

# 东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>55</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴国企改革
场内简称	-
基金主代码	002159
交易代码	002159
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 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
报告期末基金份额总额	198,825,935.19 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于在国内上市的国企改革主题的上市公司，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	本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。在大类资产配置方面，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需及具体行业发展情况、证券市场估值水平等方面问题的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，通过公司数量化模型确定资产配置比例并动态地优化管理。
业绩比较基准	中证国有企业改革指数×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。

### 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	徐军	田青

	联系电话	021-50509888-8308	010-67595096
	电子邮箱	xuj@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
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		王炯	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,160,005.40
本期利润	-1,495,592.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0064
本期加权平均净值利润率	-0.64%
本期基金份额净值增长率	-0.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,909,085.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0146
期末基金资产净值	197,271,288.08
期末基金份额净值	0.992
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 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

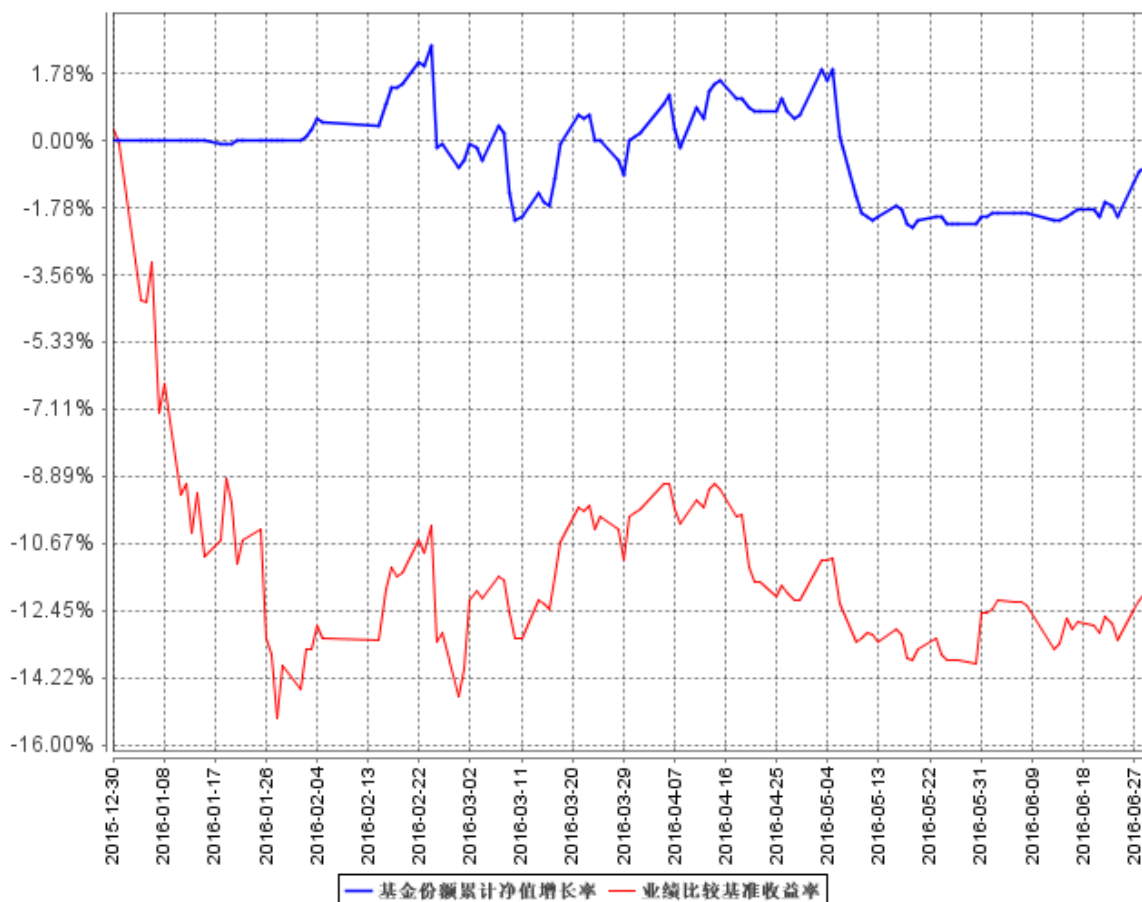
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.22%	0.26%	0.60%	0.55%	0.62%	-0.29%
过去三个月	-0.90%	0.47%	-2.64%	0.64%	1.74%	-0.17%
过去六个月	-0.80%	0.50%	-11.94%	1.17%	11.14%	-0.67%
自基金合同生效起至今	-0.80%	0.50%	-12.01%	1.16%	11.21%	-0.66%

注：基金业绩比较基准=中证国有企业改革指数×50% +中债综合指数×50%

### 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：注：1、东吴国企改革主题灵活配置混合型基金于 2015 年 12 月 30 日成立，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

2、中证国有企业改革指数×50% +中债综合指数×50%

## § 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—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上海兰生（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、资产管理和经中国证监会批准的其他业务。

