

东吴沪深 300 指数型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 23 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东吴沪深 300 指数
基金主代码	165806
交易代码	165806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 11 日
报告期末基金份额总额	6,870,283.72 份
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。
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	
下属分级基金的基金简称	东吴沪深 300 指数 A	东吴沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	165806	165810
报告期末下属分级基金的份额总额	6,870,283.72 份	0.00 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（2020年7月1日—2020年9月30日）	
	东吴沪深 300 指数 A	东吴沪深 300 指数 C
1. 本期已实现收益	537,272.17	-
2. 本期利润	945,217.08	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1366	-
4. 期末基金资产净值	9,323,814.54	-
5. 期末基金份额净值	1.3571	1.3571

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

东吴沪深 300 指数 A

阶段	净值增长率①	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	10.47%	1.57%	9.66%	1.53%	0.81%	0.04%
过去六个月	24.11%	1.28%	23.24%	1.26%	0.87%	0.02%
过去一年	18.03%	1.34%	19.27%	1.32%	-1.24%	0.02%
自基金合同生效起至今	24.96%	1.36%	30.72%	1.34%	-5.76%	0.02%

东吴沪深 300 指数 C

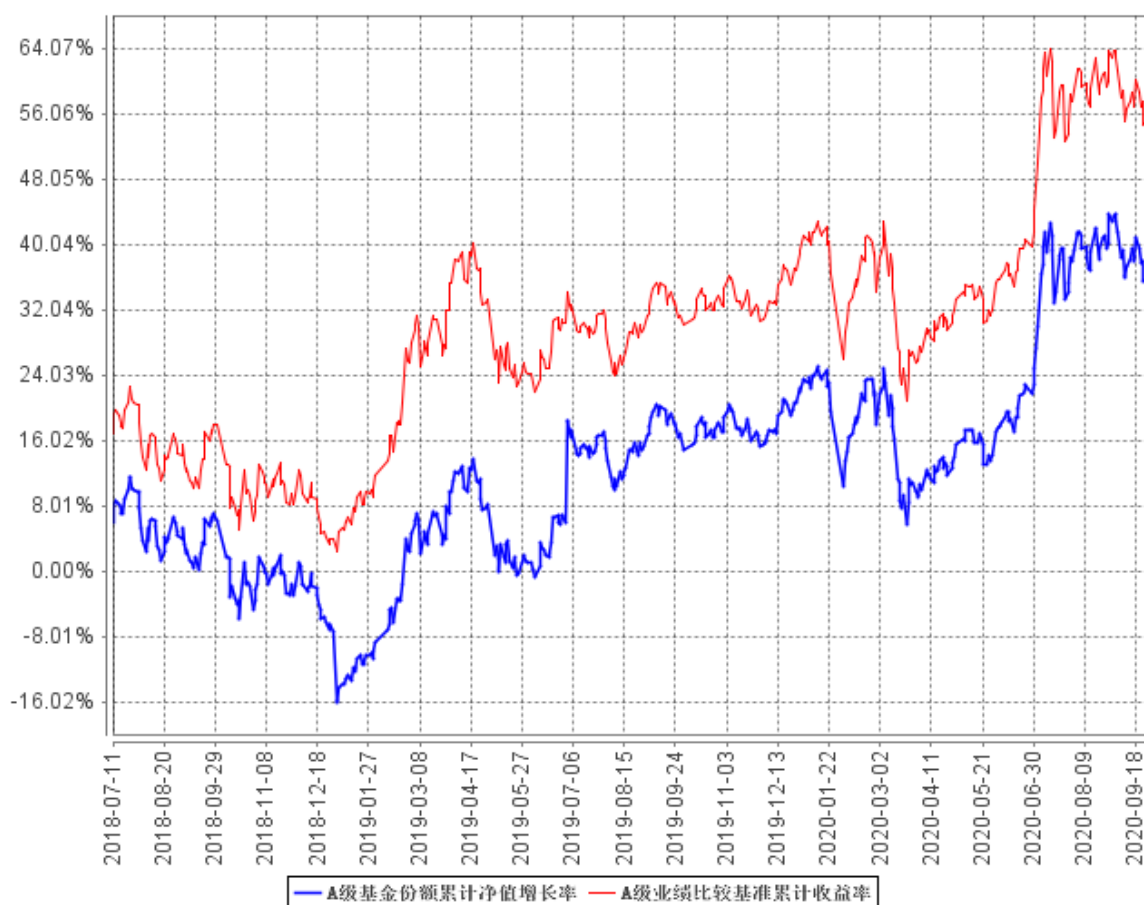
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	10.47%	1.57%	9.66%	1.53%	0.81%	0.04%
过去六个月	24.11%	1.28%	23.24%	1.26%	0.87%	0.02%
过去一年	18.03%	1.34%	19.27%	1.32%	-1.24%	0.02%
自基金合同生效起至今	24.96%	1.36%	30.72%	1.34%	-5.76%	0.02%

