

# 东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十五日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东吴安盈量化
基金主代码	002270
交易代码	002270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	346,009,855.77 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用选股、择时量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
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。通过公司数量化模型，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，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。
业绩比较基准	65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	陆志俊
	联系电话	021-50509888-8308	95559
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95559

传真	021-50509888-8211	021-62701216
----	-------------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

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

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-21,443,038.89
本期利润	-10,456,398.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0260
本期基金份额净值增长率	-2.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0174
期末基金资产净值	352,152,961.65
期末基金份额净值	1.018

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。

4、本基金成立于 2016 年 2 月 3 日。

#### 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

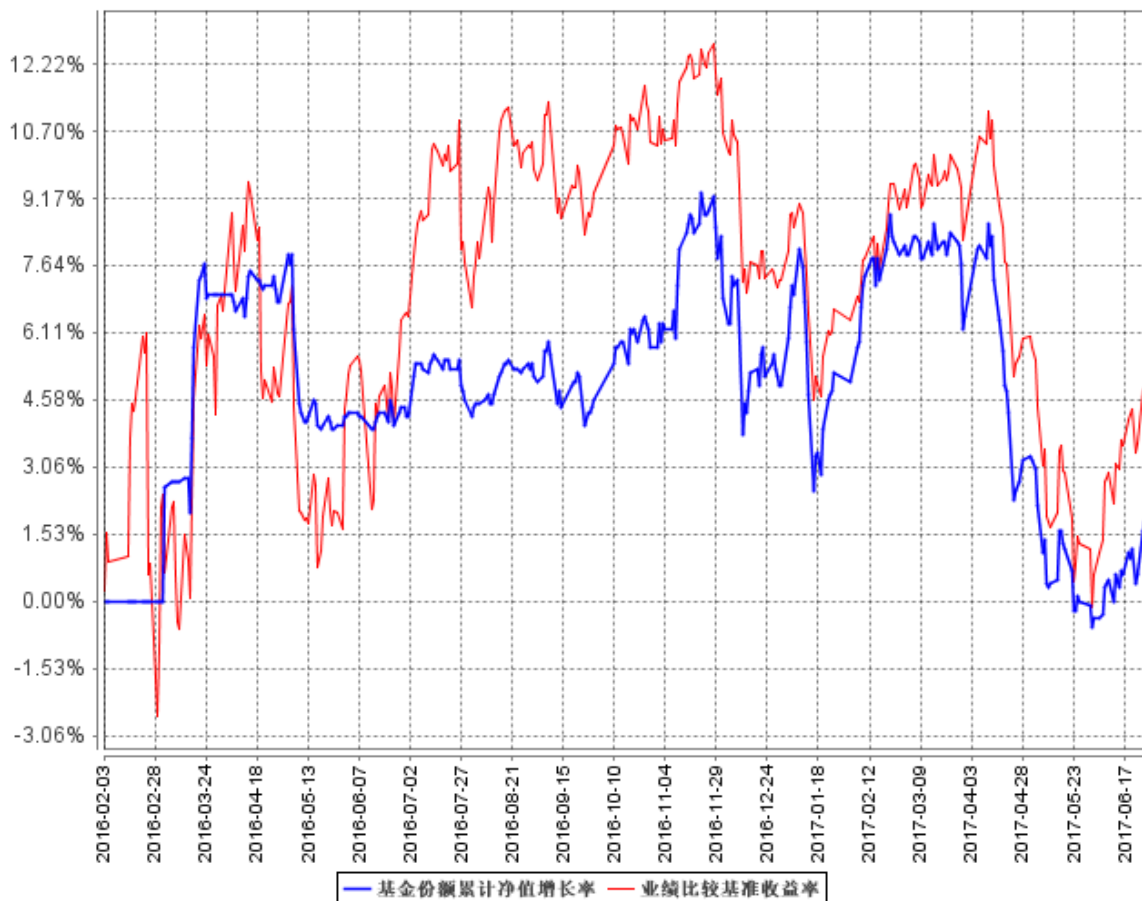
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.90%	0.43%	3.82%	0.61%	-1.92%	-0.18%
过去三个月	-4.41%	0.55%	-2.98%	0.68%	-1.43%	-0.13%
过去六个月	-2.96%	0.56%	-2.04%	0.59%	-0.92%	-0.03%
过去一年	-2.30%	0.52%	-1.07%	0.60%	-1.23%	-0.08%
自基金合同生效起至今	1.80%	0.52%	5.14%	0.87%	-3.34%	-0.35%

