

东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金
(原东吴内需增长混合型证券投资基金)
2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年一月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2018 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 12 月 13 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东吴多策略
基金主代码	580009
交易代码	580009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额	215,418,370.10 份
投资目标	本基金在充分控制基金资产风险的前提下，通过积极主动的资产配置和多种策略，充分挖掘市场中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置，并积极参与新股申购，辅助权证及其他金融工具等投资，控制基金组合的投资风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种。
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

转型前：

基金简称	东吴内需增长混合
基金主代码	580009
交易代码	580009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月30日
报告期末基金份额总额	215,437,179.54份
投资目标	本基金在充分控制基金资产风险的前提下，主要投资于受益于国家内需增长政策导向且具有竞争优势的上市公司，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。在严格控制风险的基础之上，精选受益于国家内需增长政策导向且具有竞争优势的上市公司，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益。此外，本基金还可通过新股申购策略、债券投资策略、权证及其他金融工具投资策略等辅助投资策略，控制基金组合的投资风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种。
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

注：上表中“报告期末”为2017年12月12日。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 12 月 13 日 — 2017 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	2,649,752.71
2. 本期利润	2,947,801.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0137
4. 期末基金资产净值	216,696,996.93
5. 期末基金份额净值	1.0059

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 10 月 1 日 — 2017 年 12 月 12 日）
1. 本期已实现收益	9,897,996.19
2. 本期利润	11,232,208.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0521
4. 期末基金资产净值	213,768,157.40
5. 期末基金份额净值	0.992

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、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，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（转型后）

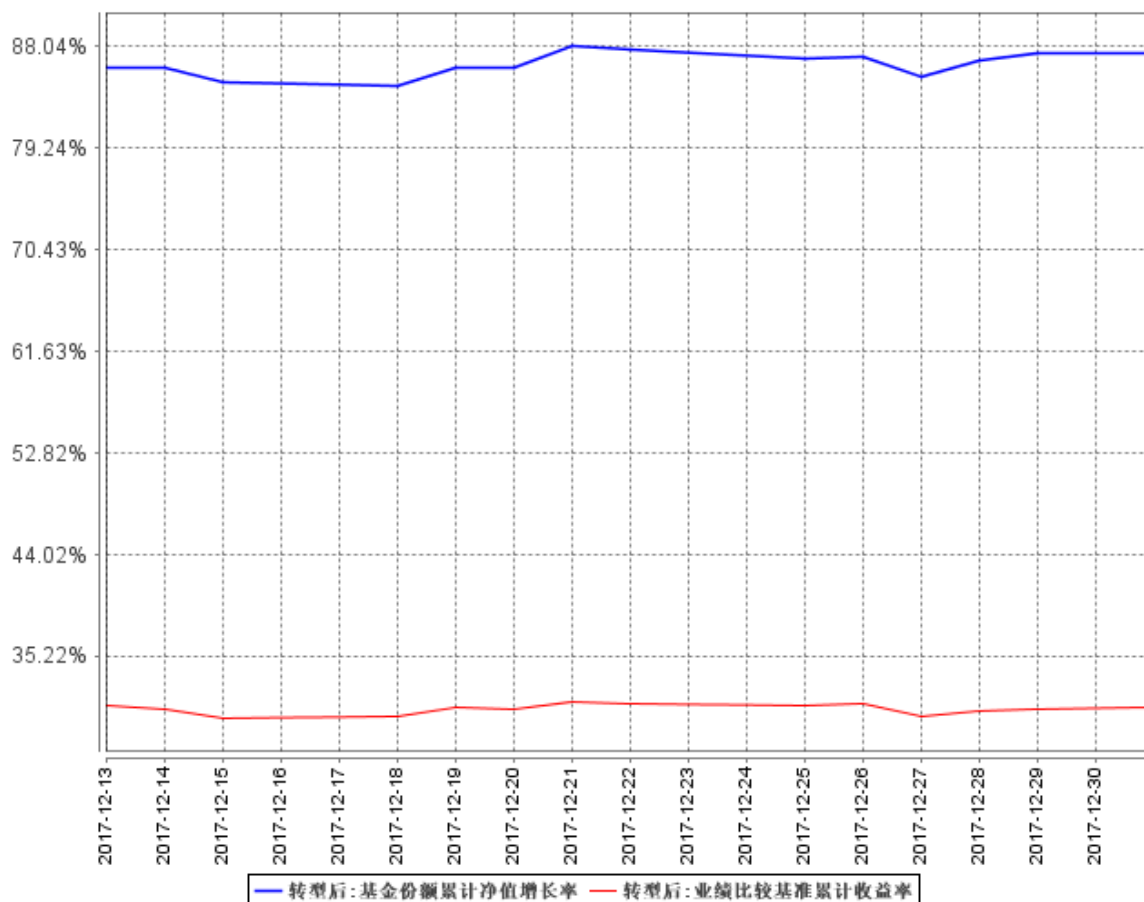
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.40%	0.58%	0.22%	0.39%	1.18%	0.19%

注：比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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=60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。

