

# 东吴价值成长双动力混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十九日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东吴双动力混合
基金主代码	580002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 12 月 15 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	450,191,735.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对投资对象价值和成长动力的把握，风格动态配置，以资本增值和现金红利的方式获取较高收益。
投资策略	采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取自下而上策略，以价值、成长动力为主线，根据东吴价值动力评价体系精选估值处在相对安全边际之内，并且具备良好现金分红能力的价值型股票，和根据东吴成长动力评价体系精选成长性高、公司素质优秀和良好成长型股票作为投资对象。在价值和成长风格配置上，根据未来市场环境判断结果，动态调节投资组合中价值股和成长股的相对比例，降低基金组合投资风险，追求主动投资的超额收益。
业绩比较基准	75%*新华富时 A600 指数+25%*中证全债指数。
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益均高于货币型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、收益较高的基金产品。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	贺倩
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-66060069

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-14,745,290.65
本期利润	-46,491,337.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1019
本期基金份额净值增长率	-13.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3150
期末基金资产净值	308,387,740.99
期末基金份额净值	0.6850

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，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

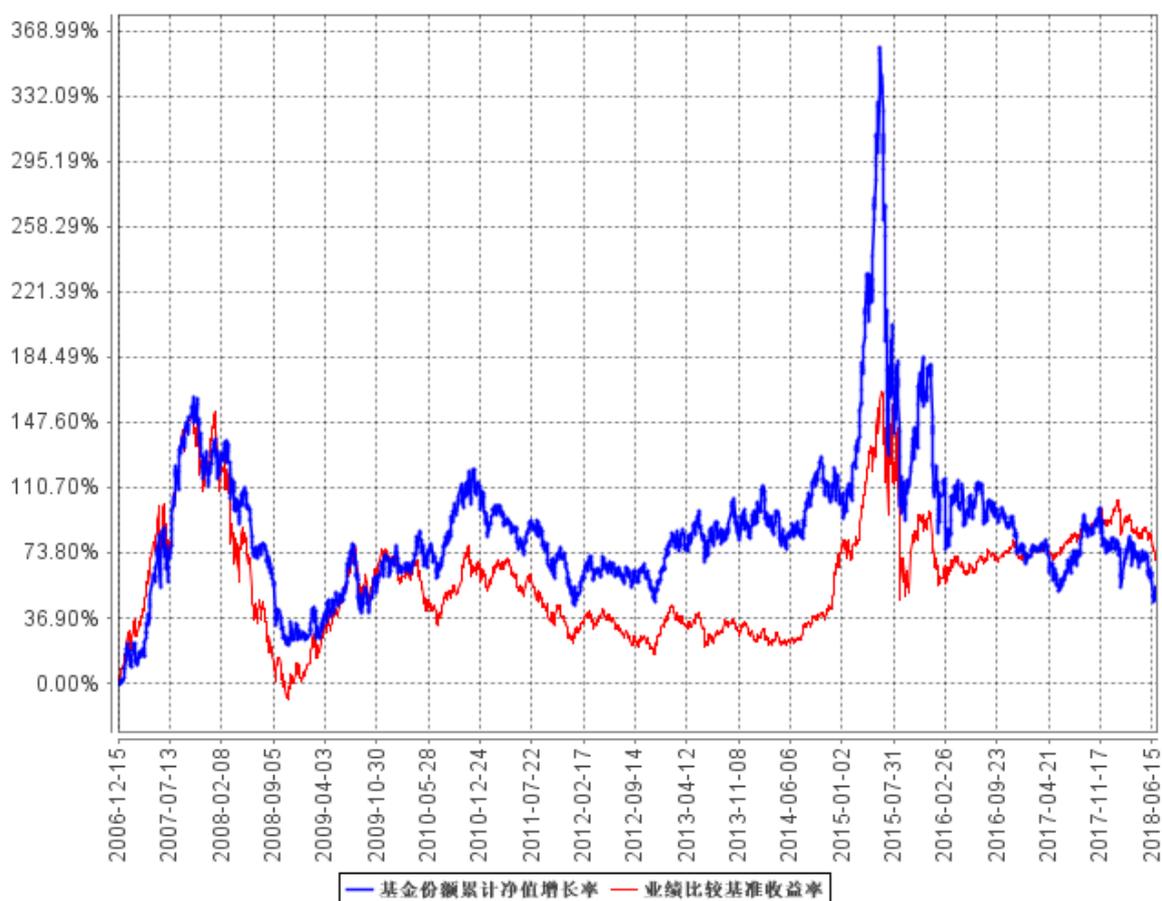
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.66%	2.14%	-5.90%	1.01%	0.24%	1.13%
过去三个月	-13.66%	1.67%	-7.50%	0.86%	-6.16%	0.81%
过去六个月	-13.15%	1.76%	-9.52%	0.88%	-3.63%	0.88%
过去一年	-5.96%	1.60%	-4.16%	0.72%	-1.80%	0.88%
过去三年	-50.46%	2.13%	-20.11%	1.13%	-30.35%	1.00%
自基金合同生效起至今	54.12%	1.79%	72.88%	1.35%	-18.76%	0.44%

