

东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：江苏银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月二十七日

§ 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 6 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴安鑫量化
场内简称	-
基金主代码	002561
交易代码	002561
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	2016年6月3日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,898,922.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化策略进行选股和择时，控制风险，追求持续的资产增值。
投资策略	本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略，进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损，另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合，以期投资者带来稳定收益。
业绩比较基准	65%×中证 800 指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率
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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	王凯宁
	联系电话	021-50509888-8308	025-58587606
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	wangkaining@jsbchin.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95319

传真	021-50509888-8211	025-58588115
----	-------------------	--------------

注：基金管理人于 2016 年 2 月 3 日发布法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为王炯先生。

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	2016 年 6 月 3 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-541,903.27	-	-
本期利润	-910,556.93	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0098	-	-
本期基金份额净值增长率	-2.60%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0261	-	-
期末基金资产净值	32,039,641.26	-	-
期末基金份额净值	0.974	-	-

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

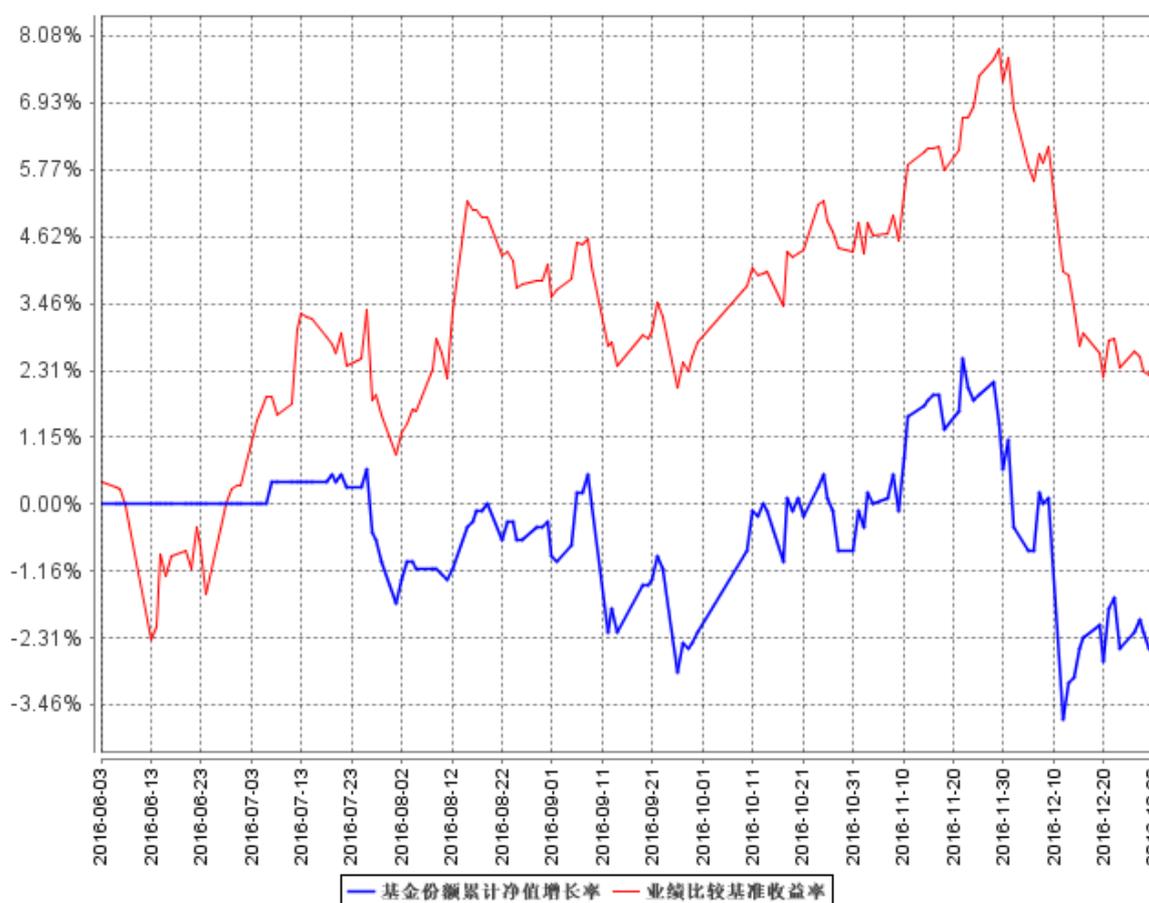
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.41%	0.74%	-0.22%	0.48%	-0.19%	0.26%
过去六个月	-2.60%	0.62%	2.20%	0.51%	-4.80%	0.11%
自基金合同生效起至今	-2.60%	0.58%	2.50%	0.55%	-5.10%	0.03%