注：1、比较基准=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率。

2、本基金于 2016 年 2 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，但报告期末距建仓结束不满一年。

### 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、比较基准=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率。

2、本基金于 2016 年 2 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，但报告期末距建仓结束不满一年。

## § 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、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

在泛资管大背景下,公司近年来推进公募基金、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 2017 年二季度末,公司整体资产管理规模为 734.06 亿元,其中公募基金 247.63 亿元,专户业务 180.62 亿元,子公司 305.81 亿元;旗下管理着 25 只公募基金,42 只存续专户资产管理计划,88 项存续专项资产管理计划,形成了高中低不同风险层次的多元化产品线。

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的投资风格,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,兼顾收益率和流动性,为大类资产配置提供基础性工具。

尤其是 2015 年以来,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,发行了多只量化公募产品,并在业内率先成立了绝对收益部。

2017 年,公司对投研模块进行了变革,引进了彭敢等公募行业领军人物,投研磨合红利已开始显现,尤其是固定收益投资崭露头角。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示,截至 2017 年二季度末,东吴基金旗下的固定收益类基金以 2.44%的规模加权平均收益,位列 98 家入选基金公司的第六位。

今年以来,公司在固定收益领域获得了多个奖项,比如 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	本基金基金经理	2016年2月3日	2017年4月19日	10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，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。
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、投资总部量化与衍生品交易研究员，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。
--	--	--	--	--	--

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

上半年，宏观方面的主导变量是“经济强”与“金融紧”，一季度“经济强”，二季度“金融紧”，五月下旬后经济预期再次由弱趋强，金融监管则由强趋缓。A 股上半年整体呈现“N”字走势，一季度市场整体震荡走强，二季度先抑后扬，四月上旬市场在“雄安新区”崛起中喧嚣一把，但整体市场盈利效应匮乏，在竞争性监管和强力去杠杆影响下，市场出现恐慌性的投降式抛售，之后资金抱团自救，以上证 50 和中证 100 为代表的个股逐步企稳反弹，但市场整体赚钱效应羸弱，市场“一九效应”愈发明显，六月以来，市场抱团效应缓解，整体赚钱效应回升，从“一九”逐步过渡到“三七”，有色、钢铁等周期板块甚至走出了反转行情。但板块分化的矛盾仍然非常尖锐。

本基金采用量化选股进行均衡配置，辅之以量化择时和资金管理，在市场大部分股票迭创新低的背景下二季度出现了阶段回撤，六月逐步企稳回升。市场运行逻辑正处于破坏性重构过程中，随着市场盈利效应逐步回归，A 股有望步入进二退一的良性循环。

### 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 1.018 元，累计净值 1.018 元；本报告期份额净值增长率-2.96%，同期业绩比较基准收益率为-2.04%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观变量先看“经济强”，后看“金融紧”。受益于美日韩新一轮朱格拉周期，制造业结构性复苏，处于缓慢复苏过程中。美日韩新一轮设备投资支出周期外溢效应叠加国内企业设备更新、升级需求，政策导向正本清源，制造业国内的高端装备制造业走向智能化和自动化，中国经济短周期出现一段景气格局，但房地产投资是景气持续的关键，增速高点已过，好在快速其下行拐点尚未显现，基建方面，下半年预算内财政支出可能出现负增长，但全年基建增速仍可能维持在 15%左右。

今年以来，月度经济数据波动加大，中长期看，经济“L”型仍将延续，经济结构出现变化和亮点，经济出现了结构性复苏和制造业的再繁荣。经济的内在韧性决定年内难觅政策宽松拐点。

国务院环保督察对部分地区高耗能行业的生产和投资抑制较多，黑色、有色、化学制品出现明显下滑，对周期品价格造成脉冲性冲击。随着下半年尤其是冬季取暖季的错峰生产，环保限产和去产能仍是下阶段影响生产、投资的重要因素。

经济结构的变化体现在 A 股市场中，市场结构性地出现一些行业的阶段持续强势，而其余大部分行业持续萎靡，市场结构性分化演化到非常尖锐的地步。但随着各行业景气的逐步回升，以及监管友好程度的提高，市场风险偏好的逐步回暖，抱团资金逐步往风险收益比更诱惑力的行业转移，比如计算机、传媒、医药等板块，市场抱团效应缓解，整体赚钱效应从“一九”逐步过渡到“三七”，随着市场盈利效应逐步回归，A 股步入进二退一的良性循环。