公司自成立以来，始终坚守“待人忠、办事诚、以德兴业”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，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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着 23 只公募基金，27 只专户资产管理计划，137 只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。

2016 年，公司在成长股投资的传统优势基础上，引入了量化投资策略，在业内率先成立了绝对收益部，更加强化绝对收益理念。

经过多年积累和布局，公司已形成三大投研“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. 绝对收益首倡“用权益投资做绝对收益”的理念，利用量化模型进行择时和选股操作，严控回撤、优化收益；3. 固定收益回归稳健本源，兼顾流动性管理，为大类资产配置提供基础性产品。

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 2015 年度十大风云基金公司（《大众证券报》）、2014 年度最佳投资风格\*金蝉奖（东吴新经济股票型基金，《华夏理财》杂志）、2014 年度新财富最智慧投资机构（《新财富》杂志）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		
王立立	权益投资部副总经理兼研究策划部副总经理、本基金基金经理	2015 年 12 月 30 日	-	6 年	硕士，复旦大学世界经济专业。2010 年 7 月至 2010 年 12 月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员，自 2012 年 7 月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理，现任权益投资部副总经理兼研究策划部副总经理，其中自 2013 年 12 月 24 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 2014 年 6 月 14 日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资

					资基金基金经理、自 2015 年 2 月 6 日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理、自 2015 年 5 月 29 日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理,自 2015 年 12 月 30 日起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。
周健	本基金基金经理	2016 年 2 月 5 日	-	9 年	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,现任基金经理,自 2012 年 05 月 03 日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自 2013 年 6 月 5 日起担任东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理、自 2016 年 2 月 3 日起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、自 2016 年 2 月 5 日起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,自 2016 年 6 月 3 日起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,其中自 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。

注: 1、王立立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 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整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。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

从 2 季度数据来看，经济出现小幅回升，这是预期之中的。但是细看指标，数据显示出经济动能仍然不足。首先是民间投资仍然落后，房地产投资见高回落；其次是通缩造成实际利率仍然处于高位，对实体投资和居民消费形成抑制；第三是外部冲击不断，全球化受阻，大环境不利于整体增长。在上述因素的作用之下，股票市场出现大幅波动，但并未引发系统性风险，震荡市的特征尤为明显。报告期内，本基金主要依靠择时和选股策略，严格控制仓位，在日常的基金操作中积极应对申购赎回，并在个股配置上进行适度偏离，力争获得超额收益。

#### 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 0.992 元，累计净值为 0.992 元，报告期内份额净值增长率为-0.80%，同期业绩比较基准收益率为-11.94%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段经济和市场运行形势，个人认为经济和市场面临的风险要大于机会。短期看，信贷刺激之后，经济阶段性企稳，但是负面效应是资产价格出现泡沫化，以煤炭、钢铁为首的原

材料价格出现剧烈反弹，反而影响到供给侧改革的推进，投资渠道不畅导致政策空间被大大压缩。中长期来看，结构性改革的必要性不容置疑，但是考虑到短期稳增长的需求，又不能快速推进，这将拉长经济波动和出清的时间。市场方面，由于资金收益率快速下行，股市整体估值水平上升，资金的风险偏好却有下降的迹象，这体现在两个方面，一是创业板和成长股的量价萎靡，另一方面是市场开始更加关注消费品板块、高股息的类债券资产以及带有公用事业性质的 PPP 主题等，这种趋势对市场中长期走势偏负面。综上所述，在当前经济环境和股市估值水平下，短期还看不到风险爆发，所以市场上会有较多的结构性机会，但由于经济和股市的基本面问题，整体空间并不大。

国企改革概念的股票，从国企改革指数（399974）来看，100 只样本股票，平均市值 417.26 亿，流通市值 327.82 亿，（沪深 A 股总市值 160.35 亿，流通市值 125.84 亿）属于大中盘股，其流动性及日波动性较好，指数市盈率 19.52，市净率 1.90，在各分类指数中，国企改革指数估值较合理，属于低估蓝筹类，能很好地满足资金配置需求，二季度以来，国企改革指数成交活跃度得到较大提升。作为主题型概念型基金，国企改革类基金逐步得到市场的认可。2016 年随着市场恐慌情绪逐渐消退，2016 年上半年，沪指月线有 4 个月出现窄幅整理的星线，市场逐步进入正常运转模式，本基金将在控制回撤的前提下力求将收益做到最大，努力为投资者实现单位风险收益上的最优化。

#### 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，成员由公司副总经理、运营总监、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

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。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营总监、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、合规风控业务相关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。

## § 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

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遵规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金  
报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	117,514,772.12	345,995,055.51
结算备付金		2,552,312.43	-
存出保证金		199,866.34	-
交易性金融资产	6.4.7.2	65,105,105.75	-
其中：股票投资		65,105,105.75	-
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		13,943,780.72	-
应收利息	6.4.7.5	24,168.40	20,759.71
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		199,340,005.76	346,015,815.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,513,399.17	-
应付管理人报酬		244,829.29	14,219.54
应付托管费		40,804.88	2,369.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	175,523.69	-
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	94,160.65	-
负债合计		2,068,717.68	16,589.46
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	198,825,935.19	345,995,414.70

