

# 东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

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 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。

## 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>
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.....	63

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## § 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
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	122,847,343.74 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-6,834,407.78
本期利润	-3,922,785.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0311
本期加权平均净值利润率	-2.99%
本期基金份额净值增长率	-3.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	984,408.27
期末可供分配基金份额利润	0.0080
期末基金资产净值	124,578,075.64
期末基金份额净值	1.014
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.40%

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	2.22%	0.40%	2.51%	0.35%	-0.29%	0.05%
过去三个月	-4.34%	0.54%	1.13%	0.40%	-5.47%	0.14%
过去六个月	-3.06%	0.54%	3.84%	0.37%	-6.90%	0.17%
过去一年	2.22%	0.51%	8.85%	0.42%	-6.63%	0.09%
自基金合同	1.40%	0.50%	-5.68%	0.76%	7.08%	-0.26%

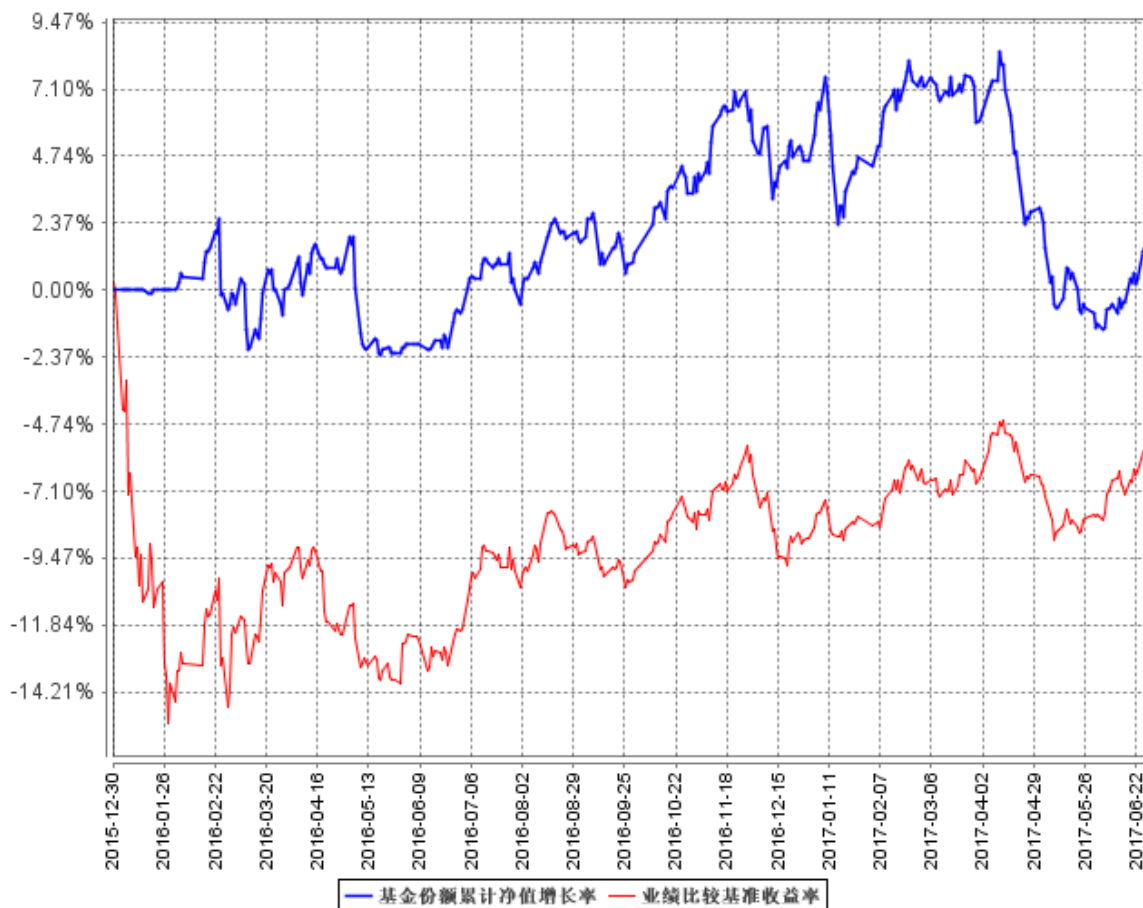


生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

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：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 L0F(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		
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	2017 年 4 月 19 日	6.5 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，2015 年 12 月 30 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。
周健	本基金基金经理	2016 年 2 月 5 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、投资总部数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、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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本基金采用在主题股票池内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 1.0140 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.06%，业绩比较基准收益率为 3.84%。

#### 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

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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的真实、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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	32,387,887.59	41,921,794.59
结算备付金		1,070,746.44	826,101.67
存出保证金		151,122.63	177,997.48
交易性金融资产	6.4.7.2	75,131,087.76	86,674,570.84
其中：股票投资		75,131,087.76	86,674,570.84
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		16,248,054.52	2,026,522.31
应收利息	6.4.7.5	8,852.58	10,953.77
应收股利		-	-
应收申购款		398.36	797.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		124,998,149.88	131,638,738.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	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		25,929.66	660,859.65
应付管理人报酬		151,815.61	171,304.14
应付托管费		25,302.63	28,550.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	137,596.56	68,331.83