注：1、业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%；

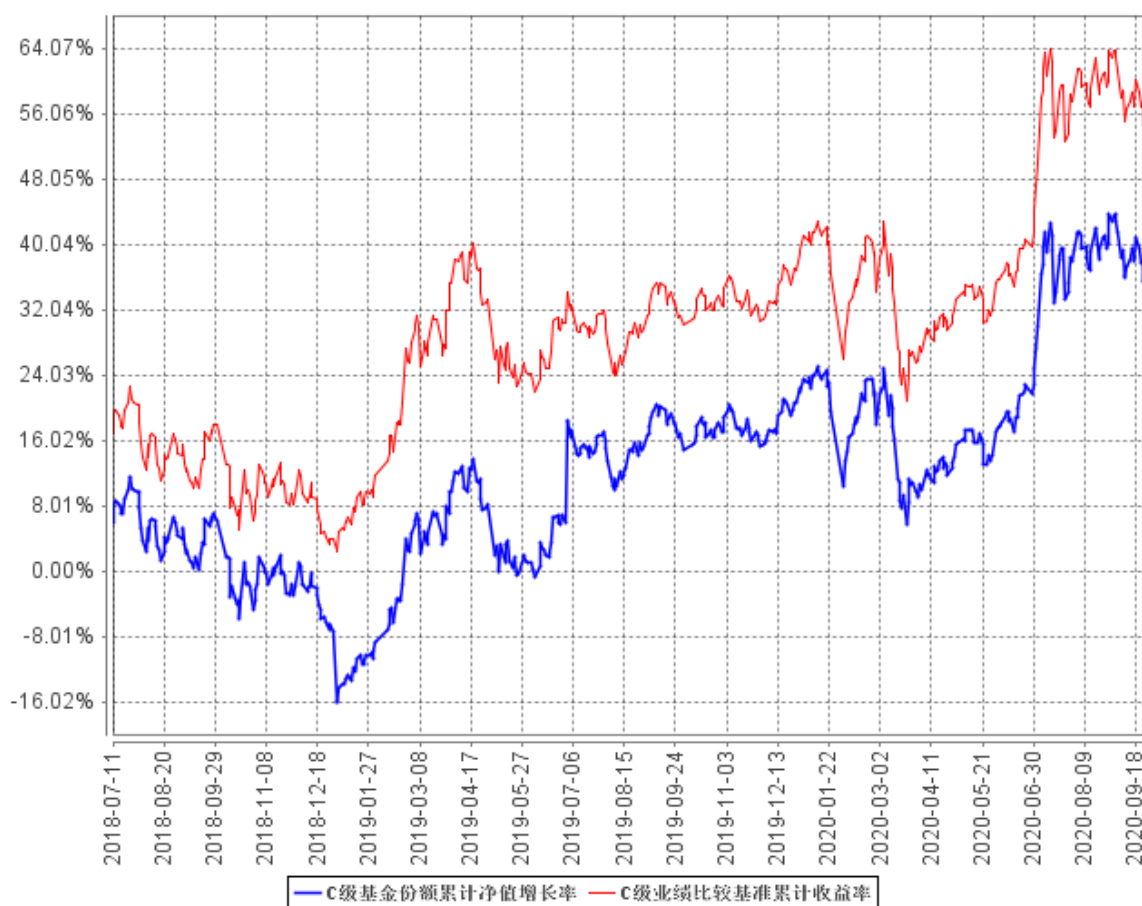
2、东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）变更而来，变更日期为 2018 年 7 月 11 日（即基金合同生效日）。