未分配利润	6.4.7.10	-1,554,647.11	3,811.06
所有者权益合计		197,271,288.08	345,999,225.76
负债和所有者权益总计		199,340,005.76	346,015,815.22

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.992 元，基金份额总额 198,825,935.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,592,184.27	-
1.利息收入		1,238,507.91	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	869,807.09	-
债券利息收入		2,736.62	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		365,964.20	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,902,355.87	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,093,806.41	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,995.85	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	193,446.39	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,664,412.45	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	591,619.78	-
<b>减：二、费用</b>		3,087,777.22	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,755,482.54	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	292,580.43	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	931,415.57	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	108,298.68	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,495,592.95	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填</b>		-1,495,592.95	-

列)			
----	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	345,995,414.70	3,811.06	345,999,225.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,495,592.95	-1,495,592.95
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）	-147,169,479.51	-62,865.22	-147,232,344.73
其中：1.基金申购款	21,526,939.85	377,104.43	21,904,044.28
2.基金赎回款	-168,696,419.36	-439,969.65	-169,136,389.01
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）	198,825,935.19	-1,554,647.11	197,271,288.08
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-

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：

<u>王炯</u>	<u>吕晖</u>	<u>沈静</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（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[2015]2574 号文《关于准予东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公开发发行募集，基金合同于 2015 年 12 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 345,995,414.70 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人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）、权证、股指期货、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产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）。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，投资于国企改革主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款、资产支持证券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

在法律法规有新规定的情况下，基金管理人在履行适当程序后，基金管理人可对上述比例做

适度调整。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部发布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的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的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

##### 6.4.3.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

##### 6.4.3.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

##### 6.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 6.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 6.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.3.6 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，且目前可执行该种法定权利，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。

#### 6.4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

#### 6.4.3.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.3.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 6.4.3.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同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也可按直线法计算。

#### 6.4.3.11 基金的收益分配政策

1、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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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；

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、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。

#### 6.4.3.12 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

##### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

#### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起营改增后，基金买卖股票、债券的差价收入免收增值税。

2、对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。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	117,514,772.12
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	117,514,772.12

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,440,693.30	65,105,105.75	1,664,412.45
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	63,440,693.30	65,105,105.75	1,664,412.45

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.6.4.2 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。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	22,929.90

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	1,148.60
应收债券利息	-
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	89.90
合计	24,168.40

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	166,145.39
银行间市场应付交易费用	9,378.30
合计	175,523.69

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,683.83
预提费用	88,476.82
合计	94,160.65

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	345,995,414.70	345,995,414.70
本期申购	21,526,939.85	21,526,939.85
本期赎回(以“-”号填列)	-168,696,419.36	-168,696,419.36



— 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	198,825,935.19	198,825,935.19

#### 6.4.6.10 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	3,811.06	-	3,811.06
本期利润	-3,160,005.40	1,664,412.45	-1,495,592.95
本期基金份额交易产生的变动数	247,108.88	-309,974.10	-62,865.22
其中：基金申购款	245,253.93	131,850.50	377,104.43
基金赎回款	1,854.95	-441,824.60	-439,969.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,909,085.46	1,354,438.35	-1,554,647.11

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	494,654.08
定期存款利息收入	361,733.35
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,207.50
其他	1,212.16
合计	869,807.09

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	509,674,355.92
减：卖出股票成本总额	511,768,162.33
买卖股票差价收入	-2,093,806.41

**6.4.6.13 债券投资收益****6.4.6.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,278,547.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,077,793.28
减：应收利息总额	202,749.73
买卖债券差价收入	-1,995.85

**6.4.6.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

**6.4.6.14 贵金属投资收益****6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.6.15 衍生工具收益****6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末未进行权证投资。

**6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

**6.4.6.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	193,446.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	193,446.39

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	1,664,412.45
——股票投资	1,664,412.45
——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	-
合计	1,664,412.45

**6.4.6.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	591,619.78
合计	591,619.78

**6.4.6.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	930,715.57
银行间市场交易费用	700.00
合计	931,415.57

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
审计费用	38,750.78	
信息披露费	49,726.04	
银行汇划费用	15,321.86	
帐户维护费	4,500.00	
合计	108,298.68	

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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、基金注册与过户登记人、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

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。

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	1,026,600,755.11	94.68%	-	-

#### 6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	1,013,500,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	271,630.08	83.62%	145,168.25	87.37%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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

#### 6.4.9.2 关联方报酬

##### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付	1,755,482.54	-

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	796,483.81	-

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	292,580.43	-

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期间基金管理人未持有本基金份额。

##### 6.4.9.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

#### 6.4.9.5 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
中国建设银行股份有限公司	117,514,772.12	494,654.08	-	-

**6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10 利润分配情况****6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.11 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.11.1 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,643	21,326.14	21,326.14	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