注：比较基准=75%\*新华富时 A600 指数+25%\*中证全债指数。

### 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：比较基准=75%\*新华富时 A600 指数+25%\*中证全债指数。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地为上海市浦东新区源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和海澜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。公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2018 年 6 月 30 日,公司管理的资产规模合计 676.03 亿元,其中,公募资产管理规模(含货币基金) 292.19 亿元,专户资产管理规模 294.61 亿元、专项资产管理规模 89.23 亿元。管理各类产品 134 只,其中,公募基金 28 只,专户产品 63 只,子公司资产计划 43 只,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:一是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;二是绝对收益提倡“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;三是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。

近年来,公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩,斩获了诸多奖项,比如第十五届“金基金”奖债券基金奖\*东吴增利债券基金(《上海证券报》)、2017 年度三年持续回报普通债券型明星基金\*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2017 年度最受欢迎新发基金\*东吴双三角股票型基金(东方财富风云榜)、2016 年度积极债券型明星基金\*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金\*东吴鼎利债券基金 LOF(东方财富风云榜)等。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴斌	权益投	2014 年 12 月	-	11 年	戴斌先生, 1982 年生,

	资部副 总经理、 本基金 基金经 理	12 日		博士，中国人民大学金融 学专业毕业。自 2007 年 1 月起加入东吴基金管理 有限公司一直从事证券投 资研究工作，曾任研究部 宏观经济、金融工程研究 员、产品策划部产品设计 研究员，基金经理助理， 现任权益投资总部副总 经理、基金经理，其中， 自 2013 年 12 月 24 日起 担任东吴新兴产业精选混 合型证券投资基金基金经 理，自 2014 年 12 月 12 日起担任东吴价值成长双 动力混合型证券投资基金 基金经理。其中，2015 年 5 月 27 日至 2017 年 5 月 6 日担任东吴移动互联 灵活配置混合型证券投资 基金基金经理，2015 年 8 月 19 日至 2017 年 7 月 29 日担任东吴配置优 化混合型证券投资基金基 金经理，2015 年 7 月 1 日至 2017 年 12 月 18 日担任东吴新趋势价值 线灵活配置混合型证券 投资基金基金经理。
--	--------------------------------	------	--	---

注：1、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

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、法规，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交易进行了相关分析，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

2018 年二季度，宏观经济整体上呈现稳定运行的态势，6 月份中国采购经理指数在 5 月 51.9%的基础上环比回落至 51.5%的水平，依然处在经济扩张区间。5 月份全国规模以上工业增加值同比增长 6.8%，环比略有回落；社会零售总额同比增长 8.5%，环比同样回落 0.9 个百分点。

市场整体上偏弱，结构上偏防御的消费品强于成长股，科技股回调明显。申万一级行业指数中，除食品饮料、休闲服务和家电指数获得上涨外，其余指数尽数下跌，其中通信、军工、综合、电气设备等指数跌幅超过 15%。

究其原因，主要几个方面：1、内部在防风险去杠杆的政策导向之下，整体风险偏好急剧下降，流动性边际收紧；2、外部方面，中美贸易摩擦加剧，市场对贸易战的担忧始终无法消除。

这样的市场风格中，价值成长双动力基金重点配置了新能源车、计算机、生物医药、电子等板块。未来将继续重点在成长股中寻找确定性的投资机会，重点关注传媒、人工智能、医疗服务等行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.6850 元，累计净值 1.7478 元；本报告期份额净值增长率-13.15%，同期业绩比较基准收益率为-9.52%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场的行情正在酝酿，结构性机会有望展开。