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	79,429.78	161,242.20
负债合计		420,074.24	1,090,288.50
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	122,847,343.74	124,832,251.06
未分配利润	6.4.7.10	1,730,731.90	5,716,199.01
所有者权益合计		124,578,075.64	130,548,450.07
负债和所有者权益总计		124,998,149.88	131,638,738.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 122,847,343.74 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-1,832,826.18	1,592,184.27
1.利息收入		205,565.39	1,238,507.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	205,565.39	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）		-5,136,827.71	-1,902,355.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,589,015.18	-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	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	452,187.47	193,446.39
1) 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,911,622.72	1,664,412.45
2) 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
3) 5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	186,813.42	591,619.78

<b>减：二、费用</b>		2,089,958.88	3,087,777.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	985,009.20	1,755,482.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	164,168.17	292,580.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	839,858.00	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	100,923.51	108,298.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,922,785.06	-1,495,592.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,922,785.06	-1,495,592.95

### 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：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)	124,832,251.06	5,716,199.01	130,548,450.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,922,785.06	-3,922,785.06
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)	-1,984,907.32	-62,682.05	-2,047,589.37
其中：1.基金申购款	84,487,065.85	4,433,055.63	88,920,121.48
2.基金赎回款	-86,471,973.17	-4,495,737.68	-90,967,710.85
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	122,847,343.74	1,730,731.90	124,578,075.64

项目	上年度可比期间 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
	金净值)		
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

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

\_\_\_\_\_  
吕晖

\_\_\_\_\_  
沈静

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众公开发行募集,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。

#### 6.4.4 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的说明

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	32,387,887.59
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	32,387,887.59

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	73,197,796.41	75,131,087.76	1,933,291.35
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	73,197,796.41	75,131,087.76	1,933,291.35

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	8,302.68
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	481.90
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	68.00
合计	8,852.58

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	137,596.56

银行间市场应付交易费用	-
合计	137,596.56

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	88.43
预提审计费用	29,752.78
预提信息披露费	49,588.57
合计	79,429.78

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	124,832,251.06	124,832,251.06
本期申购	84,487,065.85	84,487,065.85
本期赎回(以“-”号填列)	-86,471,973.17	-86,471,973.17
- 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	122,847,343.74	122,847,343.74

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。

#### 6.4.7.10 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	7,782,554.84	-2,066,355.83	5,716,199.01
本期利润	-6,834,407.78	2,911,622.72	-3,922,785.06
本期基金份额交易产生的变动数	36,261.21	-98,943.26	-62,682.05
其中：基金申购款	6,328,595.51	-1,895,539.88	4,433,055.63
基金赎回款	-6,292,334.30	1,796,596.62	-4,495,737.68

本期已分配利润	-	-	-
本期末	984,408.27	746,323.63	1,730,731.90

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	193,133.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,849.49
其他	6,581.98
合计	205,565.39

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	519,016,346.64
减：卖出股票成本总额	524,605,361.82
买卖股票差价收入	-5,589,015.18

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末持有债券。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末进行权证投资。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期未进行其他衍生工具投资。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	452,187.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	452,187.47

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	2,911,622.72
——股票投资	2,911,622.72
——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	2,911,622.72

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	128,120.61
转换费	58,692.81
其他	-
合计	186,813.42

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	839,858.00
银行间市场交易费用	-
合计	839,858.00

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
银行汇划费用	3,282.16
其他费用	300.00
帐户维护费	18,000.00
-	-
合计	100,923.51

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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1月1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	1,027,697,998.59	100.00%	1,026,600,755.11	94.68%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

##### 6.4.10.1.3 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1月1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	-	-	1,013,500,000.00	100.00%

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 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。

##### 6.4.10.1.5 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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		的比例		总额的比例
东吴证券股份有限公司	230,023.98	100.00%	137,596.56	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 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1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	985,009.20	1,755,482.54
其中：支付销售机构的客户维护费	172,022.40	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 × 1.5% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 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1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	164,168.17	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 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

**6.4.10.3 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 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。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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1月1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
中国建设银行股份有限公司	32,387,887.59	193,133.92	117,514,772.12	494,654.08

**6.4.10.6 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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的证券。

**6.4.12.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----



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	32,900	808,906.00	820,855.00	-
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	27.74	18,062	585,810.26	556,670.84	-
600764	中电 广通	2017 年 6 月 29 日	重 大 资 产 重 组	33.25	2017 年 7 月 7 日	33.98	10,600	337,067.82	352,450.00	-
601872	招商 轮船	2017 年 5 月 2 日	重 大 事 项 停 牌	5.16	-	-	59,600	325,094.45	307,536.00	-
000099	中信 海直	2017 年 5 月 4 日	重 大 资 产 重 组	11.26	-	-	25,800	317,397.72	290,508.00	-
601088	中国 神华	2017 年 6 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	22.29	-	-	11,500	246,537.00	256,335.00	-
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	324,588.98	256,032.00	-
600100	同方 股份	2017 年 4	重 大	14.12	-	-	10,700	149,636.50	151,084.00	-