2、本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日，图示日期为 2017 年 12 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日；自本基金转型起至报告期末不满一年。

3、本报告期内，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

3.2 基金净值表现（转型前）

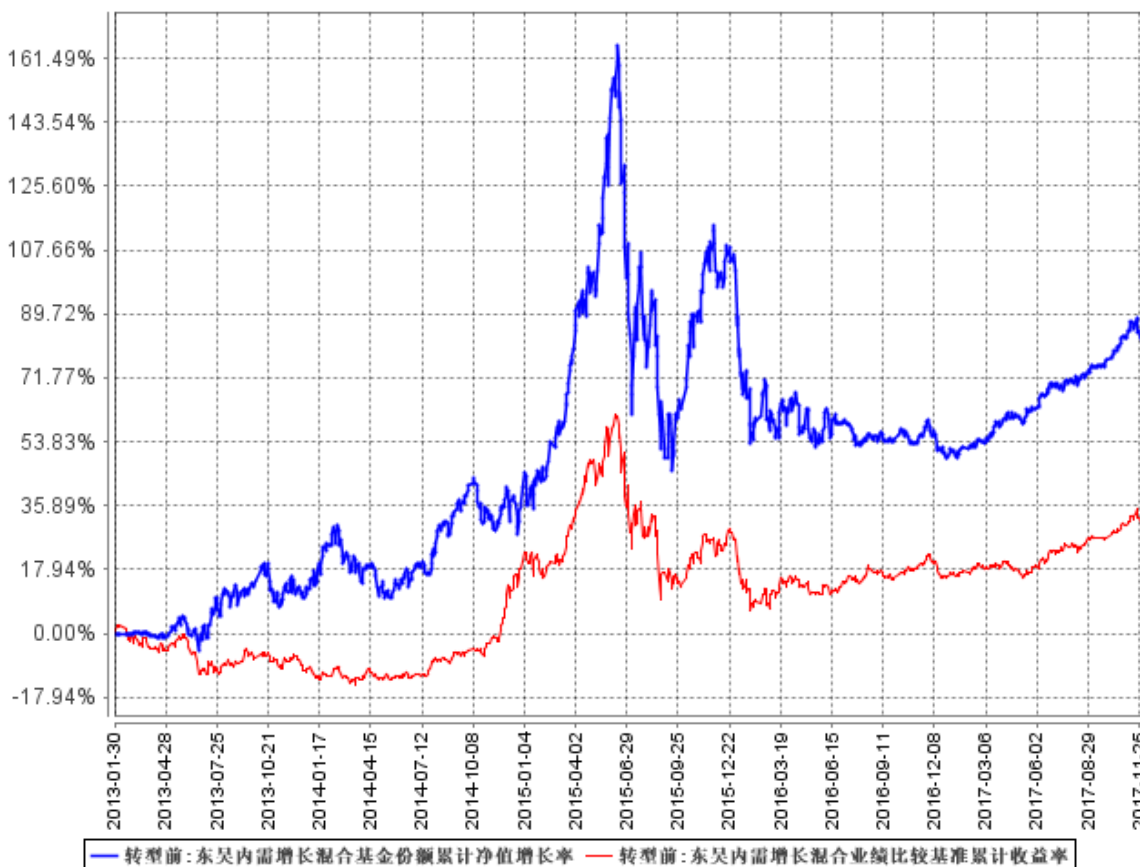
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	4.53%	0.58%	2.32%	0.49%	2.21%	0.09%

注：比较基准=60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东吴内需增长混合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=60%×沪深 300 指数+40%×中国债券综合全价指数。

2、本基金于 2013 年 1 月 30 日成立。图示日期为 2013 年 1 月 30 日至 2017 年 12 月 12 日（转型前）。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐增	本基金经理	2015 年 5 月 12 日	-	7 年	硕士，香港中文大学毕业。2009 年 7 月至 2010 年 12 月就职于埃森哲咨询公司上海分公司任行业研究员，自 2011 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事投

					<p>资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中，自2017年12月13日起担任东吴多策略灵活配置型证券投资基金（原东吴内需增长混合型证券投资基金），自2015年5月29日起担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，自2017年2月22日起担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理（原东吴新创业混合型证券投资基金基金经理）。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐增	本基金经理	2017年12月13日	-	7年	<p>硕士，香港中文大学毕业。2009年7月至2010年12月就职于埃森哲咨询公司上海分公司任行业研究员，自2011年1月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中，自2017年12月13日起担任东吴多策略灵活配置型证券投资基金（原东吴内需增长混合型证券投资基金），自2015年5月29日起担任东吴新经济混合型证券投资</p>

					基金基金经理，自 2017 年 2 月 22 日起担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理（原东吴新创业混合型证券投资基金基金经理）。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

市场在过去的一个季度里呈现先扬后抑的走势。最终上证综指下跌 1.25%，创业板指下跌 6.12%。期间，以白酒为首的消费股表现优异，而中小市值个股仍然萎靡不振，成交量持续下滑。

