

# 东吴中证新兴产业指数证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	81,230,442.25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

## 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	2016 年
本期已实现收益	-10,586,913.34	10,941,726.99	-6,497,128.80
本期利润	-32,452,097.24	15,663,171.20	-26,653,064.44
加权平均基金份额本期利润	-0.3763	0.1541	-0.2225
本期基金份额净值增长率	-30.81%	13.60%	-16.57%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1332	0.2528	0.1027
期末基金资产净值	70,406,924.74	119,141,078.22	118,481,995.33
期末基金份额净值	0.867	1.253	1.103
- 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末

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

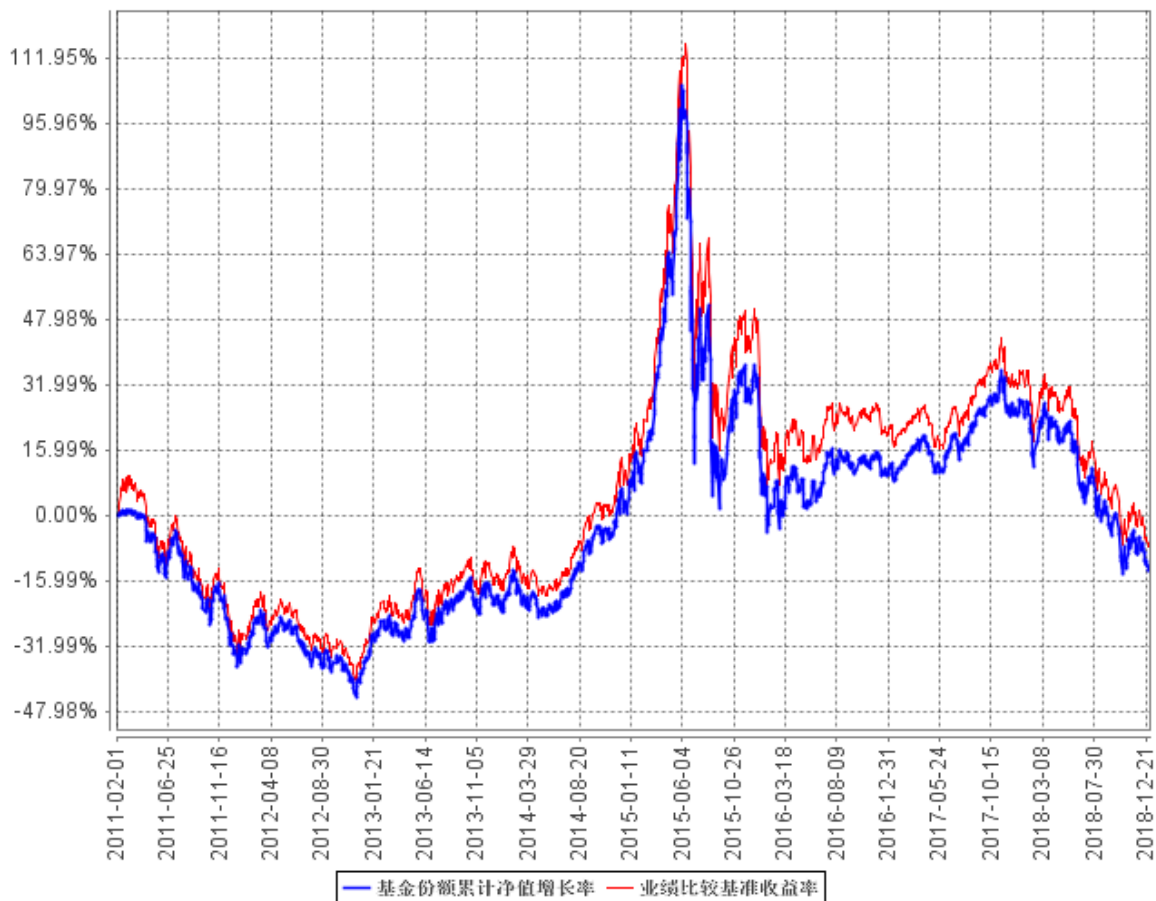
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-13.65%	1.74%	-13.87%	1.67%	0.22%	0.07%
过去六个月	-19.65%	1.56%	-19.18%	1.52%	-0.47%	0.04%
过去一年	-30.81%	1.44%	-29.71%	1.41%	-1.10%	0.03%
过去三年	-34.42%	1.36%	-35.84%	1.34%	1.42%	0.02%
过去五年	8.38%	1.74%	8.78%	1.68%	-0.40%	0.06%
自基金合同生效起至今	-13.30%	1.62%	-7.42%	1.59%	-5.88%	0.03%