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



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、业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%；

2、东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）变更而来，变更日期为 2018 年 7 月 11 日（即基金合同生效日）。

§ 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		
周健	基金经理	2020 年 1 月 18 日	-	13 年	周健先生，中国籍，南开大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾就职于海通证券股份有限公司研究所，任金融工程分析师等职。2011 年 5 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。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，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，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，2012 年 05 月 03 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今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 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今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，2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今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。
--	--	--	--	--	----

注：1、此处的任职日期为对外公告之日。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，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

三季度，在国内基建、服务业和出口的带动下，经济逐步修复，但由于海外疫情仍然反复，国内经济政策比较稳健，经济复苏进度较为缓慢。股市方面，“基本面盈利向上+流动性以稳为主”决定了三季度 A 股延续结构性慢牛，结构重于整体。行业层面，前期疫情受损的休闲服务板块表现最好，其次国防军工、电气设备和汽车等板块，TMT、医药等高成长板块由于业绩波动、估值偏高，市场压力较大。沪深 300 指数基金所配置的板块偏向金融、食品饮料等行业，风格偏向价值，业绩稳定，在板块比较中相对靠前。报告期内，本基金采用复制指数配置的策略，努力控制仓位和成份股上的偏离，在日常的基金操作中积极应对申购赎回，尽量减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.3571 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.47%；截至本报告期末东吴沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.3571 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.47%；同期业绩比较基准收益率为 9.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2020 年 7 月 1 日至 2020 年 9 月 30 日连续二十个工作

日出现基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。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的情形。

§ 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	8,555,260.79	89.78
	其中：股票	8,555,260.79	89.78
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	903,379.99	9.48
8	其他资产	70,087.24	0.74
9	合计	9,528,728.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	62,900.00	0.67
B	采矿业	288,687.82	3.10
C	制造业	4,254,061.72	45.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,784.00	0.48
E	建筑业	83,224.75	0.89
F	批发和零售业	101,582.60	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	271,198.54	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	333,200.15	3.57
J	金融业	2,317,719.85	24.86
K	房地产业	310,086.52	3.33
L	租赁和商务服务业	149,399.00	1.60
M	科学研究和技术服务业	109,315.50	1.17

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	16,315.00	0.17
Q	卫生和社会工作	118,706.54	1.27
R	文化、体育和娱乐业	94,078.80	1.01
S	综合	-	-
	合计	8,555,260.79	91.76

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.3 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。

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

5.3.1 报告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

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	601318	中国平安	6,023	459,313.98	4.93
2	600519	贵州茅台	224	373,744.00	4.01
3	000333	美的集团	3,500	254,100.00	2.73
4	600036	招商银行	6,600	237,600.00	2.55
5	000858	五粮液	1,000	221,000.00	2.37
6	600276	恒瑞医药	2,180	195,807.60	2.10
7	002475	立讯精密	3,386	193,442.18	2.07
8	000725	京东方 A	28,048	137,715.68	1.48
9	600030	中信证券	4,500	135,135.00	1.45
10	600837	海通证券	9,300	131,595.00	1.41

5.3.2 报告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

本基金本报告期末未进行积极投资。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,484.35
2	应收证券清算款	8,489.58
3	应收股利	-
4	应收利息	87.48
5	应收申购款	60,025.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	70,087.24

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

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未进行积极投资。

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	东吴沪深 300 指数 A	东吴沪深 300 指数 C
报告期期初基金份额总额	7,211,911.97	-
报告期期间基金总申购份额	2,762,924.61	-
减:报告期期间基金总赎回份额	3,104,552.86	-
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	6,870,283.72	-

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；
2. 《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金托管协议》；
4. 《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》；
5. 《东吴沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》；
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
7. 报告期内东吴沪深 300 指数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。

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

2020 年 10 月 28 日