注：业绩比较基准=65%×中证 800 指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率

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

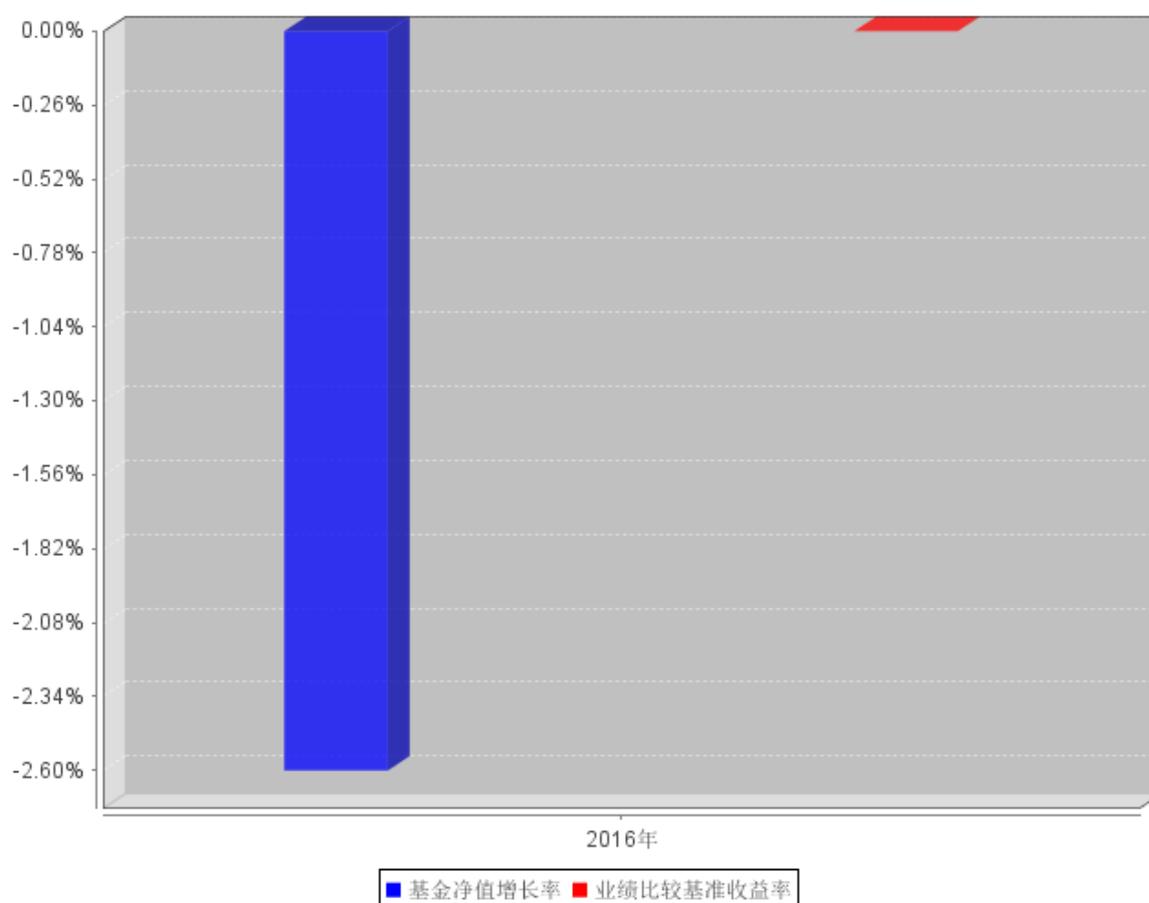


注：1. 本基金业绩比较基准=65%×中证 800 指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率

