

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

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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	69
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.....	69
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.12 投资组合报告附注.....	69
§8 基金份额持有人信息.....	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
§9 开放式基金份额变动.....	72
§10 重大事件揭示.....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录.....	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴安盈量化
场内简称	-
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
注册地址	上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200135	200120
法定代表人	王炯	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报
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	-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
本期加权平均净值利润率	-2.48%
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)
期末可供分配利润	6,018,952.51
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
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	1.80%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	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	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%

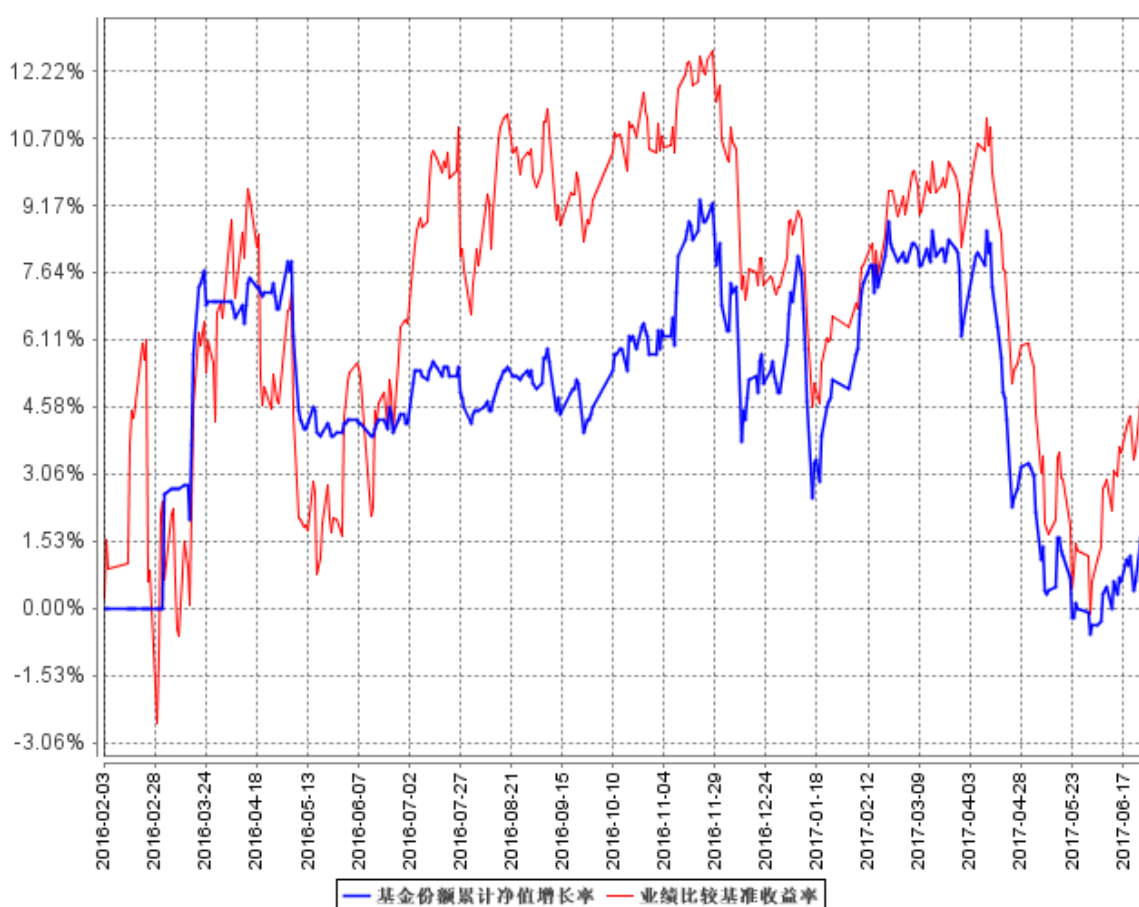
过去一年	-2.30%	0.52%	-1.07%	0.60%	-1.23%	-0.08%
自基金合同生效起至今	1.80%	0.52%	5.14%	0.87%	-3.34%	-0.35%

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 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		
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、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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	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	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		353,110,430.55	470,287,401.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	128,929.92	160,016.96
负债合计		957,468.90	941,581.07
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	346,009,855.77	447,272,411.62
未分配利润	6.4.7.10	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	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 2 月 3 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-18,038,671.94	-4,623,260.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	69,656.70	-52,665.61
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	1,183,542.71	143,283.92
1) 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	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“-”	6.4.7.17	207,170.82	896,979.35

号填列)			
减：二、费用		5,916,247.30	1,910,307.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,145,659.76	1,002,371.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	524,276.61	167,062.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	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	6.4.7.20	149,474.92	129,434.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,456,398.55	-4,409,162.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-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(基金净值)	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
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	48,918,912.35
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	48,918,912.35

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	238,927,946.76	243,400,752.98	4,472,806.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	10,278,290.42	10,154,000.00	-124,290.42
	银行间市场	9,768,913.64	9,825,000.00	56,086.36
	合计	20,047,204.06	19,979,000.00	-68,204.06
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	258,975,150.82	263,379,752.98	4,404,602.16

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_银行间	19,982,129.99	-
合计	19,982,129.99	-

6.4.7.4.2 期末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	12,577.33
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	831.15
应收债券利息	670,913.39
应收买入返售证券利息	1,708.52
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	202.14
合计	686,232.53

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	308,911.68
银行间市场应付交易费用	6,379.20
合计	315,290.88

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	-
预提信息披露费	29,752.78
预提审计费	99,177.14
合计	128,929.92

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	447,272,411.62	447,272,411.62
本期申购	10,025,121.56	10,025,121.56
本期赎回(以“-”号填列)	-111,287,677.41	-111,287,677.41
- 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	346,009,855.77	346,009,855.77

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则本期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，则本期赎回份额中包含该业务。

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	35,778,682.97	-13,705,274.63	22,073,408.34
本期利润	-21,443,038.89	10,986,640.34	-10,456,398.55
本期基金份额交易产生的变动数	-8,316,691.57	2,842,787.66	-5,473,903.91
其中：基金申购款	722,208.76	-441,309.04	280,899.72
基金赎回款	-9,038,900.33	3,284,096.70	-5,754,803.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,018,952.51	124,153.37	6,143,105.88

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	422,283.49
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	42,708.33
其他	3,781.00
合计	468,772.82

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	1,303,545,811.22
减：卖出股票成本总额	1,321,584,483.16
买卖股票差价收入	-18,038,671.94

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,267,500.40

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,101,656.93
减：应收利息总额	96,186.77
买卖债券差价收入	69,656.70

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 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