**6.4.11.2 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
002101	广东鸿图	2016年5月3日	重大资产重组	21.62	-	-	61,701	1,399,685.56	1,333,975.62	-
000619	海螺型材	2016年5月16日	重大资产重组	11.35	2016年7月13日	-	72,600	797,758.00	824,010.00	-
000757	浩物	2016	重大	10.56	-	-	38,800	394,775.00	409,728.00	-

	股份	年 3 月 29 日	资产 重组								
600511	国药 股份	2016 年 2 月 18 日	重大 资产 重组	27.42	2016 年 8 月 4 日	-	9,400	258,268.00	257,748.00	-	-
600764	中电 广通	2016 年 6 月 20 日	重大 资产 重组	26.89	-	-	4,800	98,006.85	129,072.00	-	-
600455	博通 股份	2016 年 5 月 5 日	重大 资产 重组	49.14	-	-	2,300	98,577.79	113,022.00	-	-
601611	中国 核建	2016 年 6 月 30 日	临时 停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	5,243	18,193.21	109,683.56	-	-
000948	南天 信息	2016 年 6 月 28 日	重大 事项 停牌	19.31	2016 年 7 月 12 日	-	1,200	21,268.72	23,172.00	-	-
002059	云南 旅游	2016 年 6 月 1 日	重大 事项 停牌	8.56	-	-	1,000	8,971.82	8,560.00	-	-

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、货币市场工具、股指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。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。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金通过灵活的资产配置，重点投资于国内上市的国企改革主题的上市公司，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。

本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股



相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整期货、股票、债券、现金等大类资产的配置。

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。

#### **6.4.12.2 信用风险**

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。报告期内，本基金持有的金融资产均未发生逾期与减值的情况。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。本基金的银行存款存放于本基金的托管行—中国建设银行股份有限公司。本基金认为与中国建设银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。本基金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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

#### **6.4.12.3 流动性风险**

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。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资产净值的 40%。

除卖出回购金融资产款合同约定到期日均为一个月以内计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	117,514,772.12	-	-	-	-	-	-117,514,772.12

清算备付金	2,552,312.43	-	-	-	-	-	2,552,312.43
存出保证金	199,866.34	-	-	-	-	-	199,866.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-65,105,105.75	65,105,105.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-13,943,780.72	13,943,780.72
应收利息	-	-	-	-	-	24,168.40	24,168.40
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	120,266,950.89	-	-	-	-	-79,073,054.87	199,340,005.76
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-1,513,399.17	1,513,399.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	244,829.29	244,829.29
应付托管费	-	-	-	-	-	40,804.88	40,804.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	175,523.69	175,523.69
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	94,160.65	94,160.65
负债总计	-	-	-	-	-	-2,068,717.68	2,068,717.68
利率敏感度缺口	120,266,950.89	-	-	-	-	-77,004,337.19	197,271,288.08
上年度末 2015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	345,995,055.51	-	-	-	-	-	-345,995,055.51
应收利息	-	-	-	-	-	20,759.71	20,759.71
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	345,995,055.51	-	-	-	-	20,759.71	346,015,815.22
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,219.54	14,219.54
应付托管费	-	-	-	-	-	2,369.92	2,369.92
负债总计	-	-	-	-	-	16,589.46	16,589.46
利率敏感度缺口	345,995,055.51	-	-	-	-	4,170.25	345,999,225.76

注：表中所示为本基金资产及负债的利率风险敞口，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

**6.4.12.4.2 外汇风险**

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.12.4.3 其他价格风险**

其他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除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

**6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	65,105,105.75	33.00	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	65,105,105.75	33.00	-	-

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，投资于国企改革主题的股票的比例

例不低于非现金基金资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款、资产支持证券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-473,451.09	-
	2. 业绩基准下跌 5%	-2,367,255.46	-
	3. 业绩基准下跌 10%	-4,734,510.91	-

注：报告期内，本基金 2016 年 beta 值为 0.24，该基金于 2015 年 12 月 30 日成立。

#### 6.4.13 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

### 7.1.1.1.1 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	65,105,105.75	32.66
	其中：股票	65,105,105.75	32.66
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	120,067,084.55	60.23
7	其他各项资产	14,167,815.46	7.11
8	合计	199,340,005.76	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	31,318.00	0.02
B	采矿业	1,050,575.00	0.53
C	制造业	44,454,049.11	22.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,388,090.74	3.24
F	批发和零售业	3,884,462.10	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	5,297,204.23	2.69
H	住宿和餐饮业	160,326.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	743,465.05	0.38
J	金融业	616,895.00	0.31
K	房地产业	93,897.86	0.05
L	租赁和商务服务业	1,313,883.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	415,091.66	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	8,560.00	0.00
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	79,462.00	0.04
S	综合	567,826.00	0.29
	合计	65,105,105.75	33.00