2. 本基金于 2016 年 6 月 3 日成立，截至本报告期末已完成建仓，本基金各项资产配置比例符合合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：本基金于 2016 年 6 月 3 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 日获证监基金字[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，尤其在公募及专户领域大刀阔斧地进行了事业部制改革和平台化战略尝试，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 2016 年 12 月 31 日，公司整体资产管理规模为 631.46 亿元，其中公募基金 148.47 亿元，专户业务 101.51 亿元，子公司 381.48 亿元；旗下管理着 25 只公募基金，33 只存续专户资产管理计划，101 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。

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，谋求穿越牛熊的正回报。目前已发行多只量化公募产品，其中东吴安盈量化基金、东吴安鑫量化基金为“量化策略+全市场选股”；东吴智慧医疗基金为“量化策略+热门主题”。从实战检验角度看，该系列基金经受住了市场反复震荡的考验，尤其在严控回撤、优化收益方面成效显著，初步实现了“下跌时回撤小，上涨时不掉队”的目标。

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。

2016 年，公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券 2016 年基金公司固定收益投资能力排行榜显示，东吴基金固收团队以 3.81%的综合收益率，位列 85 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 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）、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		
秦斌	本基金基金经理	2016 年 7 月 7 日	-	7.5 年	硕士，2009 年 07 月至 2015 年 6 月就职于东吴证券股份有限公司，历任研究所金融工程分析师、投资总部数量化与衍生品交易研究

					<p>员,2015年7月加入东吴基金管理有限公司,曾任研究策划部研究员、基金经理助理,现任基金经理,其中自2016年7月7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、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2016年10月18日起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>
周健	本基金基金经理	2016年6月3日	-	10年	<p>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,自2016年8月11日起担任东吴智慧医疗量</p>

					化策略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、周健为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金合同生效日，秦斌的任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金存在连续二十个交易日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在拟定相关应对方案，除此之外，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，本着诚实守信、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，公司根据证监会 2011 年发布的《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。

4.3.3 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

2016 年证券市场以熔断开场，以股债汇共振下跌收官，1 月 A 股触发熔断，上证指数下跌-12.31%，而创业板和中小板指数跌幅分别为-27.71%、-22.89%，跌幅远超上证指数。从行业表现看，以白酒为代表的消费类行业以及以煤炭、钢铁、化工、建筑为代表的周期型行业表现要强于以 TMT、医疗服务为代表的成长股，申万 28 个一级行业仅食品饮料和建筑材料全年收涨，而传媒、计算机全年跌幅超 30%。

东吴安鑫量化基金根据量化择时体系选择入场时机，因为发行档期躲过了 1 月份市场熔断的危险，但仓位偏低，错过了市场反弹机会，但随着择时体系重新进入风险收益比可观区域，逐步加大仓位，配置方向基于量化选股体系，按策略进行。

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 0.974 元，累计净值 0.974 元；本报告期份额净值增长率-2.60%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年主要国家国债收益率上半年趋势下行，下半年由于主要经济体经济数据普遍好于预期，以及特朗普上台，国债收益率从 9 月开始逐步走高。大宗商品方面，金银价格先涨后跌，能源价格持续回升，布伦特原油全年涨幅为 51%，大宗金属价格普涨，锌价全年上涨 60%，铜、铝、铅、镍等金属全年震荡走高，涨幅均超 10%，受益于中国大宗商品需求回暖等原因，BDI 指数、CRB 指数 2016 年探底回升，全年分别上涨 101%、13.2%，预计大宗商品的回暖会持续到 2017 年上半