本基金本报告期末未进行权证投资。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.15 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	1,183,542.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,183,542.71

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	10,986,640.34
——股票投资	11,054,844.40
——债券投资	-68,204.06
——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	10,986,640.34

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	207,159.70
转换费	11.12
其他	-
合计	207,170.82

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	2,096,352.01
银行间市场交易费用	484.00
合计	2,096,836.01

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	99,177.14
银行汇划费用	2,245.00
其他费用	300.00
帐户维护费	18,000.00
合计	149,474.92

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
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。

6.4.10 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%

6.4.10.1.2 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%

6.4.10.1.3 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%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.2 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 × 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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

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：本基金本报告期内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

6.4.10.6 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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

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	-

6.4.12.2 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
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	-

			组							
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	2017	重	6.82	2017	7.16	63,500	502,158.00	433,070.00	-

	三泰	年 3 月 31 日	大资产重组		年 7 月 24 日					
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	12.75	2017 年 7 月 12 日	12.00	21,000	298,350.50	267,750.00	-

		日	产 重 组		日					
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	2017	重	7.91	-	-	19,000	148,903.00	150,290.00	-

	资源	年 2 月 21 日	大资产重组							
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	23.26	2017 年 7 月 27 日	19.49	4,800	135,840.45	111,648.00	-

		日	项		日					
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	10.94	-	-	3,500	45,890.83	38,290.00	-

600255	鑫科材料	2017年6月26日	牌 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	鑫茂科技	2017年5月24日	重 大 资 产 重 组	6.05	-	-	4,000	33,510.41	24,200.00	-
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	-

6.4.12.3 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、股指期货、权证、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以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相

关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金通过灵活应用选股、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。

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。

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 - 交通银行股份有限公司。本基金认为与交通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风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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	48,918,912.35	-	-	-	-	-	48,918,912.35
清算备付金	2,052,284.28	-	-	-	-	-	2,052,284.28
存出保证金	499,153.52	-	-	-	-	-	499,153.52
交易性金融资产	9,825,000.00	-	-	10,154,000.00	-	-243,400,752.98	263,379,752.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	19,982,129.99	-	-	-	-	-	19,982,129.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	17,591,964.90	17,591,964.90
应收利息	-	-	-	-	-	686,232.53	686,232.53
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	81,277,480.14	-	-	10,154,000.00	-	-261,678,950.41	353,110,430.55
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	10,129.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	431,244.92	431,244.92
应付托管费	-	-	-	-	-	71,874.15	71,874.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	315,290.88	315,290.88
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	128,929.92	128,929.92
负债总计	-	-	-	-	-	957,468.90	957,468.90
利率敏感度缺口	81,277,480.14	-	-	10,154,000.00	-	-260,721,481.51	352,152,961.65
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	55,035,900.82	-	-	-	-	-	55,035,900.82
清算备付金	1,950,291.98	-	-	-	-	-	1,950,291.98
存出保证金	440,400.08	-	-	-	-	-	440,400.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-314,551,959.01	314,551,959.01

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	96,400,464.60	-	-	-	-	-	96,400,464.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,865,811.78	1,865,811.78
应收利息	-	-	-	-	-	42,572.76	42,572.76
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	153,827,057.48	-	-	-	-	-316,460,343.55	470,287,401.03
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,502.10	4,502.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	469,459.06	469,459.06
应付托管费	-	-	-	-	-	78,243.15	78,243.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	229,359.80	229,359.80
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	160,016.96	160,016.96
负债总计	-	-	-	-	-	941,581.07	941,581.07
利率敏感度缺口	153,827,057.48	-	-	-	-	-315,518,762.48	469,345,819.96

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	24,079.38	-
	利率上升 25 个基点	-23,962.84	-

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场价格风险。

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	243,400,752.98	69.12	314,551,959.01	67.02
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	243,400,752.98	69.12	314,551,959.01	67.02

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准 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		
	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）	
分析		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%	-3,415,883.73	-1,175,241.93
	2. 业绩基准下跌 5%	-17,079,418.64	-5,876,209.67

	3. 业绩基准下跌 10%	-34,158,837.28	-11,752,419.33
--	---------------	----------------	----------------

注：报告期内，本基金 2017 年 beta 值为 0.97，2016 年为 0.25。

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	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	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
11	601607	上海医药	62,600	1,807,888.00	0.51
12	600435	北方导航	125,800	1,800,198.00	0.51
13	600071	凤凰光学	79,400	1,799,998.00	0.51
14	002027	分众传媒	123,400	1,697,984.00	0.48
15	000666	经纬纺机	73,700	1,675,938.00	0.48
16	000768	中航飞机	84,400	1,556,336.00	0.44
17	600110	诺德股份	104,800	1,476,632.00	0.42
18	002383	合众思壮	94,100	1,474,547.00	0.42
19	300146	汤臣倍健	107,300	1,474,302.00	0.42

20	600229	城市传媒	156,390	1,465,374.30	0.42
21	002174	游族网络	45,597	1,448,160.72	0.41
22	002449	国星光电	85,800	1,419,990.00	0.40
23	600893	航发动力	51,385	1,402,810.50	0.40
24	600765	中航重机	101,200	1,394,536.00	0.40
25	002179	中航光电	43,147	1,345,754.93	0.38
26	002071	长城影视	131,523	1,309,969.08	0.37
27	600061	国投安信	82,776	1,287,166.80	0.37
28	000547	航天发展	123,000	1,285,350.00	0.36
29	600855	航天长峰	59,890	1,268,470.20	0.36
30	000963	华东医药	25,000	1,242,500.00	0.35
31	600790	轻纺城	180,491	1,229,143.71	0.35
32	300336	新文化	79,100	1,222,886.00	0.35
33	002415	海康威视	37,500	1,211,250.00	0.34
34	601098	中南传媒	64,300	1,198,552.00	0.34
35	600760	中航黑豹	35,900	1,189,008.00	0.34
36	300034	钢研高纳	75,100	1,187,331.00	0.34
37	002049	紫光国芯	38,000	1,171,160.00	0.33
38	002223	鱼跃医疗	49,423	1,170,336.64	0.33
39	000338	潍柴动力	87,000	1,148,400.00	0.33
40	300114	中航电测	83,035	1,119,311.80	0.32
41	300071	华谊嘉信	135,400	1,096,740.00	0.31
42	600030	中信证券	61,900	1,053,538.00	0.30
43	000099	中信海直	90,301	1,016,789.26	0.29
44	002195	二三四五	135,580	969,397.00	0.28
45	002030	达安基因	43,900	956,581.00	0.27
46	000651	格力电器	22,800	938,676.00	0.27
47	600512	腾达建设	185,400	914,022.00	0.26
48	600343	航天动力	52,400	908,616.00	0.26
49	300298	三诺生物	54,960	894,199.20	0.25
50	600879	航天电子	101,400	891,306.00	0.25
51	002005	德豪润达	186,000	887,220.00	0.25
52	601211	国泰君安	43,100	883,981.00	0.25
53	600990	四创电子	14,200	880,258.00	0.25
54	601007	金陵饭店	73,500	857,745.00	0.24
55	000568	泸州老窖	16,900	854,802.00	0.24
56	600161	天坛生物	21,970	852,655.70	0.24
57	000895	双汇发展	35,550	844,312.50	0.24
58	002517	恺英网络	23,800	837,522.00	0.24