		月 21 日	资产重组								
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	17,300	105,796.82	92,555.00	-	
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大资产重组	6.21	-	-	12,100	91,369.45	75,141.00	-	
000032	深桑达 A	2017 年 2 月 27 日	重大资产重组	15.69	-	-	4,200	64,779.09	65,898.00	-	
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大资产重组	10.57	-	-	3,777	39,575.43	39,922.89	-	
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重大资产重组	13.48	-	-	2,000	43,827.93	26,960.00	-	
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大资产重组	30.68	-	-	500	16,400.00	15,340.00	-	
000885	同力水泥	2017 年 5 月 8 日	重大事项	19.29	2017 年 7 月 20 日	21.22	700	19,431.99	13,503.00	-	

			停牌							
002447	壹桥股份	2017年5月2日	重大资产重组	9.00	-	-	1,100	10,442.66	9,900.00	-
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	1,400	11,088.00	9,548.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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、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、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。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。

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。

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。

#### 6.4.13.2 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 - 中国农业银行股份有限公司。本基金认为与中国农业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。

#### 6.4.13.3 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合规风控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约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约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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	32,387,887.59	-	-	-	-	-	32,387,887.59
清算备付金	1,070,746.44	-	-	-	-	-	1,070,746.44
存出保证金	151,122.63	-	-	-	-	-	151,122.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-75,131,087.76	75,131,087.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-16,248,054.52	16,248,054.52
应收利息	-	-	-	-	-	8,852.58	8,852.58
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	398.36	398.36
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,609,756.66	-	-	-	-	-91,388,393.22	124,998,149.88
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,929.66	25,929.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	151,815.61	151,815.61
应付托管费	-	-	-	-	-	25,302.63	25,302.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	137,596.56	137,596.56
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	79,429.78	79,429.78
负债总计	-	-	-	-	-	420,074.24	420,074.24
利率敏感度缺口	33,609,756.66	-	-	-	-	-90,968,318.98	124,578,075.64
上年度末 2016 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	41,921,794.59	-	-	-	-	-	41,921,794.59
清算备付金	826,101.67	-	-	-	-	-	826,101.67
存出保证金	177,997.48	-	-	-	-	-	177,997.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-86,674,570.84	86,674,570.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,026,522.31	2,026,522.31
应收利息	-	-	-	-	-	10,953.77	10,953.77

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	797.91	797.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	42,925,893.74	-	-	-	-	-88,712,844.83	131,638,738.57
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	660,859.65	660,859.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	171,304.14	171,304.14
应付托管费	-	-	-	-	-	28,550.68	28,550.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	68,331.83	68,331.83
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	161,242.20	161,242.20
负债总计	-	-	-	-	-	1,090,288.50	1,090,288.50
利率敏感度缺口	42,925,893.74	-	-	-	-	-87,622,556.33	130,548,450.07

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

本基金管理人合规风控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价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	75,131,087.76	60.31	86,674,570.84	66.39
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	75,131,087.76	60.31	86,674,570.84	66.39

本基金投资组合中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。

#### 6.4.13.4.3.2 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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-1,494,936.91	-429,373.85
	2. 业绩基准下跌 5%	-7,474,684.54	-2,146,869.26
	3. 业绩基准下跌 10%	-14,949,369.08	-4,293,738.52



注：报告期内，本基金 2017 年 beta 值为 1.20，2016 年为 0.33。

#### **6.4.14 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	75,131,087.76	60.11
	其中：股票	75,131,087.76	60.11
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	33,458,634.03	26.77
7	其他各项资产	16,408,428.09	13.13
8	合计	124,998,149.88	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	435,330.00	0.35
B	采矿业	2,804,468.57	2.25
C	制造业	41,551,048.69	33.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,795,102.00	1.44
E	建筑业	2,381,384.48	1.91
F	批发和零售业	7,296,036.23	5.86
G	交通运输、仓储和邮政业	4,205,138.27	3.38
H	住宿和餐饮业	275,847.63	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,215,654.89	0.98
J	金融业	6,526,672.20	5.24
K	房地产业	3,164,240.18	2.54
L	租赁和商务服务业	827,883.00	0.66

M	科学研究和技术服务业	95,760.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,314,188.00	1.05
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	1,052,405.62	0.84
S	综合	189,928.00	0.15
	合计	75,131,087.76	60.31

### 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	601607	上海医药	41,800	1,207,184.00	0.97
2	000028	国药一致	13,368	1,081,471.20	0.87
3	000768	中航飞机	52,126	961,203.44	0.77
4	600161	天坛生物	23,854	925,773.74	0.74
5	000338	潍柴动力	66,600	879,120.00	0.71
6	002025	航天电器	32,900	820,855.00	0.66
7	600153	建发股份	57,500	743,475.00	0.60
8	600879	航天电子	78,300	688,257.00	0.55
9	600316	洪都航空	42,800	687,796.00	0.55
10	600893	航发动力	24,600	671,580.00	0.54
11	600765	中航重机	48,500	668,330.00	0.54
12	600372	中航电子	38,082	661,484.34	0.53
13	600855	航天长峰	31,100	658,698.00	0.53
14	600435	北方导航	44,300	633,933.00	0.51
15	600061	国投安信	39,600	615,780.00	0.49
16	600030	中信证券	35,000	595,700.00	0.48
17	002383	合众思壮	37,500	587,625.00	0.47
18	600501	航天晨光	38,200	571,090.00	0.46
19	002179	中航光电	18,200	567,658.00	0.46
20	601166	兴业银行	33,100	558,066.00	0.45
21	002049	紫光国芯	18,062	556,670.84	0.45