年。量化宽松货币政策边际效果递减，延续压力递增，持续风险不断加大。全球不可避免迎来流动性拐点。2016 年中国为了稳增长加大杠杆，政府加社会融资总量达到 25 万亿，创造的 GDP 仅为 5-6 万亿，较 2007 年 7 万亿的融资产生了 5 万亿的 GDP，效率大打折扣。超发的货币推升大宗商品价格和房价，从一线二线城市往三四线蔓延。房价大涨、通胀反弹、汇率贬值，国内经济政策导向从以往的重视规模扩张转向结构和效益提升，财政与货币政策随之进入紧平衡状态，政治局会议和中央经济工作会议均把抑制资产泡沫和防范金融风险作为主要目标，货币政策已经从实际偏宽松转向稳健偏紧，2017 年政府加社会总融资增速趋降，年初应为全年融资增速高点，下半年经济下行的风险远高于上半年。

展望 2017 年，由于短期盈利下拐点大概率形成，预计经济将在需求侧二次探底，但供给出清，政策从稳增长转向防风险和促改革。股市将很难再现资金推动的强趋势行情，但结构性机会将比较多，围绕业绩和改革两大主线展开。未来将呈现宏观羸弱，微观转好的转型格局。虽然宏观经济在需求端二次探底，但供给出清和行业集中度提升有助于改善企业效益，传统行业随着产能的持续出清，行业集中度提升，规模经济凸显，行业壁垒提高，这些行业正酝酿着新的机会。

经过三次股灾和近一年的调整，截至 2016 年底，中小板和创业板 2016 年动态 PE 分别为 37、46 倍，如果 2017 年中小板和创业板仍然能够维持 30%左右的增长，那么将会有一批成长股进入价值投资领域。事实上，当前时点已有一些成长股已进入可以战略配置阶段，预计持有全年会有不错的绝对收益。本基金将继续采用量化择时加量化选股投资体系，在获取收益前提下，严格控制回撤。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 紧跟业务要求，完善风险控制手段。本基金管理人结合基金风险管理要求，事前做好系统风控设置，事中加强监控及跟踪提示，事后积极研究、探索风控手段的优化方案，规范流程，提升效率，构建多维度的风险管理层次，不断提升公司风险管理水平。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，

抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 梳理信批流程，促进信息披露规范化。本基金管理人持续关注最新出台的法律法规，根据产品的不同信息披露要求切实做好信息披露要点汇总、节点提示及对外披露等工作，加强流程化、日志化管理，保障了信息披露工作的及时性以及准确性。

(4) 提升合规氛围，推动合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强了内部合规培训力度，深化基金从业人员风合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 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，因赎回等原因，本基金存在连续二十个交易日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在拟定相关应对方案，除此之外，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，本着诚实守信、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人江苏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 2016 年 6 月 3 日至 2016 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

本报告期内，东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内

容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了天衡审字（2017）00508 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：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	9,201,586.95	-
结算备付金	240,232.27	-
存出保证金	480,382.29	-
交易性金融资产	22,039,465.01	-
其中：股票投资	22,039,465.01	-
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	606,560.89	-
应收利息	1,851.34	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	32,570,078.75	-
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
负 债：		

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	202,274.83	-
应付管理人报酬	42,824.11	-
应付托管费	7,137.33	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	37,438.87	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	240,762.35	-
负债合计	530,437.49	-
所有者权益：		
实收基金	32,898,922.69	-
未分配利润	-859,281.43	-
所有者权益合计	32,039,641.26	-
负债和所有者权益总计	32,570,078.75	-

注 1：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.974 元，基金份额总额 32,898,922.69 份。

注 2：本基金于 2016 年 6 月 3 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

7.2 利润表

会计主体：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 6 月 3 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	669,259.03	-
1. 利息收入	599,381.93	-
其中：存款利息收入	203,633.05	-
债券利息收入	39.89	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	395,708.99	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-344,954.51	-