59	300003	乐普医疗	37,330	825,366.30	0.23
60	600373	中文传媒	35,000	822,850.00	0.23
61	600287	江苏舜天	103,800	811,716.00	0.23
62	300516	久之洋	12,600	799,974.00	0.23
63	600983	惠而浦	73,831	798,851.42	0.23
64	300288	朗玛信息	28,500	793,725.00	0.23
65	300232	洲明科技	49,600	793,600.00	0.23
66	300383	光环新网	57,500	779,700.00	0.22
67	601668	中国建筑	79,900	773,432.00	0.22
68	600998	九州通	35,800	771,848.00	0.22
69	600406	国电南瑞	43,500	767,775.00	0.22
70	600552	凯盛科技	99,400	767,368.00	0.22
71	002106	莱宝高科	74,613	755,829.69	0.21
72	002139	拓邦股份	69,900	752,823.00	0.21
73	000889	茂业通信	45,000	751,950.00	0.21
74	000001	平安银行	79,400	745,566.00	0.21
75	600227	赤天化	111,300	731,241.00	0.21
76	601166	兴业银行	43,200	728,352.00	0.21
77	600572	康恩贝	103,200	714,144.00	0.20
78	002055	得润电子	31,405	713,835.65	0.20
79	600867	通化东宝	38,900	709,536.00	0.20
80	600276	恒瑞医药	14,000	708,260.00	0.20
81	002310	东方园林	41,700	697,224.00	0.20
82	300145	中金环境	41,000	693,720.00	0.20
83	600017	日照港	152,200	684,900.00	0.19
84	000661	长春高新	5,300	684,283.00	0.19
85	601958	金钼股份	95,420	684,161.40	0.19
86	000069	华侨城 A	67,700	681,062.00	0.19
87	002024	苏宁云商	60,100	676,125.00	0.19
88	000538	云南白药	7,200	675,720.00	0.19
89	002253	川大智胜	27,900	669,600.00	0.19
90	601225	陕西煤业	94,100	665,287.00	0.19
91	000090	天健集团	59,700	662,670.00	0.19
92	600068	葛洲坝	58,900	662,036.00	0.19
93	000938	紫光股份	10,800	660,096.00	0.19
94	600518	康美药业	30,200	656,548.00	0.19
95	600576	万家文化	65,100	650,349.00	0.18
96	600663	陆家嘴	27,470	649,390.80	0.18
97	000546	金圆股份	59,165	644,898.50	0.18

98	601999	出版传媒	70,690	644,692.80	0.18
99	600757	长江传媒	86,300	644,661.00	0.18
100	002152	广电运通	77,200	641,532.00	0.18
101	002038	双鹭药业	21,600	629,640.00	0.18
102	600568	中珠医疗	31,900	626,197.00	0.18
103	002261	拓维信息	53,438	625,758.98	0.18
104	603000	人民网	47,400	624,258.00	0.18
105	002181	粤传媒	115,220	623,340.20	0.18
106	300295	三六五网	33,232	621,770.72	0.18
107	300251	光线传媒	75,680	619,819.20	0.18
108	002267	陕天然气	70,300	617,937.00	0.18
109	002614	奥佳华	33,358	606,448.44	0.17
110	600355	精伦电子	69,300	605,682.00	0.17
111	002343	慈文传媒	15,900	601,974.00	0.17
112	600480	凌云股份	28,500	601,065.00	0.17
113	600410	华胜天成	67,700	599,822.00	0.17
114	600270	外运发展	31,600	598,188.00	0.17
115	600222	太龙药业	96,000	597,120.00	0.17
116	601939	建设银行	96,700	594,705.00	0.17
117	000032	深桑达 A	37,805	593,160.45	0.17
118	600115	东方航空	86,800	590,240.00	0.17
119	002245	澳洋顺昌	63,200	570,064.00	0.16
120	000028	国药一致	6,967	563,630.30	0.16
121	002078	太阳纸业	76,100	559,335.00	0.16
122	600741	华域汽车	23,000	557,520.00	0.16
123	600455	博通股份	13,000	541,970.00	0.15
124	002642	荣之联	21,600	541,296.00	0.15
125	002067	景兴纸业	91,800	538,866.00	0.15
126	601006	大秦铁路	63,700	534,443.00	0.15
127	600158	中体产业	30,500	521,550.00	0.15
128	002424	贵州百灵	27,536	519,328.96	0.15
129	000050	深天马 A	25,200	518,364.00	0.15
130	601601	中国太保	15,300	518,211.00	0.15
131	002721	金一文化	34,369	513,129.17	0.15
132	300463	迈克生物	20,000	510,000.00	0.14
133	600088	中视传媒	28,792	504,435.84	0.14
134	600223	鲁商置业	107,700	501,882.00	0.14
135	600565	迪马股份	90,500	498,655.00	0.14
136	600685	中船防务	18,000	492,840.00	0.14