22	600562	国睿科技	20,000	550,800.00	0.44
23	600068	葛洲坝	48,902	549,658.48	0.44
24	600115	东方航空	80,600	548,080.00	0.44
25	300114	中航电测	40,100	540,548.00	0.43
26	300034	钢研高纳	33,500	529,635.00	0.43
27	600071	凤凰光学	23,301	528,233.67	0.42
28	600755	厦门国贸	57,100	520,752.00	0.42
29	000938	紫光股份	8,400	513,408.00	0.41
30	600426	华鲁恒升	40,330	473,474.20	0.38
31	000488	晨鸣纸业	36,500	470,850.00	0.38
32	000001	平安银行	50,100	470,439.00	0.38
33	600835	上海机电	22,100	467,194.00	0.38
34	000813	德展健康	53,600	462,568.00	0.37
35	600729	重庆百货	17,200	461,648.00	0.37
36	002415	海康威视	14,200	458,660.00	0.37
37	600622	嘉宝集团	28,025	456,247.00	0.37
38	300003	乐普医疗	20,330	449,496.30	0.36
39	600790	轻纺城	65,700	447,417.00	0.36
40	000568	泸州老窖	8,500	429,930.00	0.35
41	600111	北方稀土	36,620	414,904.60	0.33
42	600704	物产中大	56,200	409,698.00	0.33
43	601118	海南橡胶	72,000	408,960.00	0.33
44	600056	中国医药	15,700	407,415.00	0.33
45	600104	上汽集团	13,100	406,755.00	0.33
46	600663	陆家嘴	17,100	404,244.00	0.32
47	300516	久之洋	6,300	399,987.00	0.32
48	000547	航天发展	37,800	395,010.00	0.32
49	600760	中航黑豹	11,800	390,816.00	0.31
50	600820	隧道股份	38,000	383,800.00	0.31
51	600585	海螺水泥	16,300	370,499.00	0.30
52	000688	建新矿业	46,100	368,800.00	0.30
53	300232	洲明科技	22,700	363,200.00	0.29
54	000983	西山煤电	41,200	361,324.00	0.29
55	601211	国泰君安	17,600	360,976.00	0.29
56	002223	鱼跃医疗	15,200	359,936.00	0.29
57	600742	一汽富维	18,800	359,268.00	0.29
58	000666	经纬纺机	15,700	357,018.00	0.29
59	000759	中百集团	40,541	355,949.98	0.29
60	000651	格力电器	8,600	354,062.00	0.28

61	600764	中电广通	10,600	352,450.00	0.28
62	000069	华侨城 A	34,800	350,088.00	0.28
63	000006	深振业 A	39,600	348,876.00	0.28
64	601958	金铂股份	48,221	345,744.57	0.28
65	000425	徐工机械	91,700	343,875.00	0.28
66	300097	智云股份	12,700	342,900.00	0.28
67	000786	北新建材	21,600	342,144.00	0.27
68	600362	江西铜业	20,200	340,572.00	0.27
69	000589	黔轮胎 A	61,300	340,215.00	0.27
70	600685	中船防务	12,400	339,512.00	0.27
71	600958	东方证券	24,200	336,622.00	0.27
72	600037	歌华有线	23,100	336,336.00	0.27
73	600176	中国巨石	30,500	334,890.00	0.27
74	601901	方正证券	33,700	334,641.00	0.27
75	000625	长安汽车	22,500	324,450.00	0.26
76	000895	双汇发展	13,550	321,812.50	0.26
77	000090	天健集团	28,900	320,790.00	0.26
78	600897	厦门空港	12,592	319,584.96	0.26
79	002643	万润股份	21,500	317,340.00	0.25
80	000039	中集集团	17,600	317,328.00	0.25
81	600600	青岛啤酒	9,000	315,900.00	0.25
82	000538	云南白药	3,300	309,705.00	0.25
83	600739	辽宁成大	17,135	308,944.05	0.25
84	000581	威孚高科	11,900	308,210.00	0.25
85	601872	招商轮船	59,600	307,536.00	0.25
86	600859	王府井	19,000	306,850.00	0.25
87	600188	兖州煤业	24,400	298,656.00	0.24
88	600332	白云山	10,055	291,997.20	0.23
89	000099	中信海直	25,800	290,508.00	0.23
90	601668	中国建筑	29,900	289,432.00	0.23
91	601688	华泰证券	15,900	284,610.00	0.23
92	600019	宝钢股份	41,912	281,229.52	0.23
93	601398	工商银行	52,900	277,725.00	0.22
94	600343	航天动力	15,700	272,238.00	0.22
95	002030	达安基因	12,329	268,648.91	0.22
96	600486	扬农化工	6,300	265,923.00	0.21
97	000060	中金岭南	23,600	264,320.00	0.21
98	000430	张家界	24,700	261,820.00	0.21
99	000565	渝三峡 A	25,400	261,620.00	0.21