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 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

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	000026	飞亚达 A	166,145	1,899,037.35	0.96
2	600612	老凤祥	46,048	1,881,060.80	0.95
3	002678	珠江钢琴	151,700	1,861,359.00	0.94
4	601668	中国建筑	329,600	1,753,472.00	0.89
5	000901	航天科技	39,200	1,573,880.00	0.80
6	600135	乐凯胶片	84,300	1,434,786.00	0.73
7	002338	奥普光电	22,702	1,395,037.90	0.71
8	002101	广东鸿图	61,701	1,333,975.62	0.68
9	600651	飞乐音响	103,600	1,311,576.00	0.66
10	600343	航天动力	54,100	1,286,498.00	0.65
11	000988	华工科技	62,900	1,261,145.00	0.64
12	300114	中航电测	42,300	1,260,540.00	0.64
13	600057	象屿股份	119,700	1,230,516.00	0.62
14	600677	XD 航天通	66,595	1,228,677.75	0.62
15	600118	中国卫星	36,335	1,220,856.00	0.62
16	002243	通产丽星	92,700	1,181,925.00	0.60
17	603128	华贸物流	116,453	1,142,403.93	0.58
18	002014	永新股份	70,600	1,126,070.00	0.57
19	600270	外运发展	61,200	1,070,388.00	0.54
20	600119	长江投资	69,900	1,061,781.00	0.54
21	002049	紫光国芯	23,074	1,014,102.30	0.51
22	600787	中储股份	136,400	1,013,452.00	0.51
23	002056	横店东磁	59,500	1,011,500.00	0.51
24	600676	交运股份	113,010	1,009,179.30	0.51
25	600150	中国船舶	37,900	843,654.00	0.43
26	600685	中船防务	33,032	837,691.52	0.42
27	000619	海螺型材	72,600	824,010.00	0.42
28	601800	XD 中国交	68,300	719,199.00	0.36
29	600558	大西洋	152,200	692,510.00	0.35
30	601968	宝钢包装	67,300	690,498.00	0.35
31	000039	中集集团	45,900	650,403.00	0.33
32	600992	贵绳股份	52,398	647,115.30	0.33
33	601369	陕鼓动力	95,700	610,566.00	0.31
34	300140	启源装备	26,531	588,988.20	0.30
35	601633	长城汽车	69,097	583,178.68	0.30
36	000550	江铃汽车	23,500	572,460.00	0.29
37	600104	上汽集团	28,100	570,149.00	0.29

38	000625	长安汽车	40,500	553,635.00	0.28
39	600820	隧道股份	64,100	537,799.00	0.27
40	002060	粤水电	77,200	530,364.00	0.27
41	600192	长城电工	49,200	527,424.00	0.27
42	600039	四川路桥	133,000	524,020.00	0.27
43	600973	宝胜股份	65,444	515,698.72	0.26
44	002307	北新路桥	65,400	513,390.00	0.26
45	600284	浦东建设	48,500	506,340.00	0.26
46	600218	全柴动力	44,200	451,724.00	0.23
47	000811	烟台冰轮	39,000	437,580.00	0.22
48	000777	中核科技	18,400	433,504.00	0.22
49	300161	华中数控	14,100	432,165.00	0.22
50	600960	渤海活塞	42,100	422,684.00	0.21
51	300470	日机密封	4,300	418,476.00	0.21
52	000530	大冷股份	39,108	416,891.28	0.21
53	000757	浩物股份	38,800	409,728.00	0.21
54	000868	安凯客车	51,800	394,198.00	0.20
55	600686	金龙汽车	25,600	377,088.00	0.19
56	000701	厦门信达	21,100	371,993.00	0.19
57	000733	振华科技	16,200	364,500.00	0.18
58	600326	西藏天路	44,499	356,881.98	0.18
59	000532	力合股份	19,500	354,120.00	0.18
60	002116	中国海诚	23,300	346,238.00	0.18
61	000823	超声电子	34,200	342,000.00	0.17
62	600841	上柴股份	23,600	329,692.00	0.17
63	600068	XD 葛洲坝	56,100	326,502.00	0.17
64	601899	紫金矿业	91,700	309,029.00	0.16
65	600502	安徽水利	41,400	305,118.00	0.15
66	600990	四创电子	3,100	268,739.00	0.14
67	600418	江淮汽车	20,900	265,012.00	0.13
68	600184	光电股份	11,700	264,888.00	0.13
69	600511	国药股份	9,400	257,748.00	0.13
70	600562	国睿科技	7,200	246,888.00	0.13
71	601727	上海电气	31,600	238,896.00	0.12
72	600547	山东黄金	5,900	229,569.00	0.12
73	000922	佳电股份	22,800	221,160.00	0.11
74	000568	泸州老窖	7,100	210,870.00	0.11
75	600416	湘电股份	16,900	210,743.00	0.11
76	600151	航天机电	18,600	210,180.00	0.11