137	002583	海能达	30,560	491,710.40	0.14
138	600508	上海能源	42,100	491,307.00	0.14
139	000719	大地传媒	47,060	490,835.80	0.14
140	002456	欧菲光	27,000	490,590.00	0.14
141	002500	山西证券	50,700	485,706.00	0.14
142	600362	江西铜业	28,600	482,196.00	0.14
143	600486	扬农化工	11,400	481,194.00	0.14
144	600400	红豆股份	69,690	479,467.20	0.14
145	000917	电广传媒	42,400	479,120.00	0.14
146	000802	北京文化	32,800	477,568.00	0.14
147	600325	华发股份	56,880	474,948.00	0.13
148	600764	中电广通	14,200	472,150.00	0.13
149	600808	马钢股份	133,300	471,882.00	0.13
150	600600	青岛啤酒	13,200	463,320.00	0.13
151	300233	金城医药	22,063	463,102.37	0.13
152	600690	青岛海尔	30,700	462,035.00	0.13
153	600729	重庆百货	17,200	461,648.00	0.13
154	002044	美年健康	27,000	459,000.00	0.13
155	600750	江中药业	13,200	458,700.00	0.13
156	000681	视觉中国	29,000	454,140.00	0.13
157	000513	丽珠集团	6,622	450,958.20	0.13
158	603883	老百姓	9,249	449,963.85	0.13
159	600111	北方稀土	39,500	447,535.00	0.13
160	601989	中国重工	71,600	444,636.00	0.13
161	600351	亚宝药业	56,200	439,484.00	0.12
162	000039	中集集团	24,300	438,129.00	0.12
163	002312	*ST 三泰	63,500	433,070.00	0.12
164	002411	必康股份	14,891	430,647.72	0.12
165	002462	嘉事堂	10,900	428,261.00	0.12
166	000151	中成股份	22,800	428,184.00	0.12
167	600418	江淮汽车	40,100	423,055.00	0.12
168	300357	我武生物	10,260	422,712.00	0.12
169	600010	包钢股份	191,840	420,129.60	0.12
170	600426	华鲁恒升	35,571	417,603.54	0.12
171	300307	慈星股份	40,900	413,908.00	0.12
172	000536	华映科技	70,520	409,721.20	0.12
173	600581	八一钢铁	40,500	407,835.00	0.12
174	603993	洛阳钼业	80,200	405,812.00	0.12
175	600100	同方股份	28,700	405,244.00	0.12

176	600436	片仔癀	6,600	402,864.00	0.11
177	000423	东阿阿胶	5,600	402,584.00	0.11
178	300188	美亚柏科	23,200	401,128.00	0.11
179	300229	拓尔思	32,365	400,355.05	0.11
180	000750	国海证券	72,400	398,200.00	0.11
181	600622	嘉宝集团	24,440	397,883.20	0.11
182	002025	航天电器	15,800	394,210.00	0.11
183	603188	亚邦股份	22,600	394,144.00	0.11
184	300166	东方国信	29,070	390,410.10	0.11
185	300109	新开源	8,400	390,264.00	0.11
186	603611	诺力股份	14,800	389,980.00	0.11
187	002091	江苏国泰	40,800	389,640.00	0.11
188	000488	晨鸣纸业	30,200	389,580.00	0.11
189	000630	铜陵有色	136,600	387,944.00	0.11
190	601901	方正证券	38,600	383,298.00	0.11
191	002294	信立泰	10,700	381,562.00	0.11
192	601866	中远海发	105,751	380,703.60	0.11
193	600456	宝钛股份	18,400	377,568.00	0.11
194	601899	紫金矿业	109,900	376,957.00	0.11
195	600655	豫园商城	33,000	373,560.00	0.11
196	300102	乾照光电	43,700	373,198.00	0.11
197	000413	东旭光电	33,100	371,382.00	0.11
198	600332	白云山	12,783	371,218.32	0.11
199	000688	建新矿业	46,100	368,800.00	0.10
200	600570	恒生电子	7,900	368,772.00	0.10
201	600459	贵研铂业	17,100	368,163.00	0.10
202	600967	内蒙一机	27,000	368,010.00	0.10
203	002057	中钢天源	28,440	363,747.60	0.10
204	600993	马应龙	16,700	363,726.00	0.10
205	002376	新北洋	26,500	363,580.00	0.10
206	601688	华泰证券	20,300	363,370.00	0.10
207	300222	科大智能	16,000	363,040.00	0.10
208	600189	吉林森工	34,783	362,786.69	0.10
209	000983	西山煤电	41,100	360,447.00	0.10
210	600742	一汽富维	18,800	359,268.00	0.10
211	600728	佳都科技	46,400	359,136.00	0.10
212	600969	郴电国际	25,200	357,840.00	0.10
213	002138	顺络电子	19,100	354,878.00	0.10
214	601118	海南橡胶	62,400	354,432.00	0.10

215	002385	大北农	56,300	354,127.00	0.10
216	002094	青岛金王	16,600	354,078.00	0.10
217	600797	浙大网新	28,500	353,115.00	0.10
218	002073	软控股份	41,600	352,768.00	0.10
219	002230	科大讯飞	8,800	351,120.00	0.10
220	300024	机器人	18,000	351,000.00	0.10
221	600018	上港集团	55,300	350,602.00	0.10
222	600682	南京新百	9,500	350,550.00	0.10
223	600109	国金证券	29,900	350,428.00	0.10
224	300158	振东制药	21,600	350,352.00	0.10
225	002433	太安堂	37,800	349,650.00	0.10
226	000725	京东方 A	84,000	349,440.00	0.10
227	600256	广汇能源	84,400	349,416.00	0.10
228	002226	江南化工	49,400	347,776.00	0.10
229	600958	东方证券	25,000	347,750.00	0.10
230	601088	中国神华	15,500	345,495.00	0.10
231	300097	智云股份	12,700	342,900.00	0.10
232	002289	宇顺电子	17,700	342,141.00	0.10
233	002470	金正大	45,300	341,109.00	0.10
234	000826	启迪桑德	9,700	340,664.00	0.10
235	000892	欢瑞世纪	33,900	340,017.00	0.10
236	600479	千金药业	23,458	339,437.26	0.10
237	300044	赛为智能	17,200	338,840.00	0.10
238	002142	宁波银行	17,500	337,750.00	0.10
239	300401	花园生物	9,000	333,450.00	0.09
240	002382	蓝帆医疗	27,162	332,191.26	0.09
241	000839	中信国安	33,000	329,670.00	0.09
242	600150	中国船舶	14,400	329,328.00	0.09
243	000898	鞍钢股份	57,600	326,016.00	0.09
244	002655	共达电声	38,300	325,550.00	0.09
245	600015	华夏银行	35,160	324,175.20	0.09
246	002512	达华智能	20,000	323,000.00	0.09
247	000060	中金岭南	28,700	321,440.00	0.09
248	000813	德展健康	37,150	320,604.50	0.09
249	000709	河钢股份	76,500	320,535.00	0.09
250	601199	江南水务	46,600	320,142.00	0.09
251	600521	华海药业	15,200	319,808.00	0.09
252	600502	安徽水利	41,400	318,366.00	0.09
253	600073	上海梅林	33,300	318,015.00	0.09