100	002230	科大讯飞	6,500	259,350.00	0.21
101	601801	皖新传媒	18,700	258,434.00	0.21
102	600990	四创电子	4,158	257,754.42	0.21
103	002114	罗平锌电	13,000	257,270.00	0.21
104	600969	郴电国际	18,100	257,020.00	0.21
105	601088	中国神华	11,500	256,335.00	0.21
106	000610	西安旅游	22,400	256,032.00	0.21
107	600981	汇鸿集团	34,300	254,163.00	0.20
108	601601	中国太保	7,500	254,025.00	0.20
109	600064	南京高科	16,800	253,680.00	0.20
110	600741	华域汽车	9,600	232,704.00	0.19
111	601006	大秦铁路	27,400	229,886.00	0.18
112	600269	赣粤高速	42,300	220,383.00	0.18
113	000826	启迪桑德	6,200	217,744.00	0.17
114	600017	日照港	48,300	217,350.00	0.17
115	000801	四川九洲	22,500	215,325.00	0.17
116	600521	华海药业	10,193	214,460.72	0.17
117	601888	中国国旅	7,100	213,994.00	0.17
118	000858	五粮液	3,800	211,508.00	0.17
119	600570	恒生电子	4,500	210,060.00	0.17
120	000002	万科 A	8,400	209,748.00	0.17
121	000630	铜陵有色	73,100	207,604.00	0.17
122	600420	现代制药	13,100	205,539.00	0.16
123	601899	紫金矿业	59,700	204,771.00	0.16
124	601857	中国石油	26,600	204,554.00	0.16
125	600189	吉林森工	19,600	204,428.00	0.16
126	000050	深天马 A	9,900	203,643.00	0.16
127	600535	天士力	4,900	203,546.00	0.16
128	600827	百联股份	12,500	203,125.00	0.16
129	600085	同仁堂	5,800	202,768.00	0.16
130	002385	大北农	32,200	202,538.00	0.16
131	600271	航天信息	9,800	202,272.00	0.16
132	002450	康得新	8,900	200,428.00	0.16
133	000999	华润三九	6,300	200,025.00	0.16
134	300336	新文化	12,900	199,434.00	0.16
135	002343	慈文传媒	5,267	199,408.62	0.16
136	000725	京东方 A	47,900	199,264.00	0.16
137	600352	浙江龙盛	20,900	199,177.00	0.16
138	600686	金龙汽车	14,900	198,170.00	0.16

139	000761	本钢板材	37,700	197,171.00	0.16
140	000886	海南高速	39,400	195,424.00	0.16
141	600262	北方股份	7,200	195,192.00	0.16
142	600198	大唐电信	15,200	194,104.00	0.16
143	002393	力生制药	5,400	193,698.00	0.16
144	000596	古井贡酒	3,800	193,610.00	0.16
145	601965	中国汽研	20,600	193,434.00	0.16
146	600060	海信电器	12,700	192,659.00	0.15
147	601328	交通银行	31,000	190,960.00	0.15
148	600894	广日股份	16,100	190,624.00	0.15
149	600125	铁龙物流	21,200	189,952.00	0.15
150	600150	中国船舶	8,300	189,821.00	0.15
151	001896	豫能控股	26,800	188,136.00	0.15
152	600118	中国卫星	6,753	188,003.52	0.15
153	600862	中航高科	19,400	187,986.00	0.15
154	600096	云天化	25,400	187,960.00	0.15
155	600073	上海梅林	19,600	187,180.00	0.15
156	601198	东兴证券	10,800	186,192.00	0.15
157	000537	广宇发展	22,300	183,083.00	0.15
158	600006	东风汽车	31,000	181,350.00	0.15
159	600697	欧亚集团	6,400	180,224.00	0.14
160	000429	粤高速 A	21,000	179,340.00	0.14
161	600639	浦东金桥	9,886	179,134.32	0.14
162	600023	浙能电力	32,800	179,088.00	0.14
163	600837	海通证券	11,900	176,715.00	0.14
164	600018	上港集团	27,500	174,350.00	0.14
165	600782	新钢股份	47,600	173,740.00	0.14
166	000501	鄂武商 A	9,300	171,678.00	0.14
167	600848	上海临港	7,931	170,992.36	0.14
168	600604	市北高新	23,900	170,885.00	0.14
169	600270	外运发展	8,967	169,745.31	0.14
170	000776	广发证券	9,600	165,600.00	0.13
171	600015	华夏银行	17,960	165,591.20	0.13
172	600511	国药股份	4,300	155,832.00	0.13
173	600963	岳阳林纸	20,200	152,106.00	0.12
174	601186	中国铁建	12,600	151,578.00	0.12
175	600100	同方股份	10,700	151,084.00	0.12
176	000663	永安林业	11,100	148,740.00	0.12
177	601618	中国中冶	29,500	147,795.00	0.12