77	600268	国电南自	26,359	199,801.22	0.10
78	000400	许继电气	12,700	196,088.00	0.10
79	600468	百利电气	13,500	191,025.00	0.10
80	600312	平高电气	11,400	178,524.00	0.09
81	600517	置信电气	18,700	177,837.00	0.09
82	600435	北方导航	13,200	175,692.00	0.09
83	600006	XD 东风汽	19,800	175,626.00	0.09
84	601179	中国西电	33,900	171,873.00	0.09
85	000049	德赛电池	3,900	163,566.00	0.08
86	002179	中航光电	3,700	160,284.00	0.08
87	002025	航天电器	6,300	155,547.00	0.08
88	600060	海信电器	8,700	153,816.00	0.08
89	000957	中通客车	3,100	140,740.00	0.07
90	600702	沱牌舍得	5,400	136,296.00	0.07
91	600764	中电广通	4,800	129,072.00	0.07
92	600698	湖南天雁	21,800	129,056.00	0.07
93	002114	罗平锌电	4,700	128,122.00	0.06
94	600489	中金黄金	11,300	127,012.00	0.06
95	000813	天山纺织	10,400	126,776.00	0.06
96	601069	西部黄金	5,400	125,334.00	0.06
97	000783	长江证券	10,800	125,280.00	0.06
98	002598	山东章鼓	10,500	124,950.00	0.06
99	000903	云内动力	15,500	124,465.00	0.06
100	600197	伊力特	8,200	123,328.00	0.06
101	600961	株冶集团	12,100	123,299.00	0.06
102	600199	金种子酒	11,000	122,100.00	0.06
103	600362	江西铜业	9,000	121,320.00	0.06
104	000060	中金岭南	11,600	120,988.00	0.06
105	600523	贵航股份	6,500	120,770.00	0.06
106	000858	五粮液	3,700	120,361.00	0.06
107	000630	铜陵有色	47,000	119,380.00	0.06
108	600531	豫光金铅	14,200	118,570.00	0.06
109	000807	云铝股份	18,100	118,555.00	0.06
110	600480	凌云股份	8,400	118,440.00	0.06
111	000596	古井贡酒	2,400	115,080.00	0.06
112	603026	石大胜华	2,700	113,724.00	0.06
113	600455	博通股份	2,300	113,022.00	0.06
114	000581	威孚高科	5,600	112,896.00	0.06
115	600081	东风科技	6,900	111,573.00	0.06

116	000030	富奥股份	15,500	111,135.00	0.06
117	002736	国信证券	6,400	110,400.00	0.06
118	601611	中国核建	5,243	109,683.56	0.06
119	600482	中国动力	3,300	108,141.00	0.05
120	002304	洋河股份	1,500	107,880.00	0.05
121	300034	钢研高纳	4,800	106,080.00	0.05
122	002673	西部证券	4,100	106,026.00	0.05
123	000751	锌业股份	19,000	105,070.00	0.05
124	600470	六国化工	13,700	102,887.00	0.05
125	601198	东兴证券	4,200	102,648.00	0.05
126	600741	华域汽车	7,300	102,273.00	0.05
127	000792	盐湖股份	4,800	101,280.00	0.05
128	600458	时代新材	6,500	101,270.00	0.05
129	600141	兴发集团	8,600	99,072.00	0.05
130	002080	中材科技	4,900	98,392.00	0.05
131	600731	湖南海利	9,600	96,480.00	0.05
132	600486	扬农化工	3,500	95,900.00	0.05
133	000801	四川九洲	7,700	94,864.00	0.05
134	000758	中色股份	12,200	94,550.00	0.05
135	600096	云天化	9,800	91,140.00	0.05
136	000016	深康佳A	18,900	90,909.00	0.05
137	601186	中国铁建	8,500	84,660.00	0.04
138	002400	省广股份	5,900	83,367.00	0.04
139	000721	西安饮食	11,400	81,966.00	0.04
140	600088	中视传媒	3,350	79,462.00	0.04
141	600805	悦达投资	9,100	78,988.00	0.04
142	002186	全聚德	4,000	78,360.00	0.04
143	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
144	002643	万润股份	1,500	76,320.00	0.04
145	600845	宝信软件	3,300	73,623.00	0.04
146	600386	北巴传媒	3,900	72,774.00	0.04
147	002401	中海科技	3,800	69,692.00	0.04
148	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
149	601127	小康股份	2,605	62,181.35	0.03
150	600536	中国软件	2,400	59,808.00	0.03
151	600718	东软集团	3,200	58,624.00	0.03
152	002268	卫士通	1,500	53,610.00	0.03
153	002368	太极股份	1,500	53,295.00	0.03
154	600756	浪潮软件	1,700	51,170.00	0.03