254	600055	万东医疗	25,000	315,000.00	0.09
255	000002	万科 A	12,500	312,125.00	0.09
256	002238	天威视讯	26,200	311,780.00	0.09
257	002037	久联发展	23,000	310,960.00	0.09
258	000732	泰禾集团	18,595	310,164.60	0.09
259	000597	东北制药	27,600	308,568.00	0.09
260	600028	中国石化	51,900	307,767.00	0.09
261	600961	株冶集团	35,600	307,584.00	0.09
262	002100	天康生物	38,300	307,549.00	0.09
263	600420	现代制药	19,600	307,524.00	0.09
264	600203	福日电子	36,600	307,074.00	0.09
265	600458	时代新材	26,800	306,860.00	0.09
266	000786	北新建材	19,300	305,712.00	0.09
267	600973	宝胜股份	54,400	304,640.00	0.09
268	000030	富奥股份	34,049	304,398.06	0.09
269	600336	澳柯玛	52,200	303,282.00	0.09
270	600369	西南证券	54,000	302,940.00	0.09
271	600756	浪潮软件	15,300	302,787.00	0.09
272	600333	长春燃气	44,000	302,720.00	0.09
273	300199	翰宇药业	19,700	302,198.00	0.09
274	300005	探路者	38,300	301,804.00	0.09
275	002102	冠福股份	72,200	301,796.00	0.09
276	000581	威孚高科	11,642	301,527.80	0.09
277	000977	浪潮信息	17,400	301,368.00	0.09
278	600297	广汇汽车	40,000	301,200.00	0.09
279	600489	中金黄金	30,000	300,900.00	0.09
280	600547	山东黄金	10,400	300,872.00	0.09
281	600037	歌华有线	20,600	299,936.00	0.09
282	600006	东风汽车	51,200	299,520.00	0.09
283	600171	上海贝岭	29,400	298,998.00	0.08
284	600415	小商品城	41,200	298,288.00	0.08
285	600360	华微电子	41,000	297,660.00	0.08
286	002635	安洁科技	8,200	297,004.00	0.08
287	600433	冠豪高新	53,600	295,872.00	0.08
288	600703	三安光电	15,000	295,500.00	0.08
289	600755	厦门国贸	32,100	292,752.00	0.08
290	300418	昆仑万维	12,800	292,736.00	0.08
291	300497	富祥股份	5,517	291,242.43	0.08
292	002065	东华软件	13,335	290,569.65	0.08

293	601991	大唐发电	64,000	289,280.00	0.08
294	600859	王府井	17,900	289,085.00	0.08
295	002555	三七互娱	11,300	288,941.00	0.08
296	300219	鸿利智汇	21,700	287,742.00	0.08
297	600593	大连圣亚	10,800	287,712.00	0.08
298	601799	星宇股份	6,500	287,430.00	0.08
299	603368	柳州医药	5,000	286,250.00	0.08
300	600816	安信信托	20,800	282,672.00	0.08
301	002732	燕塘乳业	9,700	279,651.00	0.08
302	002104	恒宝股份	29,700	278,883.00	0.08
303	000757	浩物股份	38,300	276,526.00	0.08
304	600081	东风科技	22,113	275,306.85	0.08
305	002450	康得新	12,000	270,240.00	0.08
306	002262	恩华药业	17,784	269,071.92	0.08
307	601872	招商轮船	52,100	268,836.00	0.08
308	603936	博敏电子	10,200	268,770.00	0.08
309	601139	深圳燃气	31,062	268,686.30	0.08
310	601318	中国平安	5,400	267,894.00	0.08
311	600734	实达集团	21,000	267,750.00	0.08
312	300032	金龙机电	19,100	266,445.00	0.08
313	300343	联创互联	13,600	263,840.00	0.07
314	603589	口子窖	6,710	260,280.90	0.07
315	600019	宝钢股份	38,764	260,106.44	0.07
316	002624	完美世界	7,500	257,250.00	0.07
317	002447	壹桥股份	28,500	256,500.00	0.07
318	000610	西安旅游	22,400	256,032.00	0.07
319	600165	新日恒力	15,100	254,284.00	0.07
320	300161	华中数控	13,300	253,764.00	0.07
321	601919	中远海控	47,300	253,055.00	0.07
322	000541	佛山照明	27,500	250,525.00	0.07
323	300478	杭州高新	4,500	250,200.00	0.07
324	300456	耐威科技	6,700	249,776.00	0.07
325	002131	利欧股份	75,500	248,395.00	0.07
326	600048	保利地产	24,800	247,256.00	0.07
327	000540	中天金融	35,100	243,945.00	0.07
328	300110	华仁药业	27,000	241,380.00	0.07
329	000559	万向钱潮	22,600	240,012.00	0.07
330	000425	徐工机械	63,500	238,125.00	0.07
331	601198	东兴证券	13,700	236,188.00	0.07

332	601699	潞安环能	29,800	233,036.00	0.07
333	603578	三星新材	5,100	232,917.00	0.07
334	300151	昌红科技	20,100	231,753.00	0.07
335	300479	神思电子	10,813	231,073.81	0.07
336	000656	金科股份	35,200	230,208.00	0.07
337	000700	模塑科技	28,200	228,138.00	0.06
338	600782	新钢股份	62,400	227,760.00	0.06
339	300422	博世科	14,100	227,010.00	0.06
340	600026	中远海能	34,200	226,746.00	0.06
341	000006	深振业 A	25,600	225,536.00	0.06
342	002734	利民股份	7,693	225,481.83	0.06
343	300271	华宇软件	13,500	223,965.00	0.06
344	002739	万达电影	4,385	223,503.45	0.06
345	000759	中百集团	25,300	222,134.00	0.06
346	002081	金螳螂	20,000	219,600.00	0.06
347	002763	汇洁股份	7,600	218,500.00	0.06
348	000589	黔轮胎 A	39,289	218,053.95	0.06
349	600698	湖南天雁	22,500	218,025.00	0.06
350	600011	华能国际	29,600	217,264.00	0.06
351	002504	*ST 弘高	26,800	217,080.00	0.06
352	002206	海利得	29,100	216,213.00	0.06
353	300435	中泰股份	15,700	216,189.00	0.06
354	002183	怡亚通	25,000	215,750.00	0.06
355	603001	奥康国际	11,400	214,206.00	0.06
356	600491	龙元建设	19,900	213,527.00	0.06
357	002448	中原内配	21,024	212,973.12	0.06
358	000988	华工科技	14,500	211,555.00	0.06
359	002736	国信证券	15,900	210,675.00	0.06
360	600036	招商银行	8,800	210,408.00	0.06
361	600487	亨通光电	7,500	210,375.00	0.06
362	601155	新城控股	11,300	209,502.00	0.06
363	300282	汇冠股份	9,900	208,890.00	0.06
364	300061	康耐特	11,300	208,146.00	0.06
365	002661	克明面业	12,800	207,744.00	0.06
366	002162	悦心健康	31,400	207,554.00	0.06
367	000665	湖北广电	17,046	207,108.90	0.06
368	600585	海螺水泥	9,100	206,843.00	0.06
369	600060	海信电器	13,600	206,312.00	0.06
370	603901	永创智能	17,400	206,190.00	0.06