政策上，降准已经看见，央行货币报告对货币政策的表述已经相对温和，显示央行对流动性的高度关注。管理层已经表态希望人民币汇率保持稳定。监管层也开始关注质押爆仓的风险。期间一系列产业政策的推出，更加明确的透露出决策层改变经济发展模式的决心，这与本届政府上台后所透露出的政策导向一脉相承。

去杠杆的核心目的是调结构，未来的增长点只能在科技创新。十年期国债收益率已经回落至 3.5%附近，这为后续成长股机会的到来创造了最好的条件。

双动力基金将坚持成长股的投资理念，积极寻找成长股的投资机会。

#### 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，成员由公司总裁、副总经理、运营总监、基金会计、基金投资总部总经理、监察稽核人员等组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营总监、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、监察稽核业务相关人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配八次，至少分配一次；基金当年收益先弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配；全年合计的基金收益分配比例不低于本基金年度已实现净收益的 50%。

#### 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，本基金未出现连续二十个工作日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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：东吴价值成长双动力混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	23,987,483.47	20,665,644.73
结算备付金	1,654,534.74	1,622,436.74
存出保证金	303,756.49	355,374.35
交易性金融资产	289,812,643.83	338,250,458.11
其中：股票投资	289,812,643.83	320,338,658.11
基金投资	-	-
债券投资	-	17,911,800.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	9,034,546.39
应收利息	6,491.04	25,515.21
应收股利	-	-
应收申购款	60,350.90	62,403.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	315,825,260.47	370,016,378.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,915,097.47	-
应付赎回款	99,788.04	163,655.09
应付管理人报酬	387,426.25	479,451.52
应付托管费	64,571.03	79,908.58
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	792,071.89	711,829.94

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	178,564.80	60,162.03
负债合计	7,437,519.48	1,495,007.16
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	450,191,735.72	467,260,933.47
未分配利润	-141,803,994.73	-98,739,561.73
所有者权益合计	308,387,740.99	368,521,371.74
负债和所有者权益总计	315,825,260.47	370,016,378.90

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6850 元，基金份额总额 450191735.72 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴价值成长双动力混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-40,449,597.58	-23,602,676.46
1.利息收入	132,832.63	151,711.04
其中：存款利息收入	96,056.89	151,711.04
债券利息收入	36,775.74	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,849,693.11	-57,537,545.03
其中：股票投资收益	-10,128,358.20	-58,851,004.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,104.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,265,561.09	1,313,459.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-31,746,047.33	33,769,154.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,310.23	14,002.92
<b>减：二、费用</b>	6,041,740.40	6,825,191.49

1. 管理人报酬	2,567,258.29	3,085,009.80
2. 托管费	427,876.41	514,168.31
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,844,197.90	3,017,272.21
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	202,407.80	208,741.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-46,491,337.98	-30,427,867.95
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-46,491,337.98	-30,427,867.95

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴价值成长双动力混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	467,260,933.47	-98,739,561.73	368,521,371.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-46,491,337.98	-46,491,337.98
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）	-17,069,197.75	3,426,904.98	-13,642,292.77
其中：1.基金申购款	22,492,297.25	-5,661,010.95	16,831,286.30
2.基金赎回款	-39,561,495.00	9,087,915.93	-30,473,579.07
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）	450,191,735.72	-141,803,994.73	308,387,740.99

项目	上年度可比期间 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)	504,489,895.35	-111,779,254.36	392,710,640.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-30,427,867.95	-30,427,867.95
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)	85,720,598.59	-18,090,739.04	67,629,859.55
其中：1.基金申购款	115,814,990.97	-25,179,108.10	90,635,882.87
2.基金赎回款	-30,094,392.38	7,088,369.06	-23,006,023.32
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)	590,210,493.94	-160,297,861.35	429,912,632.59

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

\_\_\_\_\_  
徐明

\_\_\_\_\_  
吴婷

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

东吴价值成长双动力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证监基金字[2006]173号文《关于同意东吴价值成长双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准向社会公开发行募集,基金合同于2006年12月15日正式生效。首次设立募集规模为2,144,214,669.67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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%,债券投资比例为基金资产的0-35%,现金以及到期日在一年以内债券等短期金融工具资产比例合计不低于基金资产净值的5%。权证投资比例不高于基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准=75%\*新华富时 A600 指数+25%\*中证全债指数。