东吴多策略基金 4 季度重点布局价值白马股，符合市场风格，获得了明显的超额收益。

4.5 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 1.0059 元，累计净值 1.7689 元；本报告期内本基金转型前份额净值增长率 4.53%，同期业绩比较基准收益率为 2.32%，转型后份额净值增长率 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	132,133,460.48	60.85
	其中：股票	132,133,460.48	60.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,738,303.00	19.22
	其中：债券	41,738,303.00	19.22
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	34,000,000.00	15.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,971,430.76	3.67
8	其他资产	1,288,256.89	0.59
9	合计	217,131,451.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,754,000.00	1.27
C	制造业	67,058,823.13	30.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,469,943.20	2.99
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,278,337.04	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	14,695,819.35	6.78
H	住宿和餐饮业	3,229,000.00	1.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.02
J	金融业	14,956,100.00	6.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,139,638.29	3.29
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	4,485,363.72	2.07
S	综合	-	-
	合计	132,133,460.48	60.98

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	150,000	5,454,000.00	2.52
2	600276	恒瑞医药	75,000	5,173,500.00	2.39
3	601318	中国平安	70,000	4,898,600.00	2.26
4	000895	双汇发展	180,000	4,770,000.00	2.20
5	002003	伟星股份	415,000	4,751,750.00	2.19
6	600030	中信证券	230,000	4,163,000.00	1.92
7	300003	乐普医疗	170,000	4,107,200.00	1.90
8	601888	中国国旅	89,911	3,901,238.29	1.80
9	000581	威孚高科	160,000	3,840,000.00	1.77
10	600196	复星医药	80,000	3,560,000.00	1.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,994,400.00	1.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,967,000.00	6.91
	其中：政策性金融债	14,967,000.00	6.91
4	企业债券	20,786,703.00	9.59
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	1,990,200.00	0.92
9	其他	-	-
10	合计	41,738,303.00	19.26

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108601	国开 1703	150,000	14,967,000.00	6.91
2	122112	11 沪大众	110,500	11,050,000.00	5.10
3	122366	14 武钢债	80,000	7,954,400.00	3.67
4	019557	17 国债 03	40,000	3,994,400.00	1.84
5	111771992	17 合肥科技农村商行 CD065	20,000	1,990,200.00	0.92

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,007.33
2	应收证券清算款	348,138.30
3	应收股利	-
4	应收利息	915,716.88
5	应收申购款	394.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,288,256.89

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	130,072,264.03	60.77
	其中：股票	130,072,264.03	60.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,733,597.00	20.43
	其中：债券	43,733,597.00	20.43
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	21,000,000.00	9.81
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,082,525.52	8.45
8	其他资产	1,165,726.94	0.54
9	合计	214,054,113.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	65,411,256.52	30.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,787,632.58	3.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,556,384.00	4.47
G	交通运输、仓储和邮政业	14,255,874.94	6.67
H	住宿和餐饮业	3,009,000.00	1.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,910.98	0.01
J	金融业	16,846,800.00	7.88
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,063,740.39	3.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,774,925.45	1.30
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	4,350,739.17	2.04
S	综合	-	-
	合计	130,072,264.03	60.85

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	150,000	5,563,500.00	2.60
2	600276	恒瑞医药	75,000	5,158,500.00	2.41

3	601318	中国平安	70,000	4,984,700.00	2.33
4	600196	复星医药	110,000	4,716,800.00	2.21
5	000895	双汇发展	180,000	4,665,600.00	2.18
6	600887	伊利股份	150,000	4,582,500.00	2.14
7	002003	伟星股份	415,000	4,544,250.00	2.13
8	600036	招商银行	160,000	4,536,000.00	2.12
9	000661	长春高新	23,000	4,292,950.00	2.01
10	600030	中信证券	230,000	4,206,700.00	1.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,993,200.00	1.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,943,000.00	6.99
	其中：政策性金融债	14,943,000.00	6.99
4	企业债券	24,797,397.00	11.60
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	其他	-	-
10	合计	43,733,597.00	20.46

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108601	国开 1703	150,000	14,943,000.00	6.99
2	122112	11 沪大众	110,500	11,053,315.00	5.17
3	122366	14 武钢债	80,000	7,960,000.00	3.72
4	122043	09 紫江债	40,000	4,001,600.00	1.87
5	019557	17 国债 03	40,000	3,993,200.00	1.87

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,007.33
2	应收证券清算款	66,891.50
3	应收股利	-
4	应收利息	1,071,336.04
5	应收申购款	890.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	2,601.53
8	其他	-
9	合计	1,165,726.94

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2017年12月13日）基金份额总额	215,437,179.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,562.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	23,372.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	215,418,370.10

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	215,480,454.43
报告期期间基金总申购份额	644,097.70
减：报告期期间基金总赎回份额	687,372.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	215,437,179.54

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20171001-20171231	208,549,395.06	-	-	208,549,395.06	96.81%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2017年12月12日东吴内需增长混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于东吴内需增长混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括东吴内需增长混合型证券投资基金变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略和修订基金合

同等事项。自基金份额持有人大会决议生效之日次一日起，《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》失效且《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴多策略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、报告期内东吴多策略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。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 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
2018 年 1 月 19 日