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

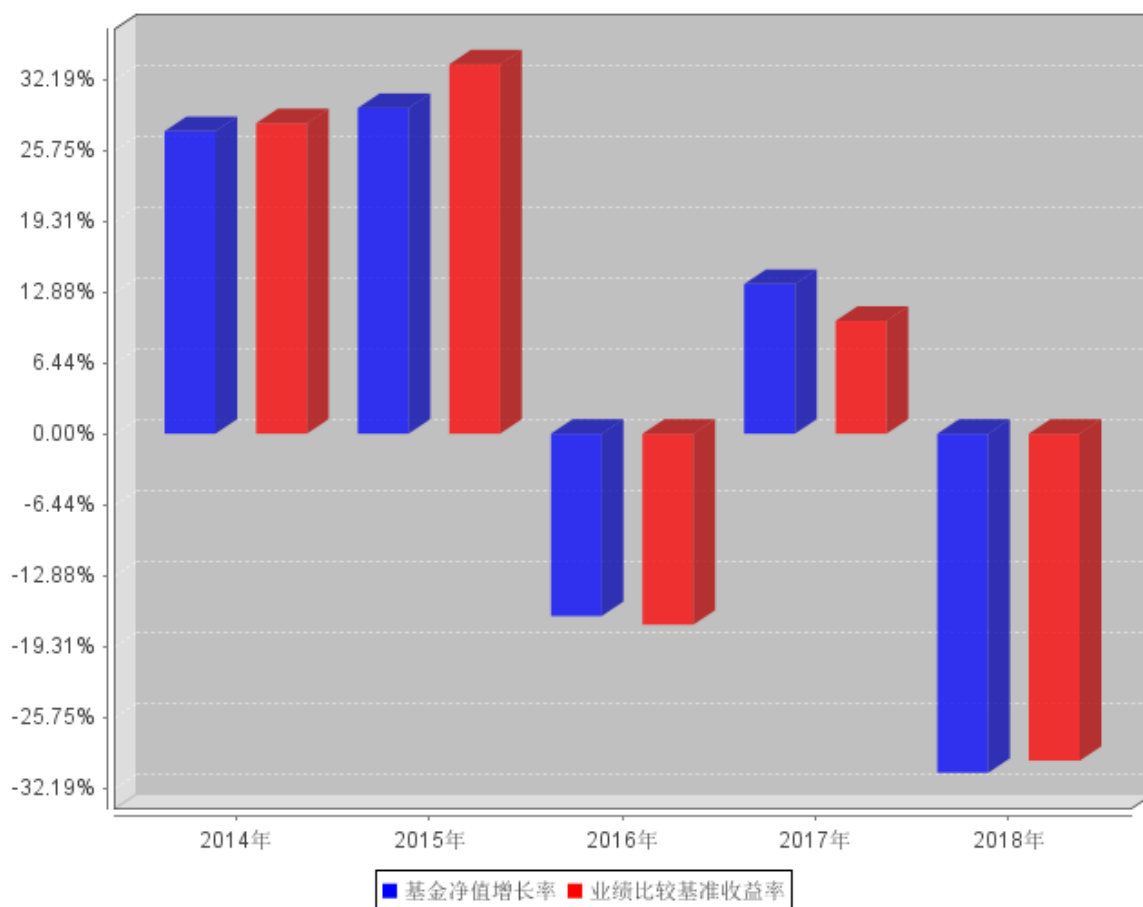
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

## §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 LOF（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		
周健	基金经理	2012 年 5 月 3 日	2018 年 12 月 13 日	12 年	周健，硕士，南开大学毕业。曾就职于海通证券；2011 年 5 月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研究策划部研究员、基金经理，现从事研究工作。其中，2012 年 10 月 27 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理，

					<p>2016 年 2 月 3 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2012 年 05 月 03 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴沪深 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）、2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月 11 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
朱冰兵	基金经理	2017 年 3 月 9 日	-	8 年	<p>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，</p>



					自 2017 年 3 月 9 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、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告日。