#### 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、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；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，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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **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，因赎回等原因，本基金于 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 20 日出现连续六十个工作日基金份额持有人低于二百人的情形，公司已向中国证监会报告备案。本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§ 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**

2017 年上半年度，基金托管人在东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### **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**

2017 年上半年度，东吴基金管理有限公司在东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### **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**

2017 年上半年度，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	48,918,912.35	55,035,900.82
结算备付金	2,052,284.28	1,950,291.98
存出保证金	499,153.52	440,400.08
交易性金融资产	263,379,752.98	314,551,959.01
其中：股票投资	243,400,752.98	314,551,959.01
基金投资	-	-
债券投资	19,979,000.00	-
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	19,982,129.99	96,400,464.60
应收证券清算款	17,591,964.90	1,865,811.78
应收利息	686,232.53	42,572.76
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	353,110,430.55	470,287,401.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>2016 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	10,129.03	4,502.10
应付管理人报酬	431,244.92	469,459.06
应付托管费	71,874.15	78,243.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	315,290.88	229,359.80

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	128,929.92	160,016.96
负债合计	957,468.90	941,581.07
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	346,009,855.77	447,272,411.62
未分配利润	6,143,105.88	22,073,408.34
所有者权益合计	352,152,961.65	469,345,819.96
负债和所有者权益总计	353,110,430.55	470,287,401.03

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.018 元，基金份额总额 346,009,855.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-4,540,151.25	-2,498,854.18
1.利息收入	1,051,510.12	1,108,799.76
其中：存款利息收入	468,772.82	334,298.46
债券利息收入	143,124.21	213,688.15
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	439,613.09	560,813.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-16,785,472.53	-4,532,642.23
其中：股票投资收益	-18,038,671.94	-4,623,260.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	69,656.70	-52,665.61
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	1,183,542.71	143,283.92
1) 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	10,986,640.34	28,008.94
2) 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
3) 5.其他收入（损失以“-”号填列）	207,170.82	896,979.35

<b>减：二、费用</b>	5,916,247.30	1,910,307.86
1. 管理人报酬	3,145,659.76	1,002,371.76
2. 托管费	524,276.61	167,062.01
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,096,836.01	611,439.13
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	149,474.92	129,434.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-10,456,398.55	-4,409,162.04
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-10,456,398.55	-4,409,162.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	447,272,411.62	22,073,408.34	469,345,819.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,456,398.55	-10,456,398.55
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）	-101,262,555.85	-5,473,903.91	-106,736,459.76
其中：1. 基金申购款	10,025,121.56	280,899.72	10,306,021.28
2. 基金赎回款	-111,287,677.41	-5,754,803.63	-117,042,481.04
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	346,009,855.77	6,143,105.88	352,152,961.65

项目	上年度可比期间		
	2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
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)	-	-4,409,162.04	-4,409,162.04
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)	211,261,790.46	13,265,875.19	224,527,665.65
其中：1.基金申购款	434,216,001.94	15,253,859.04	449,469,860.98
2.基金赎回款	-222,954,211.48	-1,987,983.85	-224,942,195.33
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)	211,261,790.46	8,856,713.15	220,118,503.61

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：

\_\_\_\_\_ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东吴安盈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[2015]2795 号文《关于准予东吴安盈量化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众公开发行募集，基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 211,164,009.95 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，基金托管人为中国交通银行股份有限公司。

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）、股指期货、权证、债券（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具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相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 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》、《东吴安盈量化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。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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、营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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；

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，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、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。

### 4、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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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
交通银行股份有限公司	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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016 年6月30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	2,526,783,162.13	99.58%	776,988,235.18	100.00%

**6.4.8.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016 年6月30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	12,425,790.82	100.00%	27,572,708.82	100.00%

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016 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 限公司	350,500,000.00	100.00%	3,913,000,000.00	100.00%

**6.4.8.1.4 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。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	558,319.46	98.24%	308,911.68	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)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	171,970.42	100.00%	167,622.57	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,145,659.76	1,002,371.76
其中：支付销售机构的客户维护费	12,714.20	49,030.36

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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	524,276.61	167,062.01

注：支付基金托管人交通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。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