其中：股票投资收益	-419,503.16	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	40,612.61	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	33,936.04	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-368,653.66	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	783,485.27	-
减：二、费用	1,579,815.96	-
1. 管理人报酬	808,373.60	-
2. 托管费	134,728.95	-
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	390,713.41	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	246,000.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-910,556.93	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-910,556.93	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年6月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月3日(基金合同生效日)至2016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）	254,749,688.49	-	254,749,688.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-910,556.93	-910,556.93
三、本期基金份额交易产	-221,850,765.80	51,275.50	-221,799,490.30

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	687,750.56	4,409.75	692,160.31
2. 基金赎回款	-222,538,516.36	46,865.75	-222,491,650.61
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)	32,898,922.69	-859,281.43	32,039,641.26
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王炯
基金管理人负责人

吕晖
主管会计工作负责人

沈静
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴安鑫量化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[2016]198号《关于同意东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于2016年6月3日正式生效，首次设立募集规模为254,749,688.49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，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

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。本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略，进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损，另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合，以期为投资者带来稳定收益。

本基金业绩比较基准 $65\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 35\% \times \text{中国债券综合全价（总值）指数收益率}$ 。

7.4.2 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》、《东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本报告期为2013年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

3.1 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。

3.2 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。

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

公允价值，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。

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。

7.4.4.5 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) 对存在活跃市场的投资品种，如报表日有成交价，应当以当日收盘价作为公允价值。活跃市场中的报价是指易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代

表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格。如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应当以最近交易日收盘价作为公允价值；如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应当在谨慎原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定公允价值。

(2) 金融工具不存在活跃市场的，本公司采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考计量日市场参与者在主要市场或最有利市场中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具当前的公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 11.1 每一基金份额享有同等分配权；
- 11.2 投资者可以选择现金分红或红利再投资方式，以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；
- 11.3 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 11.4 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 11.5 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 11.6 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，在符合有关基金分红条件的前提下，至少分配一次，但若成立不满 3 个月可不进行收益分配；
- 11.7 全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 50%；
- 11.8 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

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、基金注册与过户登记人、基金销售机构
江苏银行股份有限公司	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
上海兰生（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 2016年6月3日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	495,189,572.99	100.00%	-	-

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年6月3日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	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 成交总额的比 例
东吴证券股份 有限公司	215,652.50	100.00%	-	-

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 2016年6月3日(基金合同生效日)至2016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	104,815.51	100.00%	37,438.87	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 (%)

注：股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：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	上年度可比期间
	2016年6月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	808,373.60	-
其中：支付销售机构的客户维护费	21,202.76	-

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。

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
	2016年6月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	134,728.95	-

注：支付基金托管人江苏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。

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

本基金本报告期间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

本基金管理人本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2016年6月3日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
江苏银行股份有限公司	9,201,586.95	180,413.92	-	-

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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（2016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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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
000050	深天马A	2016年9月12日	重大资产重组	18.82	-	-	20,800	388,960.00	391,456.00	-
002034	美欣达	2016年10月10日	重大资产重组	36.33	2017年1月13日	39.96	5,700	197,969.50	207,081.00	-
600406	国电南瑞	2016年12	重大事项	16.63	-	-	12,400	189,926.50	206,212.00	-

		月 29 日								
600626	申达股份	2016 年 12 月 15 日	重大资产重组	13.69	2017 年 1 月 12 日	13.70	12,700	151,006.00	173,863.00	-
000903	云内动力	2016 年 12 月 22 日	重大资产重组	8.76	-	-	17,800	142,733.31	155,928.00	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	19.70	-	-	5,100	101,847.00	100,470.00	-
600973	宝胜股份	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	8.05	-	-	11,100	88,711.15	89,355.00	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	7.83	-	-	8,800	68,539.03	68,904.00	-
600552	凯盛科技	2016 年 9 月 8 日	重大资产重组	18.43	2017 年 2 月 13 日	17.51	2,700	50,079.11	49,761.00	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大资产重组	16.28	-	-	1,000	16,885.25	16,280.00	-
000987	越秀金控	2016 年 8 月 29 日	重大资产重组	14.49	2017 年 1 月 9 日	15.94	1,100	17,149.00	15,939.00	-
002156	通富微电	2016 年 12 月 28 日	临时停牌	11.38	2017 年 1 月 5 日	11.65	1,100	13,590.50	12,518.00	-
600814	杭州解百	2016 年 12 月 26 日	重大事项	11.37	2017 年 1 月 9 日	10.70	600	5,988.00	6,822.00	-