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

2018 年市场整体呈现单边大跌的极端走势，市场信心低迷，上证指数下跌 24.59%，沪深 300 指数下跌 25.31%，创业板指数下跌 28.65%，其中电子、有色、传媒等行业景气度边际下滑或者受到政策影响大的跌幅较大，旅游、银行、食品饮料、农业等基本面相对较好的有相对收益，另外 5G、猪等未来确定性高的主题表现较好。

2018 年受到去杠杆、中美贸易摩擦影响，PPI 在二季度冲高回落处于下行区间，11 月份工业企业利润增速变负，12 月份制造业 PMI 自 2016 年初以来首次跌破枯荣线，汽车、家电等销售呈现两位数的下滑。经济增速逐季下滑，企业盈利恶化超预期。融资环境的恶化、资本市场的快速下跌导致股权质押问题不断蔓延，可能引发严重的金融风险和经济问题。针对这些问题，政府肯定了民营企业的作用，并组织各类纾困基金，救助存在质押和流动性风险的优质民企；在四季度的政治局会议、中央经济工作会议上，政府迅速调整宏观经济政策，要求财政政策积极、货币政策宽松，会议将稳就业、稳经济放到重要位置。

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。坚持价值投资策略，从相对中长线周期来自下而上精选有核心竞争力、估值低、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 0.867 元；本报告期基金份额净值增长率为-30.81%，业

绩比较基准收益率为-29.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们认为经济仍有惯性下滑的趋势，但随着财政政策积极、货币政策宽松后，流动性将逐渐传导至实体经济并产生积极作用；并且美国货币政策走弱也给中国政策腾出空间。从中长期来看，中国 GDP 规模达到 90 万亿元，经济刺激政策效果边际减弱，人口红利消失，增长模式必须从投资驱动转向创新驱动、全要素驱动模式。我们观察到政府在通过基建稳经济的同时，正在加大力度减税降费、鼓励消费、鼓励创新，尤其是今年科创板的推出，有望加快新兴产业的供给侧改革，这些才是未来中国经济增长新的驱动力。

从市场来看，我们认为由于企业盈利下滑仍未见底，而市场预期已反应较为充分；目前 A 股整体估值较低，处于历史底部区间，因此继续大幅往下的风险不大。流动性宽松后，无风险收益率下行，利率下行有利于股票市场投资。中国相比成熟市场投资有很多投资机会，随着 MSCI 等指数纳入 A 股的权重不断提升，流入 A 股的外资将大幅增加，外资将逐渐成为白马股的边际定价者，其投资风格对市场影响进一步加深。中美贸易摩擦的缓和也有望减少外部干扰。因此市场整体将呈现波动性和结构性。风险在于中国经济下滑超预期，或者美国市场调整形成联动拖累。

我们长期看好消费和创新，捕捉行业的变化，努力挖掘出能够符合未来发展趋势、有竞争优势、能穿越周期的优质公司，给投资者好的回报。2019 年，我们认为高股息率股票、逆周期投资的行业、行业景气度拐点向上且业绩增长确定的公司有较好的投资机会。

#### 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。

#### **4.6.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配。

#### **4.7 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 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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遵规守信、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 审计报告

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了安永华明(2019)审字第 60469066\_B09 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: 东吴中证新兴产业指数证券投资基金

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,865,304.87	6,187,912.81
结算备付金		8,435.36	8,451.33
存出保证金		6,620.79	12,802.20
交易性金融资产	7.4.7.2	66,522,927.07	113,090,429.58
其中: 股票投资		66,522,927.07	113,090,429.58
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		268,344.24	235,012.71
应收利息	7.4.7.5	776.26	1,266.05
应收股利		-	-
应收申购款		14,207.95	69,811.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		70,686,616.54	119,605,686.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	88,388.84

应付赎回款		-	81,972.46
应付管理人报酬		62,393.73	101,687.39
应付托管费		9,359.07	15,253.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	27,939.00	77,279.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,000.00	100,026.78
负债合计		279,691.80	464,608.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	81,230,442.25	95,096,726.63
未分配利润	7.4.7.10	-10,823,517.51	24,044,351.59
所有者权益合计		70,406,924.74	119,141,078.22
负债和所有者权益总计		70,686,616.54	119,605,686.66

报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.867 元，基金份额总额 81,230,442.25 份。

## 7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-30,668,948.14	17,882,021.74
1.利息收入		38,166.43	58,668.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	38,166.43	58,668.78
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）		-8,851,160.88	13,070,845.87
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,937,342.29	12,217,649.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,086,181.41	853,196.44