155	002152	广电运通	3,100	50,964.00	0.03
156	300212	易华录	1,700	50,609.00	0.03
157	601901	方正证券	6,600	50,556.00	0.03
158	601211	国泰君安	2,800	49,812.00	0.03
159	600189	吉林森工	4,300	48,719.00	0.02
160	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
161	600549	厦门钨业	1,300	38,623.00	0.02
162	601958	金铂股份	4,700	38,305.00	0.02
163	000776	广发证券	2,200	36,872.00	0.02
164	000663	永安林业	2,792	35,960.96	0.02
165	600958	东方证券	2,100	35,301.00	0.02
166	300518	盛讯达	741	34,715.85	0.02
167	600529	山东药玻	1,900	33,459.00	0.02
168	002230	科大讯飞	1,000	32,850.00	0.02
169	600111	北方稀土	2,400	31,944.00	0.02
170	600198	大唐电信	1,600	31,808.00	0.02
171	600498	烽火通信	1,300	31,564.00	0.02
172	002679	福建金森	1,400	31,318.00	0.02
173	000032	深桑达 A	2,000	30,580.00	0.02
174	603698	航天工程	1,074	29,470.56	0.01
175	600667	太极实业	2,800	27,972.00	0.01
176	603019	中科曙光	700	27,874.00	0.01
177	000561	烽火电子	2,400	26,688.00	0.01
178	600850	华东电脑	910	26,107.90	0.01
179	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
180	600463	空港股份	1,805	23,681.60	0.01
181	600648	外高桥	1,200	23,652.00	0.01
182	600064	南京高科	1,567	23,426.65	0.01
183	000948	南天信息	1,200	23,172.00	0.01
184	601117	中国化学	4,100	22,673.00	0.01
185	600895	张江高科	1,200	21,696.00	0.01
186	601966	玲珑轮胎	1,643	21,326.14	0.01
187	603958	哈森股份	1,455	21,097.50	0.01
188	002077	大港股份	948	21,045.60	0.01
189	000066	长城电脑	1,600	20,400.00	0.01
190	000928	中钢国际	1,600	20,128.00	0.01
191	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
192	600604	市北高新	825	19,800.00	0.01
193	002051	中工国际	980	19,276.60	0.01

194	601226	华电重工	2,100	19,257.00	0.01
195	600271	航天信息	800	19,040.00	0.01
196	000938	紫光股份	300	18,264.00	0.01
197	300330	华虹计通	1,000	17,810.00	0.01
198	002376	新北洋	1,300	17,368.00	0.01
199	000748	长城信息	800	15,696.00	0.01
200	601618	中国中冶	4,200	15,498.00	0.01
201	600639	浦东金桥	600	14,988.00	0.01
202	600658	电子城	1,417	14,637.61	0.01
203	600970	中材国际	2,300	14,490.00	0.01
204	000977	浪潮信息	600	14,070.00	0.01
205	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
206	600456	宝钛股份	600	12,072.00	0.01
207	600587	新华医疗	499	11,521.91	0.01
208	600248	延长化建	1,680	10,248.00	0.01
209	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
210	002140	东华科技	600	9,156.00	0.00
211	002059	云南旅游	1,000	8,560.00	0.00
212	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
213	000050	深天马 A	228	4,758.36	0.00
214	002100	天康生物	190	1,708.10	0.00
215	000725	京东方 A	300	693.00	0.00

## 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	002321	华英农业	6,136,064.00	1.77
2	601336	新华保险	5,874,558.00	1.70
3	601628	中国人寿	5,351,189.25	1.55
4	300106	西部牧业	5,109,446.29	1.48
5	000762	西藏矿业	5,087,466.10	1.47
6	601668	中国建筑	5,060,727.00	1.46
7	601857	中国石油	5,043,734.00	1.46
8	000702	正虹科技	5,005,950.56	1.45

9	002100	天康生物	4,999,884.27	1.45
10	600150	中国船舶	4,945,482.00	1.43
11	600685	XD 中船防	4,916,574.52	1.42
12	601601	中国太保	4,842,662.87	1.40
13	000721	西安饮食	4,744,037.60	1.37
14	002186	全聚德	4,610,239.27	1.33
15	600343	航天动力	4,609,303.00	1.33
16	600677	航天通信	4,595,546.26	1.33
17	600118	中国卫星	4,567,104.22	1.32
18	000698	沈阳化工	4,085,369.00	1.18
19	600549	厦门钨业	4,077,912.00	1.18
20	600688	上海石化	4,077,196.14	1.18

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	002321	华英农业	6,264,800.60	1.81
2	601336	新华保险	5,911,587.97	1.71
3	000702	正虹科技	5,508,763.88	1.59
4	000762	西藏矿业	5,455,481.00	1.58
5	601628	中国人寿	5,268,627.90	1.52
6	300106	西部牧业	5,110,825.91	1.48
7	601857	中国石油	5,050,674.25	1.46
8	002100	天康生物	4,953,254.54	1.43
9	601601	中国太保	4,822,927.48	1.39
10	000721	西安饮食	4,769,203.72	1.38
11	002186	全聚德	4,485,623.85	1.30
12	000698	沈阳化工	4,113,253.46	1.19
13	600150	中国船舶	4,098,937.27	1.18
14	000096	广聚能源	4,018,718.15	1.16
15	600685	XD 中船防	4,007,121.50	1.16
16	600688	上海石化	3,960,394.00	1.14
17	600028	中国石化	3,955,660.00	1.14
18	600549	厦门钨业	3,866,037.00	1.12