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

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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§ 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	22,039,465.01	67.67
	其中：股票	22,039,465.01	67.67
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	9,441,819.22	28.99
7	其他各项资产	1,088,794.52	3.34
8	合计	32,570,078.75	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	464,226.00	1.45
B	采矿业	1,229,097.00	3.84
C	制造业	14,236,788.55	44.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,900.00	0.16

F	批发和零售业	1,264,872.00	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	1,237,320.00	3.86
H	住宿和餐饮业	192,734.00	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,273,024.20	3.97
J	金融业	1,270,290.00	3.96
K	房地产业	321,282.00	1.00
L	租赁和商务服务业	97,296.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	203,276.26	0.63
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	71,075.00	0.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	84,700.00	0.26
S	综合	43,584.00	0.14
	合计	22,039,465.01	68.79

8.2.2 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。

8.3 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

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	000619	海螺型材	53,215	642,837.20	2.01
2	000663	永安林业	29,100	490,335.00	1.53
3	000050	深天马 A	20,800	391,456.00	1.22
4	600597	光明乳业	27,200	355,232.00	1.11
5	600198	大唐电信	21,859	346,902.33	1.08
6	000786	北新建材	33,000	339,570.00	1.06
7	603000	人民网	17,300	305,518.00	0.95

8	600150	中国船舶	10,900	300,949.00	0.94
9	601989	中国重工	41,000	290,690.00	0.91
10	601718	际华集团	30,100	277,221.00	0.87

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600679	上海凤凰	3,316,363.00	10.35
2	000157	中联重科	2,351,275.00	7.34
3	601989	中国重工	2,205,688.00	6.88
4	600150	中国船舶	2,012,909.00	6.28
5	600650	锦江投资	1,953,633.00	6.10
6	600662	强生控股	1,943,772.00	6.07
7	600685	中船防务	1,825,510.69	5.70
8	600834	申通地铁	1,708,633.00	5.33
9	002186	全聚德	1,619,576.00	5.05
10	600099	林海股份	1,570,639.75	4.90
11	000721	西安饮食	1,564,043.00	4.88
12	600981	汇鸿集团	1,520,749.90	4.75
13	002125	湘潭电化	1,478,028.00	4.61
14	601618	中国中冶	1,369,006.00	4.27
15	600020	中原高速	1,330,893.71	4.15
16	000707	双环科技	1,287,985.00	4.02
17	600409	三友化工	1,287,278.00	4.02
18	600635	大众公用	1,285,808.00	4.01
19	601866	中远海发	1,241,944.00	3.88
20	000666	经纬纺机	1,228,078.00	3.83
21	600798	宁波海运	1,204,192.00	3.76
22	601857	中国石油	1,199,392.00	3.74
23	601111	中国国航	1,182,036.00	3.69
24	600489	中金黄金	1,158,936.00	3.62
25	600705	中航资本	1,156,851.00	3.61