178	600418	江淮汽车	13,900	146,645.00	0.12
179	601866	中远海发	40,700	146,520.00	0.12
180	000899	赣能股份	17,200	145,340.00	0.12
181	600141	兴发集团	11,500	142,255.00	0.11
182	000708	大冶特钢	12,100	140,360.00	0.11
183	002267	陕天然气	15,900	139,761.00	0.11
184	601179	中国西电	24,700	137,332.00	0.11
185	000930	中粮生化	12,700	136,906.00	0.11
186	600222	太龙药业	22,000	136,840.00	0.11
187	601333	广深铁路	30,200	136,504.00	0.11
188	000151	中成股份	7,200	135,216.00	0.11
189	002033	丽江旅游	13,200	134,904.00	0.11
190	600825	新华传媒	19,000	134,710.00	0.11
191	600651	飞乐音响	15,900	134,673.00	0.11
192	600369	西南证券	24,000	134,640.00	0.11
193	000852	石化机械	8,800	134,288.00	0.11
194	600662	强生控股	16,700	134,101.00	0.11
195	600705	中航资本	23,700	133,905.00	0.11
196	000783	长江证券	14,100	133,527.00	0.11
197	601800	中国交建	8,400	133,476.00	0.11
198	600833	第一医药	7,800	133,224.00	0.11
199	601377	兴业证券	17,900	132,997.00	0.11
200	600776	东方通信	19,400	131,532.00	0.11
201	600026	中远海能	19,000	125,970.00	0.10
202	600895	张江高科	7,300	123,224.00	0.10
203	600395	盘江股份	16,800	123,144.00	0.10
204	600987	航民股份	9,400	121,824.00	0.10
205	600011	华能国际	16,500	121,110.00	0.10
206	002449	国星光电	7,300	120,815.00	0.10
207	600428	中远海特	19,200	119,424.00	0.10
208	601007	金陵饭店	10,189	118,905.63	0.10
209	601985	中国核电	14,900	116,369.00	0.09
210	601098	中南传媒	6,000	111,840.00	0.09
211	000792	盐湖股份	10,700	111,815.00	0.09
212	600028	中国石化	18,800	111,484.00	0.09
213	600754	锦江股份	4,100	111,110.00	0.09
214	000839	中信国安	11,100	110,889.00	0.09
215	000016	深康佳 A	21,836	106,778.04	0.09
216	601009	南京银行	9,500	106,495.00	0.09



217	000030	富奥股份	11,800	105,492.00	0.08
218	000928	中钢国际	11,100	105,006.00	0.08
219	600597	光明乳业	8,200	104,550.00	0.08
220	600009	上海机场	2,800	104,468.00	0.08
221	601238	广汽集团	4,000	104,240.00	0.08
222	600373	中文传媒	4,400	103,444.00	0.08
223	600309	万华化学	3,600	103,104.00	0.08
224	002038	双鹭药业	3,500	102,025.00	0.08
225	600886	国投电力	12,900	101,910.00	0.08
226	600048	保利地产	10,200	101,694.00	0.08
227	601669	中国电建	12,800	101,376.00	0.08
228	600547	山东黄金	3,500	101,255.00	0.08
229	600276	恒瑞医药	2,000	101,180.00	0.08
230	002470	金正大	13,400	100,902.00	0.08
231	601699	潞安环能	12,900	100,878.00	0.08
232	000540	中天金融	14,500	100,775.00	0.08
233	600036	招商银行	4,200	100,422.00	0.08
234	600489	中金黄金	10,000	100,300.00	0.08
235	000709	河钢股份	23,900	100,141.00	0.08
236	000732	泰禾集团	6,000	100,080.00	0.08
237	002508	老板电器	2,300	100,004.00	0.08
237	600518	康美药业	4,600	100,004.00	0.08
238	600415	小商品城	13,800	99,912.00	0.08
239	601933	永辉超市	14,100	99,828.00	0.08
240	601628	中国人寿	3,700	99,826.00	0.08
241	601390	中国中铁	11,500	99,705.00	0.08
242	002673	西部证券	7,000	99,540.00	0.08
243	000963	华东医药	2,000	99,400.00	0.08
243	600804	鹏博士	5,600	99,400.00	0.08
244	002736	国信证券	7,500	99,375.00	0.08
245	600690	青岛海尔	6,600	99,330.00	0.08
246	600703	三安光电	5,000	98,500.00	0.08
247	600109	国金证券	8,400	98,448.00	0.08
248	601877	正泰电器	4,900	98,441.00	0.08
249	002475	立讯精密	3,341	97,690.84	0.08
250	601111	中国国航	10,000	97,500.00	0.08
251	002407	多氟多	4,400	96,756.00	0.08
252	600185	格力地产	14,200	96,418.00	0.08
253	600648	外高桥	5,200	96,304.00	0.08