19	600111	北方稀土	3,767,837.00	1.09
20	600313	农发种业	3,592,637.51	1.04

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	574,574,791.25
卖出股票收入（成交）总额	509,674,355.92

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持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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持有国债期货。

### 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

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	199,866.34
2	应收证券清算款	13,943,780.72
3	应收股利	-
4	应收利息	24,168.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,167,815.46

### 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

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	002101	广东鸿图	1,333,975.62	0.68	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
1,702	116,819.00	44,627,381.89	22.45%	154,198,553.30	77.55%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	20,844.26	0.0105%

### 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（2015年12月30日）基金份额总额	345,995,414.70
本报告期期初基金份额总额	345,995,414.70
本报告期基金总申购份额	21,526,939.85
减：本报告期基金总赎回份额	168,696,419.36
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	198,825,935.19

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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

- 1、2016 年 1 月 16 日，吴永敏先生因退休不再担任公司董事长，由范力先生担任公司董事长。
- 2、2016 年 1 月 16 日，任少华先生因工作调动辞去公司总经理职务，由王炯先生担任公司总经理，同时王炯先生辞去其所担任的公司副总经理职务。
- 3、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。

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。

### 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相关诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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

本基金本报告期内聘用天衡会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金会计师事务所。

### 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

本基金本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东吴证券	2	1,026,600,755.11	94.68%	271,630.08	83.62%	-
兴业证券	1	34,629,533.06	3.19%	32,250.57	9.93%	-
海通证券	2	23,018,859.00	2.12%	20,977.14	6.46%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
天风证券	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

本基金本报告期新增 2 个交易单元为东吴证券 2 个，新增 1 个交易单元为兴业证券，新增 2 个交易单元为海通证券，新增 2 个交易单元为恒泰证券，新增 1 个交易单元为招商证券，新增 1 个交易单元为国信证券，新增 1 个交易单元为平安证券，新增 1 个交易单元为中银国际，新增 1 个交易单元为天风证券。

## 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

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
东吴证券	-	-	1,013,500,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

## 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关于旗下部分基金参加苏州银行股份有限公司申购及定期定额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	2016年1月4日
2	东吴基金管理有限公司管理的基金 2015 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	2016年1月4日
3	东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年1月16日
4	东吴基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年1月16日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年1月21日
6	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石投资管理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	2016年1月21日
7	东吴基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证	2016年1月21日

	基金新增上海联泰资产管理有限 公司为代销机构并推出定期定额 业务及转换业务的公告	券报、证券时报、证 券日报、公司网站	
8	东吴基金管理有限公司关于参加 上海联泰资产管理有限公司费率 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	2016 年 1 月 21 日
9	东吴基金管理有限公司关于东吴 国企改革主题灵活配置混合型证 券投资基金开放日常申购、赎回、 转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、公司网 站	2016 年 1 月 29 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下 东吴国企改革主题灵活配置混合 型证券投资基金参加部分代销机 构网上交易和定期定额投资申购 费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网 站	2016 年 1 月 29 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下 东吴国企改革主题灵活配置混合 型证券投资基金在公司直销柜台 开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网 站	2016 年 1 月 29 日
12	东吴基金管理有限公司关于公司 法定代表人变更公告	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）	2016 年 2 月 3 日
13	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变更公 告	中国证券报、公司网 站	2016 年 2 月 5 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下 部分基金新增中经北证（北京）	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证	2016 年 2 月 19 日

	资产管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	券日报、公司网站	
15	东吴基金管理有限公司关于参加中经北证（北京）资产管理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	2016 年 2 月 19 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 3 月 22 日
17	东吴基金管理有限公司关于参加北京钱景财富投资管理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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 3 月 22 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 3 月 25 日
19	东吴基金管理有限公司关于参加珠海盈米财富管理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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 3 月 25 日
20	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2016 年 4 月 22 日

21	东吴基金管理有限公司关于公司副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年5月4日
22	东吴基金管理有限公司关于网上交易系统招商银行支付渠道费率优惠调整的公告	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）	2016年5月24日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司转换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	2016年6月1日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年6月2日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得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）	2016年6月8日
26	东吴基金管理有限公司关于参加上海利得基金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、深交所（巨潮资讯网）	2016年6月8日
27	东吴基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证	2016年6月13日

	部分基金开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	
28	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金延迟参与开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	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）	2016 年 6 月 14 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告	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）	2016 年 6 月 29 日
30	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	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）	2016 年 6 月 30 日

## § 11 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国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

- 2、《东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴国企改革主题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、报告期内东吴国企改革主题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。

## 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

## 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  
2016年8月25日