A 份额净值为 1.122 元，累计净值 1.122 元；本报告期份额净值增长率 2.19%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%；东吴移动互联 C 份额净值为 1.115 元，累计净值 1.115 元；本报告期份额净值增长率 2.01%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%。

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 | 195,515,534.09 | 64.09 |
| | 其中：股票 | 195,515,534.09 | 64.09 |
| 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 | 6,000,129.00 | 1.97 |
| | 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 | 102,876,191.89 | 33.72 |
| 8 | 其他资产 | 668,527.21 | 0.22 |
| 9 | 合计 | 305,060,382.19 | 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 | 39,793.60 | 0.01 |
| C | 制造业 | 53,103,968.25 | 18.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,093.44 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 6,804,000.00 | 2.40 |
| F | 批发和零售业 | 6,711,585.45 | 2.37 |
| 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 | 22,357,964.24 | 7.89 |
| J | 金融业 | 49,484,600.00 | 17.47 |
| K | 房地产业 | 10,025,600.00 | 3.54 |
| 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 | 1,419,000.00 | 0.50 |
| 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 | 45,537,929.11 | 16.08 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 195,515,534.09 | 69.04 |

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 | 002343 | 慈文传媒 | 650,700 | 25,188,597.00 | 8.89 |
| 2 | 300336 | 新文化 | 1,152,600 | 17,035,428.00 | 6.02 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 680,000 | 12,369,200.00 | 4.37 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 889,928 | 12,307,704.24 | 4.35 |
| 5 | 601688 | 华泰证券 | 500,000 | 11,310,000.00 | 3.99 |
| 6 | 000776 | 广发证券 | 580,000 | 11,008,400.00 | 3.89 |
| 7 | 000567 | 海德股份 | 320,000 | 10,025,600.00 | 3.54 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 158,000 | 9,050,240.00 | 3.20 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 600,000 | 8,868,000.00 | 3.13 |
| 10 | 300145 | 中金环境 | 458,000 | 7,749,360.00 | 2.74 |

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 | 649,287.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 17,791.50 |
| 5 | 应收申购款 | 1,447.83 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 668,527.21 |

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

| 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 | 300145 | 中金环境 | 7,749,360.00 | 2.74 | 重大资产重组 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东吴移动互联混合 A | 东吴移动互联混合 C |
|---------------------------|----------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 273,903,382.57 | 999.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 20,321,489.60 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 41,743,196.54 | - |
| 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 | 252,481,675.63 | 999.00 |

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。

3、本基金于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

§ 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移动互联灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴移动互联灵活配置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、报告期内东吴移动互联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