254	600698	湖南天雁	9,900	95,931.00	0.08
255	603698	航天工程	3,800	95,760.00	0.08
256	002100	天康生物	11,900	95,557.00	0.08
257	600008	首创股份	14,400	94,752.00	0.08
258	000758	中色股份	13,500	94,635.00	0.08
259	000523	广州浪奇	9,300	94,395.00	0.08
260	600072	中船科技	5,600	94,192.00	0.08
261	600809	山西汾酒	2,700	93,663.00	0.08
262	603199	九华旅游	2,400	93,600.00	0.08
263	601919	中远海控	17,300	92,555.00	0.07
264	000757	浩物股份	12,800	92,416.00	0.07
265	600081	东风科技	7,400	92,130.00	0.07
266	600787	中储股份	11,600	91,756.00	0.07
267	601818	光大银行	22,600	91,530.00	0.07
268	600287	江苏舜天	11,700	91,494.00	0.07
269	601898	中煤能源	15,400	90,552.00	0.07
270	000536	华映科技	15,500	90,055.00	0.07
271	000411	英特集团	4,100	89,708.00	0.07
272	002481	双塔食品	13,330	88,911.10	0.07
273	000868	安凯客车	16,700	88,844.00	0.07
274	600517	置信电气	11,500	87,055.00	0.07
275	600283	钱江水利	7,500	86,775.00	0.07
276	600199	金种子酒	10,900	86,437.00	0.07
277	002614	奥佳华	4,700	85,446.00	0.07
278	000957	中通客车	7,300	85,410.00	0.07
279	600029	南方航空	9,800	85,260.00	0.07
280	000019	深深宝 A	6,940	84,459.80	0.07
281	600779	水井坊	3,300	81,114.00	0.07
282	600642	申能股份	12,600	79,380.00	0.06
283	000701	厦门信达	6,300	78,750.00	0.06
284	000089	深圳机场	8,400	78,540.00	0.06
285	002304	洋河股份	900	78,129.00	0.06
286	000777	中核科技	3,800	75,848.00	0.06
287	600999	招商证券	4,400	75,768.00	0.06
288	000728	国元证券	6,200	75,764.00	0.06
289	601989	中国重工	12,100	75,141.00	0.06
290	300140	中环装备	4,000	71,600.00	0.06
291	000685	中山公用	6,500	71,175.00	0.06
292	300142	沃森生物	5,700	70,452.00	0.06

293	601718	际华集团	7,902	69,458.58	0.06
294	000598	兴蓉环境	12,200	68,564.00	0.06
295	600761	安徽合力	5,200	68,120.00	0.05
296	600325	华发股份	8,060	67,301.00	0.05
297	600455	博通股份	1,600	66,704.00	0.05
298	002344	海宁皮城	8,000	66,560.00	0.05
299	600702	沱牌舍得	2,501	66,551.61	0.05
300	000032	深桑达 A	4,200	65,898.00	0.05
301	601992	金隅股份	10,100	65,347.00	0.05
302	600016	民生银行	7,900	64,938.00	0.05
303	603019	中科曙光	2,300	64,722.00	0.05
304	600555	海航创新	12,855	60,418.50	0.05
305	000922	*ST 佳电	7,700	57,519.00	0.05
306	002152	广电运通	6,600	54,846.00	0.04
307	601199	江南水务	7,800	53,586.00	0.04
308	300073	当升科技	2,100	52,374.00	0.04
309	601988	中国银行	13,500	49,950.00	0.04
310	600406	国电南瑞	2,800	49,420.00	0.04
311	002466	天齐锂业	900	48,915.00	0.04
312	002611	东方精工	3,400	48,756.00	0.04
313	002580	圣阳股份	6,000	47,940.00	0.04
314	600399	抚顺特钢	7,600	47,424.00	0.04
315	300376	易事特	5,200	47,164.00	0.04
316	600340	华夏幸福	1,400	47,012.00	0.04
317	600970	中材国际	5,400	46,926.00	0.04
318	002497	雅化集团	4,800	46,560.00	0.04
319	600480	凌云股份	2,200	46,398.00	0.04
320	002732	燕塘乳业	1,600	46,128.00	0.04
321	002662	京威股份	6,400	46,080.00	0.04
322	300037	新宙邦	2,000	45,960.00	0.04
323	601139	深圳燃气	5,300	45,845.00	0.04
324	000524	岭南控股	3,400	45,832.00	0.04
325	002190	成飞集成	1,700	45,560.00	0.04
326	002709	天赐材料	1,100	45,287.00	0.04
327	600386	北巴传媒	3,400	45,220.00	0.04
328	600135	乐凯胶片	2,900	45,211.00	0.04
329	000892	欢瑞世纪	4,500	45,135.00	0.04
330	300224	正海磁材	5,000	45,000.00	0.04
331	600650	锦江投资	2,500	44,850.00	0.04