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-21,865,183.90	4,721,444.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	9,230.21	31,062.88
<b>减：二、费用</b>		1,783,149.10	2,218,850.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	944,700.13	1,211,574.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	141,705.00	181,736.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	187,023.97	255,282.25
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	7.4.7.20	509,720.00	570,257.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-32,452,097.24	15,663,171.20
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-32,452,097.24	15,663,171.20

### 7.3 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：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）	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）	-	-32,452,097.24	-32,452,097.24
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）	-13,866,284.38	-2,415,771.86	-16,282,056.24
其中：1. 基金申购款	4,545,305.67	596,951.06	5,142,256.73
2. 基金赎回款	-18,411,590.05	-3,012,722.92	-21,424,312.97
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）	81,230,442.25	-10,823,517.51	70,406,924.74
项目	上年度可比期间 2017年1月1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、期初所有者权益（基金净值）	107,443,603.28	11,038,392.05	118,481,995.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,663,171.20	15,663,171.20
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）	-12,346,876.65	-2,657,211.66	-15,004,088.31
其中：1. 基金申购款	25,082,390.96	5,412,523.82	30,494,914.78
2. 基金赎回款	-37,429,267.61	-8,069,735.48	-45,499,003.09
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）	95,096,726.63	24,044,351.59	119,141,078.22

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	徐明	吴婷
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

#### 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〉》、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包括股票投资等；

#### (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

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

卖出股票于交易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交易日结转；

## (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/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费用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) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为八次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

(3) 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) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体和基金管理人网站公告。

### **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发展费附加的单位外）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
海澜集团有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 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 1 月 1 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	-	-	8,449,193.56	5.19%

##### 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

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。

#### 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1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	7,776.20	5.17%	-	-

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1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付 的管理费	944,700.13	1,211,574.48
其中：支付销售机构的 客户维护费	495,919.16	639,279.16

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。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	141,705.00		181,736.09	

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。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

本基金不收取销售服务费。

**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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 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
中国农业银行股份有限公司	3,865,304.87	37,043.14	6,187,912.81	57,700.85

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券

登记结算有限责任公司，2018 年度获得的利息收入为人民币 934.03 元(2017 年度：人民币 804.65 元)，2018 年末结算备付金余额为人民币 8,435.36 元(2017 年末：人民币 8,451.33 元)。

#### 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

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金本报告期末持有因认购新发/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

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	10.02	-	-	78,750	2,288,523.37	789,075.00	-

#### 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

### 7.4.10.1 公允价值

#### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 65,733,852.07 元，属于第二层次的余额为人民币 789,075.00 元，无属于第三层次余额。（于 2017 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 101,843,939.51 元，属于第二层次的余额为人民币 11,018,928.07 元，属于第三层次余额为人民币 227,562.00 元）。

##### 7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币 0.00 元，期初余额为人民币 227,562.00 元，本期减少人民币 227,562.00 元。

### 7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## §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	66,522,927.07	94.11
	其中：股票	66,522,927.07	94.11
7	银行存款和结算备付金合计	3,873,740.23	5.48
8	其他各项资产	289,949.24	0.41
9	合计	70,686,616.54	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
B	采矿业	1,319,180.00	1.87
C	制造业	47,551,766.93	67.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,229,880.00	3.17
E	建筑业	2,053,664.00	2.92
F	批发和零售业	1,348,048.28	1.91
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,344,203.26	10.43
L	租赁和商务服务业	626,075.20	0.89
M	科学研究和技术服务业	673,740.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	602,144.40	0.86
Q	卫生和社会工作	1,291,270.00	1.83
R	文化、体育和娱乐业	693,880.00	0.99
	合计	65,733,852.07	93.37

#### 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
C	制造业	789,075.00	1.12
	合计	789,075.00	1.12

### 8.2.3 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 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	600104	上汽集团	29,396	783,991.32	1.11
2	600674	川投能源	88,400	766,428.00	1.09
3	000625	长安汽车	115,815	763,220.85	1.08
4	601877	正泰电器	31,400	761,136.00	1.08
5	600660	福耀玻璃	33,200	756,296.00	1.07
6	600025	华能水电	239,400	754,110.00	1.07
7	600498	烽火通信	25,738	732,760.86	1.04
8	002624	完美世界	26,300	732,455.00	1.04
9	600482	中国动力	32,800	730,456.00	1.04
10	600522	中天科技	89,600	730,240.00	1.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