371	600363	联创光电	14,700	205,947.00	0.06
372	600023	浙能电力	37,500	204,750.00	0.06
373	002508	老板电器	4,700	204,356.00	0.06
374	603222	济民制药	14,100	204,309.00	0.06
375	300439	美康生物	9,500	204,250.00	0.06
376	600535	天士力	4,900	203,546.00	0.06
377	000623	吉林敖东	8,870	203,034.30	0.06
378	300131	英唐智控	24,100	202,922.00	0.06
379	600271	航天信息	9,800	202,272.00	0.06
380	601567	三星医疗	19,400	202,148.00	0.06
381	002275	桂林三金	11,400	201,894.00	0.06
382	300415	伊之密	13,980	201,871.20	0.06
383	002644	佛慈制药	21,700	201,810.00	0.06
384	600269	赣粤高速	38,700	201,627.00	0.06
385	002016	世荣兆业	21,300	201,498.00	0.06
386	300147	香雪制药	19,600	201,292.00	0.06
387	002381	双箭股份	23,000	201,020.00	0.06
388	600820	隧道股份	19,900	200,990.00	0.06
389	603508	思维列控	3,800	200,944.00	0.06
390	002184	海得控制	14,350	200,900.00	0.06
391	002452	长高集团	29,200	200,604.00	0.06
392	300086	康芝药业	19,250	200,585.00	0.06
393	002673	西部证券	14,100	200,502.00	0.06
394	601933	永辉超市	28,300	200,364.00	0.06
395	600288	大恒科技	18,900	200,340.00	0.06
396	601857	中国石油	26,000	199,940.00	0.06
397	300400	劲拓股份	13,400	199,928.00	0.06
398	600232	金鹰股份	24,700	199,823.00	0.06
399	603019	中科曙光	7,100	199,794.00	0.06
400	300311	任子行	13,000	199,550.00	0.06
401	600352	浙江龙盛	20,900	199,177.00	0.06
402	300230	永利股份	12,020	198,810.80	0.06
403	002241	歌尔股份	10,300	198,584.00	0.06
404	600240	华业资本	21,900	198,414.00	0.06
405	300269	联建光电	9,900	198,297.00	0.06
406	600460	士兰微	32,600	197,882.00	0.06
407	300181	佐力药业	28,500	197,790.00	0.06
408	600566	济川药业	5,200	197,756.00	0.06
409	300314	戴维医疗	12,500	197,750.00	0.06

410	300212	易华录	7,800	196,794.00	0.06
411	600199	金种子酒	24,800	196,664.00	0.06
412	600835	上海机电	9,300	196,602.00	0.06
413	600258	首旅酒店	8,400	196,224.00	0.06
414	002036	联创电子	11,800	194,700.00	0.06
415	300077	国民技术	14,200	194,398.00	0.06
416	002605	姚记扑克	13,900	193,766.00	0.06
417	002553	南方轴承	16,500	192,720.00	0.05
418	000019	深深宝 A	15,730	191,434.10	0.05
419	002615	哈尔斯	16,900	190,970.00	0.05
420	601801	皖新传媒	13,800	190,716.00	0.05
421	000957	中通客车	16,300	190,710.00	0.05
422	603899	晨光文具	10,900	189,660.00	0.05
423	603598	引力传媒	11,700	189,657.00	0.05
424	601515	东风股份	16,780	189,614.00	0.05
425	300083	劲胜精密	20,500	189,420.00	0.05
426	300389	艾比森	12,800	186,112.00	0.05
427	002546	新联电子	31,000	184,450.00	0.05
428	002782	可立克	8,800	184,360.00	0.05
429	002198	嘉应制药	13,300	181,279.00	0.05
430	601985	中国核电	23,200	181,192.00	0.05
431	600887	伊利股份	8,306	179,326.54	0.05
432	002662	京威股份	24,900	179,280.00	0.05
433	002587	奥拓电子	23,700	178,698.00	0.05
434	002410	广联达	9,500	178,600.00	0.05
435	600497	驰宏锌锗	26,784	175,435.20	0.05
436	600666	奥瑞德	9,760	175,094.40	0.05
437	600770	综艺股份	23,284	174,630.00	0.05
438	600273	嘉化能源	18,300	171,654.00	0.05
439	002511	中顺洁柔	12,777	169,039.71	0.05
440	300119	瑞普生物	11,780	167,747.20	0.05
441	600348	阳泉煤业	24,400	165,432.00	0.05
442	600895	张江高科	9,700	163,736.00	0.05
443	601600	中国铝业	36,200	163,624.00	0.05
444	600697	欧亚集团	5,800	163,328.00	0.05
445	603566	普莱柯	6,691	162,323.66	0.05
446	002351	漫步者	14,600	161,622.00	0.05
447	000807	云铝股份	22,200	160,284.00	0.05
448	600738	兰州民百	18,800	159,048.00	0.05

449	600395	盘江股份	21,400	156,862.00	0.04
450	600633	浙数文化	8,100	156,492.00	0.04
451	000663	永安林业	11,600	155,440.00	0.04
452	300237	美晨科技	9,000	155,340.00	0.04
453	002626	金达威	10,885	155,111.25	0.04
454	600350	山东高速	25,000	155,000.00	0.04
455	002594	比亚迪	3,100	154,845.00	0.04
456	600309	万华化学	5,400	154,656.00	0.04
457	000989	九芝堂	8,100	153,576.00	0.04
458	600307	酒钢宏兴	53,800	153,330.00	0.04
459	000014	沙河股份	9,087	153,025.08	0.04
460	600428	中远海特	24,600	153,012.00	0.04
461	600837	海通证券	10,300	152,955.00	0.04
462	000625	长安汽车	10,600	152,852.00	0.04
463	002545	东方铁塔	12,300	150,675.00	0.04
464	600490	鹏欣资源	19,000	150,290.00	0.04
465	000858	五粮液	2,700	150,282.00	0.04
466	300162	雷曼股份	14,200	149,526.00	0.04
467	600510	黑牡丹	19,400	148,604.00	0.04
468	601628	中国人寿	5,500	148,390.00	0.04
469	002696	百洋股份	7,100	148,177.00	0.04
470	600704	物产中大	20,300	147,987.00	0.04
471	600804	鹏博士	8,300	147,325.00	0.04
472	601111	中国国航	15,000	146,250.00	0.04
473	002407	多氟多	6,600	145,134.00	0.04
474	600340	华夏幸福	4,300	144,394.00	0.04
475	000166	申万宏源	25,700	143,920.00	0.04
476	600008	首创股份	21,700	142,786.00	0.04
477	600809	山西汾酒	4,100	142,229.00	0.04
478	600987	航民股份	10,937	141,743.52	0.04
479	002208	合肥城建	10,900	141,700.00	0.04
480	600519	贵州茅台	300	141,555.00	0.04
481	300294	博雅生物	3,418	140,958.32	0.04
482	603996	中新科技	8,200	140,220.00	0.04
483	000524	岭南控股	10,400	140,192.00	0.04
484	300433	蓝思科技	4,798	139,573.82	0.04
485	600571	信雅达	10,000	139,000.00	0.04
486	002472	双环传动	12,600	138,222.00	0.04
487	603167	渤海轮渡	12,700	138,049.00	0.04