### 6.4.8.3 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。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金本报告期间基金管理人未持有本基金份额。

**6.4.8.4.2 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**

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

**6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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
活期存款利息收入	48,918,912.35	422,283.49	11,149,643.77	149,626.94

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

		日	12 日							
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.9.2 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
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项停牌	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	350,700	2,508,291.02	2,619,729.00	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大资产重组	30.82	2017 年 7 月 17 日	24.74	38,000	1,326,394.98	1,171,160.00	-
000099	中信海直	2017 年 5 月 4 日	重大资产重组	11.26	-	-	90,301	1,098,715.70	1,016,789.26	-
300298	三诺生物	2017 年 5 月 17 日	重大资产重组	16.27	2017 年 7 月 17 日	16.09	54,960	880,323.48	894,199.20	-
000889	茂业通信	2017 年 4 月 14 日	重大资产重组	16.71	-	-	45,000	779,269.43	751,950.00	-
300145	中金环境	2017 年 6 月 28 日	重大资产重组	16.92	-	-	41,000	682,640.00	693,720.00	-
600568	中珠医疗	2017 年 4 月 26 日	重大资产重组	19.63	2017 年 7 月 27 日	6.15	31,900	653,858.73	626,197.00	-
000032	深桑达 A	2017 年 2 月 27 日	重大资产重组	15.69	-	-	37,805	576,964.19	593,160.45	-



002642	荣之联	2017年4月10日	重要事项停牌	25.06	2017年7月7日	22.54	21,600	503,721.47	541,296.00	-
600764	中电广通	2017年6月29日	重要事项停牌	33.25	2017年7月7日	33.98	14,200	463,855.90	472,150.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	重大资产重组	6.21	-	-	71,600	536,110.02	444,636.00	-
002312	*ST三泰	2017年3月31日	重大资产重组	6.82	2017年7月24日	7.16	63,500	502,158.00	433,070.00	-
600100	同方股份	2017年4月21日	重大资产重组	14.12	-	-	28,700	398,900.50	405,244.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大资产重组	24.95	2017年7月4日	22.46	15,800	383,274.00	394,210.00	-
300109	新开源	2017年3月27日	重大资产重组	46.46	-	-	8,400	398,545.00	390,264.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大资产重组	11.32	-	-	33,000	367,219.00	373,560.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	重要事项停牌	22.29	-	-	15,500	322,602.63	345,495.00	-
601872	招商轮船	2017年5月3日	重要事项停牌	5.16	-	-	52,100	284,847.48	268,836.00	-
600734	实达集团	2017年4月6日	重大资产重组	12.75	2017年7月12日	12.00	21,000	298,350.50	267,750.00	-
002447	壹桥股份	2017年5月2日	重大资产重组	9.00	-	-	28,500	270,667.99	256,500.00	-
000610	西安旅游	2017年5月22日	重大资产重组	11.43	2017年7月24日	10.71	22,400	323,847.32	256,032.00	-
600165	新日恒力	2017年4月25日	重大资产重组	16.84	2017年7月20日	15.16	15,100	238,455.14	254,284.00	-

601919	中远海控	2017年5月17日	重大资产重组	5.35	2017年7月26日	5.89	47,300	290,388.62	253,055.00	-
300478	杭州高新	2017年3月20日	重大资产重组	55.60	2017年8月7日	50.04	4,500	253,594.00	250,200.00	-
300151	昌红科技	2017年4月11日	重大资产重组	11.53	-	-	20,100	244,900.50	231,753.00	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大资产重组	6.54	2017年7月5日	5.92	35,200	207,481.26	230,208.00	-
000700	模塑科技	2017年6月28日	重要事项停牌	8.09	-	-	28,200	204,628.12	228,138.00	-
300271	华宇软件	2017年6月22日	重要事项停牌	16.59	2017年7月4日	16.80	13,500	227,689.66	223,965.00	-
002504	*ST弘高	2017年5月3日	重大资产重组	8.10	-	-	26,800	214,113.00	217,080.00	-
002162	悦心健康	2016年12月22日	重大资产重组	6.61	2017年7月5日	6.80	31,400	208,496.00	207,554.00	-
600460	士兰微	2017年5月12日	重大资产重组	6.07	-	-	32,600	204,335.47	197,882.00	-
603598	引力传媒	2017年5月10日	重大资产重组	16.21	-	-	11,700	246,509.10	189,657.00	-
600666	奥瑞德	2017年6月12日	重大资产重组	17.94	-	-	9,760	180,194.00	175,094.40	-
600490	鹏欣资源	2017年2月21日	重大资产重组	7.91	-	-	19,000	148,903.00	150,290.00	-
002696	百洋股份	2017年6月22日	重要事项停牌	20.87	2017年7月3日	21.74	7,100	133,186.62	148,177.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	重大资产重组	30.68	-	-	4,200	138,040.00	128,856.00	-