26	600367	红星发展	1,149,976.00	3.59
27	000032	深桑达 A	1,119,410.00	3.49
28	600755	厦门国贸	1,110,628.00	3.47
29	000151	中成股份	1,087,207.00	3.39
30	600739	辽宁成大	1,066,702.00	3.33
31	002751	易尚展示	1,048,549.00	3.27
32	601899	紫金矿业	1,029,287.00	3.21
33	601069	西部黄金	1,019,049.00	3.18
34	600895	张江高科	997,524.00	3.11
35	603698	航天工程	995,928.37	3.11
36	600115	东方航空	986,529.00	3.08
37	600776	东方通信	983,722.00	3.07
38	600029	南方航空	978,794.00	3.05
39	600009	上海机场	959,721.00	3.00
40	600428	中远海特	959,560.00	2.99
41	600754	锦江股份	944,805.40	2.95
42	600630	龙头股份	932,858.00	2.91
43	601718	际华集团	924,864.00	2.89
44	000529	广弘控股	917,968.00	2.87
45	600026	中远海能	917,501.00	2.86
46	600604	市北高新	903,703.00	2.82
47	000619	海螺型材	878,208.55	2.74
48	601818	光大银行	876,457.00	2.74
49	601988	中国银行	870,958.00	2.72
50	000733	振华科技	866,346.00	2.70
51	600667	太极实业	865,829.00	2.70
52	601929	吉视传媒	853,216.00	2.66
53	600415	小商品城	846,611.00	2.64
54	600561	江西长运	841,633.00	2.63
55	600547	山东黄金	840,802.00	2.62
56	002140	东华科技	829,501.00	2.59
57	600459	贵研铂业	828,295.00	2.59
58	601117	中国化学	824,189.00	2.57
59	000599	青岛双星	814,368.00	2.54
60	002014	永新股份	810,625.52	2.53
61	000589	黔轮胎 A	807,518.00	2.52

62	002627	宜昌交运	800,173.00	2.50
63	601919	中远海控	794,347.00	2.48
64	600015	华夏银行	772,121.00	2.41
65	600262	北方股份	770,439.00	2.40
66	600248	延长化建	763,895.00	2.38
67	600073	上海梅林	763,570.00	2.38
68	002679	福建金森	762,178.00	2.38
69	600688	上海石化	754,823.00	2.36
70	600429	三元股份	749,744.00	2.34
71	600028	中国石化	746,718.00	2.33
72	000089	深圳机场	745,676.00	2.33
73	000156	华数传媒	745,611.00	2.33
74	600880	博瑞传播	743,042.00	2.32
75	002149	西部材料	728,706.00	2.27
76	600624	复旦复华	723,024.00	2.26
77	000762	西藏矿业	715,882.69	2.23
78	600897	厦门空港	710,567.00	2.22
79	002179	中航光电	702,588.00	2.19
80	601007	金陵饭店	702,076.00	2.19
81	000001	平安银行	701,599.00	2.19
82	600730	中国高科	696,675.00	2.17
83	000885	同力水泥	691,823.00	2.16
84	000598	兴蓉环境	678,250.00	2.12
85	601998	中信银行	672,992.00	2.10
86	600004	白云机场	663,880.00	2.07
87	002096	南岭民爆	658,392.00	2.05
88	600970	中材国际	646,548.16	2.02
89	000158	常山股份	643,248.15	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600679	上海凤凰	3,261,478.98	10.18
2	000157	中联重科	2,157,132.00	6.73

3	601989	中国重工	1,906,736.00	5.95
4	600662	强生控股	1,895,671.00	5.92
5	600650	锦江投资	1,882,294.00	5.87
6	600685	中船防务	1,742,211.00	5.44
7	600150	中国船舶	1,719,238.00	5.37
8	000721	西安饮食	1,607,411.00	5.02
9	002186	全聚德	1,577,875.90	4.92
10	600099	林海股份	1,574,452.44	4.91
11	600834	申通地铁	1,566,469.03	4.89
12	002125	湘潭电化	1,469,377.65	4.59
13	600981	汇鸿集团	1,399,899.00	4.37
14	601618	中国中冶	1,363,547.00	4.26
15	600020	中原高速	1,327,158.00	4.14
16	600635	大众公用	1,309,593.00	4.09
17	600409	三友化工	1,275,807.00	3.98
18	000707	双环科技	1,240,398.20	3.87
19	000666	经纬纺机	1,165,468.00	3.64
20	601111	中国国航	1,154,242.00	3.60
21	600798	宁波海运	1,102,476.90	3.44
22	601866	中远海发	1,069,786.00	3.34
23	600367	红星发展	1,057,023.00	3.30
24	600739	辽宁成大	1,050,772.00	3.28
25	600755	厦门国贸	1,035,232.68	3.23
26	601857	中国石油	1,024,195.00	3.20
27	600705	中航资本	1,013,585.00	3.16
28	000151	中成股份	1,007,205.00	3.14
29	002751	易尚展示	998,943.00	3.12
30	600895	张江高科	998,460.00	3.12
31	600115	东方航空	977,818.00	3.05
32	600029	南方航空	956,744.00	2.99
33	600009	上海机场	955,353.56	2.98
34	000032	深桑达 A	955,323.00	2.98
35	600026	中远海能	917,633.00	2.86
36	600754	锦江股份	899,396.10	2.81
37	601899	紫金矿业	891,008.00	2.78
38	600630	龙头股份	884,432.00	2.76
39	600415	小商品城	880,867.00	2.75
40	000529	广弘控股	871,397.10	2.72