488	600970	中材国际	15,700	136,433.00	0.04
489	601377	兴业证券	18,300	135,969.00	0.04
490	002338	奥普光电	3,953	135,666.96	0.04
491	002369	卓翼科技	15,700	135,648.00	0.04
492	603366	日出东方	17,550	134,257.50	0.04
493	002103	广博股份	10,140	134,253.60	0.04
494	601238	广汽集团	5,125	133,557.50	0.04
495	600507	方大特钢	15,600	133,068.00	0.04
496	300217	东方电热	35,800	130,312.00	0.04
497	600517	置信电气	17,200	130,204.00	0.04
498	300104	乐视网	4,200	128,856.00	0.04
499	300291	华录百纳	6,400	128,128.00	0.04
500	002759	天际股份	5,000	127,850.00	0.04
501	601339	百隆东方	21,300	126,735.00	0.04
502	600231	凌钢股份	38,400	126,720.00	0.04
503	600686	金龙汽车	9,400	125,020.00	0.04
504	002341	新纶科技	6,700	124,955.00	0.04
505	600135	乐凯胶片	7,800	121,602.00	0.03
506	601009	南京银行	10,800	121,068.00	0.03
507	002550	千红制药	20,300	120,582.00	0.03
508	300171	东富龙	10,300	120,407.00	0.03
509	601186	中国铁建	10,000	120,300.00	0.03
510	000960	锡业股份	8,800	119,768.00	0.03
511	601717	郑煤机	15,300	119,187.00	0.03
512	000792	盐湖股份	11,400	119,130.00	0.03
513	600978	宜华生活	11,800	118,590.00	0.03
514	002043	兔宝宝	8,526	117,999.84	0.03
515	000933	神火股份	16,100	117,369.00	0.03
516	600543	莫高股份	9,600	116,544.00	0.03
517	600528	中铁工业	8,000	114,320.00	0.03
518	000100	TCL 集团	33,200	113,876.00	0.03
519	300087	荃银高科	8,000	113,120.00	0.03
520	002086	东方海洋	9,000	112,950.00	0.03
521	600478	科力远	13,100	112,791.00	0.03
522	300252	金信诺	4,800	111,648.00	0.03
523	600739	辽宁成大	6,187	111,551.61	0.03
524	002649	博彦科技	10,000	110,300.00	0.03
525	000606	神州易桥	10,800	110,052.00	0.03
526	601800	中国交建	6,900	109,641.00	0.03

527	600029	南方航空	12,600	109,620.00	0.03
528	600195	中牧股份	5,600	108,584.00	0.03
529	002760	凤形股份	3,301	108,140.76	0.03
530	600070	浙江富润	9,100	108,108.00	0.03
531	600642	申能股份	17,100	107,730.00	0.03
532	000521	美菱电器	16,800	107,520.00	0.03
533	300066	三川智慧	19,400	107,476.00	0.03
534	000021	深科技	12,500	107,250.00	0.03
535	002420	毅昌股份	12,677	106,613.57	0.03
536	600639	浦东金桥	5,867	106,310.04	0.03
537	600466	蓝光发展	12,300	106,149.00	0.03
538	600216	浙江医药	10,700	106,037.00	0.03
539	603030	全筑股份	10,300	105,987.00	0.03
540	603718	海利生物	7,600	105,032.00	0.03
541	600975	新五丰	16,400	104,960.00	0.03
542	300373	扬杰科技	5,200	104,780.00	0.03
543	300073	当升科技	4,200	104,748.00	0.03
544	600889	南京化纤	11,000	104,390.00	0.03
545	600399	抚顺特钢	16,700	104,208.00	0.03
546	600192	长城电工	13,400	103,582.00	0.03
547	002340	格林美	17,100	103,455.00	0.03
548	600422	昆药集团	9,100	103,194.00	0.03
549	600963	岳阳林纸	13,700	103,161.00	0.03
550	000026	飞亚达 A	8,200	102,008.00	0.03
551	600108	亚盛集团	23,600	101,716.00	0.03
552	002166	莱茵生物	9,100	101,283.00	0.03
553	002074	国轩高科	3,200	100,960.00	0.03
554	600862	中航高科	10,396	100,737.24	0.03
555	002703	浙江世宝	3,600	98,604.00	0.03
556	603085	天成自控	4,000	98,520.00	0.03
557	300498	温氏股份	4,200	98,448.00	0.03
558	601877	正泰电器	4,900	98,441.00	0.03
559	002279	久其软件	7,827	98,228.85	0.03
560	002333	罗普斯金	6,600	97,812.00	0.03
561	600213	亚星客车	9,000	97,290.00	0.03
562	002688	金河生物	10,900	96,901.00	0.03
563	002475	立讯精密	3,300	96,492.00	0.03
564	601898	中煤能源	16,400	96,432.00	0.03
565	300049	福瑞股份	5,700	96,159.00	0.03