300291	华录百纳	2017年4月19日	重大资产重组	20.02	-	-	6,400	135,771.55	128,128.00	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大资产重组	7.79	-	-	15,300	135,649.93	119,187.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重要事项停牌	3.43	2017年7月26日	3.72	33,200	119,492.57	113,876.00	-
300087	荃银高科	2017年5月12日	重大资产重组	14.14	2017年8月10日	9.80	8,000	102,340.91	113,120.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重要事项停牌	23.26	2017年7月27日	19.49	4,800	135,840.45	111,648.00	-
002348	高乐股份	2017年5月11日	重大资产重组	7.01	2017年7月27日	6.70	13,600	101,337.00	95,336.00	-
002650	加加食品	2017年4月20日	重大资产重组	5.88	-	-	15,900	112,921.08	93,492.00	-
300313	天山生物	2017年5月15日	重大资产重组	13.10	-	-	6,100	123,094.98	79,910.00	-
300462	华铭智能	2017年4月21日	重大资产重组	36.83	-	-	1,900	71,636.79	69,977.00	-
002143	印纪传媒	2017年4月18日	重大资产重组	24.93	-	-	2,700	101,329.23	67,311.00	-
300030	阳普医疗	2017年5月16日	重大资产重组	11.62	-	-	5,600	69,160.00	65,072.00	-
600289	亿阳信通	2017年5月10日	重要事项停牌	10.94	-	-	3,500	45,890.83	38,290.00	-
600255	鑫科材料	2017年6月26日	重大事项停牌	4.04	-	-	8,200	34,768.00	33,128.00	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大事项停牌	10.57	-	-	2,300	24,088.66	24,311.00	-
000836	鑫茂	2017	重大	6.05	-	-	4,000	33,510.41	24,200.00	-

	科技	年 5 月 24 日	资产 重组							
600057	象屿 股份	2017 年 6 月 27 日	重大 事项 停牌	10.17	2017 年 7 月 4 日	10.17	1,380	13,799.91	14,034.60	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 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。

#### 6.4.9.3.2 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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	243,400,752.98	68.93
	其中：股票	243,400,752.98	68.93
2	固定收益投资	19,979,000.00	5.66
	其中：债券	19,979,000.00	5.66
	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	19,982,129.99	5.66
	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	50,971,196.63	14.43
7	其他各项资产	18,777,350.95	5.32
8	合计	353,110,430.55	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	1,370,213.00	0.39
B	采矿业	6,204,580.60	1.76
C	制造业	137,944,266.97	39.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,140,668.93	0.89
E	建筑业	5,643,864.00	1.60
F	批发和零售业	16,839,439.71	4.78
G	交通运输、仓储和邮政业	6,465,028.86	1.84
H	住宿和餐饮业	1,194,161.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,121,457.69	6.57
J	金融业	13,454,350.00	3.82
K	房地产业	6,417,150.72	1.82
L	租赁和商务服务业	5,753,608.13	1.63
M	科学研究和技术服务业	18,414.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,917,108.00	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	542,736.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	12,461,909.37	3.54
S	综合	911,796.00	0.26
	合计	243,400,752.98	69.12

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	600050	中国联通	350,700	2,619,729.00	0.74

2	600501	航天晨光	150,327	2,247,388.65	0.64
3	600386	北巴传媒	166,025	2,208,132.50	0.63
4	002095	生意宝	63,100	2,180,736.00	0.62
5	600316	洪都航空	134,000	2,153,380.00	0.61
6	600372	中航电子	123,800	2,150,406.00	0.61
7	600038	中直股份	41,900	1,917,763.00	0.54
8	600153	建发股份	145,700	1,883,901.00	0.53
9	601398	工商银行	352,300	1,849,575.00	0.53
10	600562	国睿科技	67,000	1,845,180.00	0.52

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 [www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn) 的半年度报告正文。