41	600561	江西长运	865,125.92	2.70
42	600428	中远海特	857,922.00	2.68
43	603698	航天工程	856,981.00	2.67
44	600604	市北高新	851,151.00	2.66
45	601929	吉视传媒	849,866.00	2.65
46	002679	福建金森	847,241.00	2.64
47	600489	中金黄金	833,254.03	2.60
48	002627	宜昌交运	829,171.00	2.59
49	601117	中国化学	826,298.00	2.58
50	002140	东华科技	815,779.00	2.55
51	600248	延长化建	785,932.00	2.45
52	600547	山东黄金	780,829.18	2.44
53	000589	黔轮胎 A	778,191.00	2.43
54	601988	中国银行	776,354.00	2.42
55	002149	西部材料	775,602.00	2.42
56	000599	青岛双星	753,464.00	2.35
57	000089	深圳机场	750,256.00	2.34
58	600028	中国石化	746,510.00	2.33
59	600688	上海石化	739,512.00	2.31
60	600262	北方股份	738,920.00	2.31
61	000156	华数传媒	729,454.00	2.28
62	600880	博瑞传播	726,511.00	2.27
63	600776	东方通信	726,262.00	2.27
64	600015	华夏银行	725,760.00	2.27
65	600897	厦门空港	716,244.00	2.24
66	601007	金陵饭店	707,818.00	2.21
67	601069	西部黄金	698,376.00	2.18
68	601818	光大银行	690,388.00	2.15
69	000598	兴蓉环境	685,356.00	2.14
70	002179	中航光电	683,110.00	2.13
71	600624	复旦复华	662,264.00	2.07
72	600004	白云机场	660,647.00	2.06
73	601919	中远海控	655,252.00	2.05
74	600970	中材国际	649,684.00	2.03
75	601718	际华集团	648,409.00	2.02

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。

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	259,022,229.93
卖出股票收入（成交）总额	236,194,608.10

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

本基金报告期末未投资债券。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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	480,382.29
2	应收证券清算款	606,560.89
3	应收股利	-
4	应收利息	1,851.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,088,794.52

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

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	000050	深天马 A	391,456.00	1.22	重大资产重组

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
392	83,925.82	207,535.08	0.63%	32,691,387.61	99.37%

9.3 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	19,770.84	0.0601%

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 6 月 3 日) 基金份额总额	254,749,688.49
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	687,750.56
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	222,538,516.36

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	32,898,922.69

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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2016 年 1 月 13 日，任少华先生不再担任公司董事一职，由范力、冯玉泉担任公司第二届董事会董事；

2、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。

3、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。

4、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。

5、2016 年 12 月 28 日，全卓伟女士不再担任公司董事一职，由倪雪梅女士担任公司第二届董事会董事。

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。

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天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2016 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 60000 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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
东吴证券		2,495,189,572.99	100.00%	104,815.51	100.00%	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

本报告期本基金交易单元无变更。

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
东吴证券	215,652.50	100.00%	2,645,000,000.00	100.00%	-	-

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

东吴基金管理有限公司
2017 年 3 月 27 日