566	002611	东方精工	6,700	96,078.00	0.03
567	002345	潮宏基	8,800	95,656.00	0.03
568	002348	高乐股份	13,600	95,336.00	0.03
569	300368	汇金股份	6,600	94,908.00	0.03
570	002580	圣阳股份	11,800	94,282.00	0.03
571	300468	四方精创	2,100	93,639.00	0.03
572	002126	银轮股份	9,300	93,558.00	0.03
573	002650	加加食品	15,900	93,492.00	0.03
574	300376	易事特	10,300	93,421.00	0.03
575	002317	众生药业	7,500	93,150.00	0.03
576	300009	安科生物	5,655	92,798.55	0.03
577	300141	和顺电气	7,400	92,204.00	0.03
578	601636	旗滨集团	20,400	92,004.00	0.03
579	300037	新宙邦	4,000	91,920.00	0.03
580	300272	开能环保	9,120	91,838.40	0.03
581	002196	方正电机	8,000	91,440.00	0.03
582	002497	雅化集团	9,400	91,180.00	0.03
583	002414	高德红外	4,956	90,694.80	0.03
584	600604	市北高新	12,600	90,090.00	0.03
585	002515	金字火腿	9,500	90,060.00	0.03
586	002533	金杯电工	11,900	89,964.00	0.03
587	600999	招商证券	5,200	89,544.00	0.03
588	000016	深康佳 A	18,300	89,487.00	0.03
589	300247	乐金健康	13,400	89,244.00	0.03
589	601099	太平洋	22,200	89,244.00	0.03
590	601789	宁波建工	18,300	89,121.00	0.03
591	002733	雄韬股份	5,500	88,935.00	0.03
592	002770	科迪乳业	16,920	88,491.60	0.03
593	002190	成飞集成	3,300	88,440.00	0.03
594	300224	正海磁材	9,800	88,200.00	0.03
594	300438	鹏辉能源	3,500	88,200.00	0.03
595	000761	本钢板材	16,800	87,864.00	0.02
596	603020	爱普股份	6,000	87,360.00	0.02
597	002176	江特电机	10,000	87,200.00	0.02
598	002412	汉森制药	5,491	87,142.17	0.02
599	002726	龙大肉食	4,800	86,928.00	0.02
600	300059	东方财富	7,200	86,544.00	0.02
601	601633	长城汽车	6,500	86,385.00	0.02
602	300133	华策影视	7,700	86,240.00	0.02

603	600170	上海建工	22,500	85,950.00	0.02
604	600283	钱江水利	7,400	85,618.00	0.02
605	300202	聚龙股份	5,174	85,474.48	0.02
606	601618	中国中冶	17,000	85,170.00	0.02
607	601718	际华集团	9,600	84,384.00	0.02
608	300261	雅本化学	9,035	83,844.80	0.02
609	300015	爱尔眼科	3,600	83,736.00	0.02
610	601998	中信银行	13,300	83,657.00	0.02
611	300407	凯发电气	4,200	82,530.00	0.02
612	600016	民生银行	10,000	82,200.00	0.02
613	600188	兖州煤业	6,700	82,008.00	0.02
614	000056	皇庭国际	6,800	81,260.00	0.02
615	300313	天山生物	6,100	79,910.00	0.02
616	600555	海航创新	16,900	79,430.00	0.02
617	000987	越秀金控	6,700	77,921.00	0.02
618	300289	利德曼	4,542	75,578.88	0.02
619	002544	杰赛科技	3,300	75,240.00	0.02
620	600215	长春经开	6,800	74,392.00	0.02
621	300315	掌趣科技	9,000	73,440.00	0.02
622	002191	劲嘉股份	7,800	73,008.00	0.02
623	601003	柳钢股份	16,000	71,680.00	0.02
624	300462	华铭智能	1,900	69,977.00	0.02
625	002727	一心堂	3,800	69,920.00	0.02
626	600807	天业股份	7,300	68,839.00	0.02
627	600800	天津磁卡	8,900	68,619.00	0.02
628	000705	浙江震元	6,660	68,598.00	0.02
629	600093	易见股份	5,100	68,493.00	0.02
630	002105	信隆健康	8,400	67,956.00	0.02
631	002143	印纪传媒	2,700	67,311.00	0.02
632	002222	福晶科技	4,700	67,069.00	0.02
633	000868	安凯客车	12,600	67,032.00	0.02
634	300172	中电环保	6,300	65,268.00	0.02
635	300030	阳普医疗	5,600	65,072.00	0.02
636	002108	沧州明珠	4,800	64,080.00	0.02
637	002009	天奇股份	5,300	60,526.00	0.02
638	000426	兴业矿业	6,600	59,532.00	0.02
639	000430	张家界	5,600	59,360.00	0.02
640	300170	汉得信息	5,700	58,767.00	0.02
641	002029	七匹狼	6,000	57,420.00	0.02

642	300290	荣科科技	5,400	57,132.00	0.02
643	600834	申通地铁	4,400	55,264.00	0.02
644	000619	海螺型材	5,800	54,462.00	0.02
645	600151	航天机电	6,600	54,318.00	0.02
646	300326	凯利泰	5,200	48,828.00	0.01
647	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
648	000782	美达股份	5,000	47,100.00	0.01
649	300353	东土科技	3,600	46,368.00	0.01
650	002457	青龙管业	2,600	46,280.00	0.01
651	002446	盛路通信	3,800	46,246.00	0.01
652	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
653	002276	万马股份	4,500	45,405.00	0.01
654	002518	科士达	3,100	45,322.00	0.01
655	600461	洪城水业	6,203	44,723.63	0.01
656	601288	农业银行	12,600	44,352.00	0.01
657	603166	福达股份	4,100	44,280.00	0.01
658	600759	洲际油气	7,200	43,632.00	0.01
659	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
660	002121	科陆电子	5,000	43,000.00	0.01
661	002004	华邦健康	5,300	41,499.00	0.01
662	600289	亿阳信通	3,500	38,290.00	0.01
663	300063	天龙集团	4,550	37,992.50	0.01
664	603839	安正时尚	1,350	36,612.00	0.01
665	002436	兴森科技	5,600	35,280.00	0.01
666	000758	中色股份	5,000	35,050.00	0.01
667	600255	鑫科材料	8,200	33,128.00	0.01
668	000516	国际医学	5,900	32,863.00	0.01
669	601018	宁波港	5,600	31,640.00	0.01
670	000909	数源科技	2,600	31,460.00	0.01
671	002510	天汽模	3,500	25,410.00	0.01
672	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
673	300168	万达信息	1,700	24,735.00	0.01
674	600959	江苏有线	2,300	24,311.00	0.01
675	000836	鑫茂科技	4,000	24,200.00	0.01
676	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
677	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
678	300039	上海凯宝	3,100	22,537.00	0.01
679	300139	晓程科技	2,100	22,029.00	0.01
680	002239	奥特佳	5,000	21,650.00	0.01

681	002502	骅威文化	2,300	21,597.00	0.01
682	601992	金隅股份	3,300	21,351.00	0.01
683	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
684	601226	华电重工	2,700	18,414.00	0.01
685	300662	科锐国际	656	16,577.12	0.00
686	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
687	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
688	600057	象屿股份	1,380	14,034.60	0.00
689	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
690	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
691	002060	粤水电	3,200	13,408.00	0.00
692	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
693	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
694	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
695	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	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	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	22	22,526,783,162.13	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	-	-	-	-	-	-

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、	2017 年 1 月 3 日

		深交所（巨潮资讯网）	
2	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
3	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
4	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 17 日
5	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告以及摘要	上海证券报、证券时报、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、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 4 月 14 日
10	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证券时报、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	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	上海证券报、证券时报、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	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。

§ 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安盈量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴安盈量化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、报告期内东吴安盈量化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