332	600552	凯盛科技	5,600	43,232.00	0.03
333	000778	新兴铸管	6,300	42,210.00	0.03
334	600348	阳泉煤业	6,200	42,036.00	0.03
335	600959	江苏有线	3,777	39,922.89	0.03
336	600350	山东高速	6,200	38,440.00	0.03
337	601288	农业银行	10,700	37,664.00	0.03
338	600543	莫高股份	3,100	37,634.00	0.03
339	600834	申通地铁	2,500	31,400.00	0.03
340	600654	*ST 中安	2,000	26,960.00	0.02
341	002544	杰赛科技	1,100	25,080.00	0.02
342	300315	掌趣科技	2,900	23,664.00	0.02
343	002276	万马股份	2,300	23,207.00	0.02
344	002074	国轩高科	700	22,085.00	0.02
345	002108	沧州明珠	1,600	21,360.00	0.02
346	000828	东莞控股	1,700	20,400.00	0.02
347	600850	华东电脑	900	19,233.00	0.02
348	601998	中信银行	2,900	18,241.00	0.01
349	600533	栖霞建设	3,100	18,228.00	0.01
350	600744	华银电力	3,600	17,712.00	0.01
351	002321	华英农业	1,500	16,470.00	0.01
352	600668	尖峰集团	900	15,462.00	0.01
353	300104	乐视网	500	15,340.00	0.01
354	000885	同力水泥	700	13,503.00	0.01
355	000027	深圳能源	1,900	12,787.00	0.01
356	600461	洪城水业	1,700	12,257.00	0.01
357	000920	南方汇通	920	11,444.80	0.01
358	601018	宁波港	1,900	10,735.00	0.01
359	002447	壹桥股份	1,100	9,900.00	0.01
360	002312	*ST 三泰	1,400	9,548.00	0.01
361	000619	海螺型材	1,000	9,390.00	0.01
362	600796	钱江生化	1,000	8,400.00	0.01
363	600039	四川路桥	1,100	4,576.00	0.00
364	600187	国中水务	700	3,535.00	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	600897	厦门空港	3,269,200.18	2.50
2	000089	深圳机场	3,209,977.00	2.46
3	601668	中国建筑	3,164,876.00	2.42
4	600685	中船防务	2,981,167.97	2.28
5	600150	中国船舶	2,822,880.00	2.16
6	600459	贵研铂业	2,772,096.00	2.12
7	300114	中航电测	2,720,278.18	2.08
8	600435	北方导航	2,647,255.00	2.03
9	600111	北方稀土	2,601,290.40	1.99
10	600562	国睿科技	2,586,820.20	1.98
11	601989	中国重工	2,573,789.00	1.97
12	600990	四创电子	2,547,730.69	1.95
13	600262	北方股份	2,510,878.12	1.92
14	600456	宝钛股份	2,425,887.92	1.86
15	600585	海螺水泥	2,381,619.00	1.82
16	600667	太极实业	2,378,900.00	1.82
17	601186	中国铁建	2,361,036.00	1.81
18	601958	金钼股份	2,339,922.00	1.79
19	600125	铁龙物流	2,324,955.00	1.78
20	600028	中国石化	2,275,835.00	1.74

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	3,969,903.84	3.04
2	600150	中国船舶	3,956,516.42	3.03
3	601668	中国建筑	3,321,646.01	2.54
4	601989	中国重工	3,257,078.00	2.49

5	000089	深圳机场	3,165,694.92	2.42
6	300114	中航电测	2,871,946.95	2.20
7	600897	厦门空港	2,847,701.30	2.18
8	600688	上海石化	2,811,033.00	2.15
9	600028	中国石化	2,805,506.40	2.15
10	600459	贵研铂业	2,583,913.92	1.98
11	600125	铁龙物流	2,510,109.43	1.92
12	601857	中国石油	2,503,865.00	1.92
13	600990	四创电子	2,458,965.97	1.88
14	600987	航民股份	2,455,364.00	1.88
15	600435	北方导航	2,373,196.40	1.82
16	600667	太极实业	2,329,375.24	1.78
17	600992	贵绳股份	2,322,537.66	1.78
18	600456	宝钛股份	2,287,905.32	1.75
19	600562	国睿科技	2,262,535.00	1.73
20	601669	中国电建	2,230,156.00	1.71

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	509,979,553.02
卖出股票收入（成交）总额	519,016,346.64

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	151,122.63
2	应收证券清算款	16,248,054.52
3	应收股利	-
4	应收利息	8,852.58
5	应收申购款	398.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,408,428.09

#### 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	002025	航天电器	820,855.00	0.66	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
792	155,110.28	72,214,686.75	58.78%	50,632,656.99	41.22%

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	20,844.26	0.0170%

### 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	124,832,251.06
本报告期基金总申购份额	84,487,065.85
减：本报告期基金总赎回份额	86,471,973.17
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	122,847,343.74

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、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	21,027,697,998.59		100.00%	230,023.98	100.00%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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

本基金本报告期无证券公司交易单元的变更。

## 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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

## 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管理的基金 2016 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、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 1 月 3 日
2	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
3	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	中国证券报、公司网站	2017 年 2 月 10 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	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）	2017 年 2 月 23 日
5	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告以及摘要	中国证券报、公司网站	2017 年 3 月 27 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰金融服务（深圳）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）	2017 年 4 月 12 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加奕丰金融服务（深圳）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）	2017 年 4 月 12 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增宜信普泽投资顾问（北京）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）	2017 年 4 月 14 日
9	东吴基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问（北京）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、	2017 年 4 月 14 日

		深交所（巨潮资讯网）	
10	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	2017 年 4 月 19 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	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）	2017 年 4 月 24 日
12	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2017 年 4 月 24 日
13	东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份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）	2017 年 6 月 7 日

## § 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	20170331-20170630	47,213,408.88	0.00	0.00	47,213,408.88	38.44
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。

## § 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

2017年8月25日