#### 8.3.2 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前五名股票投资明细

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	600485	信威集团	78,750	789,075.00	1.12

### 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	002602	世纪华通	1,563,206.00	1.31
2	603799	华友钴业	1,293,012.00	1.09
3	601360	三六零	1,238,625.00	1.04

4	600867	通化东宝	1,153,714.30	0.97
5	300124	汇川技术	1,098,144.00	0.92
6	300003	乐普医疗	1,074,236.23	0.90
7	300251	光线传媒	1,057,630.00	0.89
8	000786	北新建材	1,053,142.00	0.88
9	600271	航天信息	1,042,560.00	0.88
10	600516	方大炭素	1,011,233.00	0.85
11	300408	三环集团	1,004,817.00	0.84
12	600487	亨通光电	995,275.99	0.84
13	600588	用友网络	985,369.00	0.83
14	002044	美年健康	977,974.60	0.82
15	600528	中铁工业	958,208.00	0.80
16	002925	盈趣科技	953,743.20	0.80
17	300433	蓝思科技	948,673.83	0.80
18	300015	爱尔眼科	941,994.00	0.79
19	600674	川投能源	927,267.00	0.78
20	600025	华能水电	918,887.00	0.77

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	002007	华兰生物	1,430,108.44	1.20
2	000999	华润三九	1,341,853.48	1.13
3	300017	网宿科技	1,325,787.28	1.11
4	002179	中航光电	1,296,807.60	1.09
5	002366	台海核电	1,274,482.00	1.07
6	600309	万华化学	1,159,515.30	0.97
7	002475	立讯精密	1,144,836.00	0.96
8	000998	隆平高科	1,119,417.96	0.94
9	600436	片仔癀	1,103,154.00	0.93
10	002065	东华软件	1,100,095.23	0.92
11	600038	中直股份	1,092,060.25	0.92
12	002465	海格通信	1,087,305.28	0.91



13	002174	游族网络	1,082,906.96	0.91
14	600372	中航电子	1,059,026.39	0.89
15	600583	海油工程	1,056,055.34	0.89
16	300033	同花顺	1,030,879.00	0.87
17	601958	金钼股份	1,017,541.90	0.85
18	002841	视源股份	1,002,047.00	0.84
19	002195	二三四五	984,956.00	0.83
20	000738	航发控制	980,892.00	0.82

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	52,287,364.54
卖出股票收入（成交）总额	67,052,340.86

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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	6,620.79
2	应收证券清算款	268,344.24
4	应收利息	776.26
5	应收申购款	14,207.95
9	合计	289,949.24

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 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	信威集团	789,075.00	1.12	资产重组

### 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

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
3,330	24,393.53	1,251,587.53	1.54%	79,978,854.72	98.46%

### 9.2 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。

### 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、基金投资和研发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

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	95,096,726.63
本报告期期间基金总申购份额	4,545,305.67
减：本报告期期间基金总赎回份额	18,411,590.05
本报告期期末基金份额总额	81,230,442.25

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

本基金本报告期内管理人发生的重大人事变动如下：

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。

本基金本报告期内托管人发生的重大人事变动如下：

本报告期内, 本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

## 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所, 该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今, 本报告期内支付审计费 50000 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	
长江证券	1	36,617,134.83	30.79%	33,369.10	30.50%	-
兴业证券	1	33,956,255.05	28.56%	31,624.09	28.90%	-
申港证券	2	14,748,722.94	12.40%	13,727.69	12.55%	-
东方证券	1	11,903,015.27	10.01%	10,847.36	9.91%	-
首创证券	2	6,259,808.03	5.26%	5,722.80	5.23%	-
广发证券	1	5,128,556.67	4.31%	4,673.58	4.27%	-
中泰证券	2	4,592,737.65	3.86%	4,185.41	3.83%	-
华信证券	1	3,477,550.78	2.92%	3,238.64	2.96%	-
天风证券	2	2,230,675.54	1.88%	2,032.80	1.86%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

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

本报告期本基金新增交易单元 4 个，分别为申港证券、方正证券、川财证券和光大证券交易单元；退租交易单元 4 个，分别为为金元证券、国金证券、安信证券和中金公司交易单元。

## 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

## §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

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。

### 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