## 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	600990	四创电子	5,562,713.04	1.19
2	600562	国睿科技	5,404,539.13	1.15
3	300288	朗玛信息	5,095,966.00	1.09
4	601668	中国建筑	4,977,443.00	1.06
5	601398	工商银行	4,519,985.00	0.96
6	600435	北方导航	4,420,168.00	0.94
7	002467	二六三	4,276,901.00	0.91
8	601939	建设银行	4,057,925.00	0.86
9	300146	汤臣倍健	3,931,500.48	0.84
10	300114	中航电测	3,929,848.51	0.84
11	600343	航天动力	3,904,033.06	0.83
12	600386	北巴传媒	3,841,940.16	0.82
13	000089	深圳机场	3,828,508.00	0.82
14	002148	北纬通信	3,760,517.36	0.80
15	002179	中航光电	3,651,668.41	0.78
16	600897	厦门空港	3,536,371.71	0.75
17	600004	白云机场	3,438,955.56	0.73
18	002030	达安基因	3,430,499.00	0.73

19	002027	分众传媒	3,355,971.00	0.72
20	000963	华东医药	3,353,851.00	0.71

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	600685	中船防务	7,161,531.40	1.53
2	600150	中国船舶	5,759,547.04	1.23
3	601857	中国石油	5,614,732.99	1.20
4	300114	中航电测	5,577,549.37	1.19
5	601939	建设银行	5,486,322.00	1.17
6	600990	四创电子	5,424,792.18	1.16
7	000901	航天科技	5,298,074.62	1.13
8	601668	中国建筑	4,843,937.00	1.03
9	600198	大唐电信	4,700,450.40	1.00
10	600562	国睿科技	4,681,331.81	1.00
11	601989	中国重工	4,529,121.00	0.96
12	600184	光电股份	4,521,858.65	0.96
13	600343	航天动力	4,420,241.94	0.94
14	002467	二六三	4,391,594.72	0.94
15	600367	红星发展	4,316,284.24	0.92
16	300288	朗玛信息	4,291,480.00	0.91
17	601398	工商银行	4,287,421.00	0.91
18	600409	三友化工	4,186,754.50	0.89
19	600435	北方导航	4,059,304.00	0.86
20	600987	航民股份	3,878,715.31	0.83

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	1,238,600,077.53
卖出股票收入（成交）总额	1,303,545,811.22

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,154,000.00	2.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,825,000.00	2.79
9	其他	-	-
10	合计	19,979,000.00	5.67

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112035	11 国脉债	100,000	10,154,000.00	2.88
2	111614169	16 江苏银行 CD169	100,000	9,825,000.00	2.79

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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之一洪都航空（600316）的发行主体于 2016 年 9 月 12 日收到中国证券监督管理委员会江西监管局《关于对江西洪都航空工业股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2016】6 号），于 2017 年 6 月 28 日收到上海证券交易所《关于对江西洪都航空工业股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（【2017】29 号）本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该处罚事项未对洪都航空的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对

该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。除此之外报告期内,基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	499,153.52
2	应收证券清算款	17,591,964.90
3	应收股利	-
4	应收利息	686,232.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,777,350.95

### 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	600050	中国联通	2,619,729.00	0.74	重要事项停牌

### 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
218	1,587,201.17	340,734,949.29	98.48%	5,274,906.48	1.52%

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。

### 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	72,897.61	0.0211%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：高管持有本基金份额在 0~10 万份之间，本基金经理本期末未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年2月3日）基金份额总额	211,164,009.95
本报告期期初基金份额总额	447,272,411.62
本报告期基金总申购份额	10,025,121.56
减：本报告期基金总赎回份额	111,287,677.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	346,009,855.77

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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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）。

### 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	2,526,783,162.13	99.58%	558,319.46	98.24%	-
中金证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	10,751,361.52	0.42%	10,012.70	1.76%	-

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：中金公司。退租 1 个交易单元：华创证券。

## 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	12,425,790.82	100.00%	350,500,000.00	100.00%	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	94,875,711.57	-	-	94,875,711.57	27.42
	2	20170101-20170630	121,493,457.95	9,736,124.63	28,036,448.60	103,193,133.98	29.82
	3	20170101-20170630	114,656,718.66	-	-	114,656,718.66	33.14
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
如开放期内上述持有人集中大额赎回，极端情况下本基金可能存在一定的流动性风险以及净值波动等情况。							

### 11.2 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

2017 年 8 月 25 日