## 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》、《东吴价值成长双动力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

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 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. 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### 3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规

定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售

	机构
中国农业银行股份有限公司	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

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	100,318,809.66	5.30%	135,106,018.33	6.66%

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	91,420.33	5.27%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	124,441.57	6.67%	-	-

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,567,258.29	3,085,009.80
其中：支付销售机构的客户维护费	472,364.00	836,837.10

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	427,876.41	514,168.31

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有本基金份额。

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
	中国农业银行股份有限公司	23,987,483.47	80,021.11	22,118,492.53

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600745	闻泰科技	2018年4月18日	临时停牌	30.48	-	-	74,900	2,141,725.00	2,282,952.00	-

### **6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### **6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无需要说明的其他事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	289,812,643.83	91.76
	其中：股票	289,812,643.83	91.76
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	25,642,018.21	8.12
7	其他各项资产	370,598.43	0.12
8	合计	315,825,260.47	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	227,078,539.88	73.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,222,972.01	13.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,305,739.00	2.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,798,115.94	1.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,740,841.00	0.89
R	文化、体育和娱乐业	6,666,436.00	2.16
S	综合	-	-
	合计	289,812,643.83	93.98

## 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	481,327	23,869,005.93	7.74
2	002008	大族激光	356,082	18,940,001.58	6.14
3	300059	东方财富	1,254,720	16,537,209.60	5.36
4	603601	再升科技	1,814,532	15,895,300.32	5.15
5	300073	当升科技	430,282	14,655,404.92	4.75
6	603019	中科曙光	302,713	13,885,445.31	4.50
7	002050	三花智控	723,791	13,643,460.35	4.42
8	300003	乐普医疗	352,176	12,917,815.68	4.19
9	603986	兆易创新	116,256	12,616,101.12	4.09
10	002768	国恩股份	413,455	11,828,947.55	3.84

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn) 的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲科技	35,981,336.92	9.76
2	002466	天齐锂业	30,803,626.87	8.36
3	603986	兆易创新	26,107,234.40	7.08
4	000002	万科 A	24,192,163.58	6.56
5	300059	东方财富	22,891,335.80	6.21
6	300347	泰格医药	22,676,555.70	6.15
7	603019	中科曙光	21,832,259.00	5.92
8	002236	大华股份	20,812,696.00	5.65

9	600570	恒生电子	20,251,181.28	5.50
10	600466	蓝光发展	17,956,943.00	4.87
11	601398	工商银行	17,872,135.48	4.85
12	300073	当升科技	17,281,302.00	4.69
13	000977	浪潮信息	16,932,169.40	4.59
14	002008	大族激光	16,805,413.60	4.56
15	002050	三花智控	16,259,754.00	4.41
16	300003	乐普医疗	15,308,619.47	4.15
17	300136	信维通信	14,854,807.03	4.03
18	601155	新城控股	14,760,183.32	4.01
19	600884	杉杉股份	13,382,399.40	3.63
20	600845	宝信软件	13,273,288.14	3.60
21	300037	新宙邦	12,594,862.85	3.42
22	002460	赣锋锂业	12,357,132.74	3.35
23	600231	凌钢股份	12,143,045.95	3.30
24	002624	完美世界	12,136,098.13	3.29
25	300251	光线传媒	11,864,349.66	3.22
26	300024	机器人	11,107,216.27	3.01
27	600967	内蒙一机	10,605,534.00	2.88
28	603799	华友钴业	10,453,086.00	2.84
29	000063	中兴通讯	10,221,324.80	2.77
30	002343	慈文传媒	10,199,266.00	2.77
31	002341	新纶科技	10,058,385.92	2.73
32	600585	海螺水泥	10,012,632.00	2.72
33	002594	比亚迪	9,984,350.94	2.71
34	300348	长亮科技	9,931,400.00	2.69
35	000681	视觉中国	9,829,099.45	2.67
36	002602	世纪华通	9,292,531.00	2.52
37	300571	平治信息	9,252,992.00	2.51
38	600211	西藏药业	9,114,734.00	2.47
39	300550	和仁科技	9,029,716.00	2.45
40	300309	吉艾科技	8,957,886.13	2.43
41	601888	中国国旅	8,590,163.00	2.33
42	002146	荣盛发展	8,490,052.00	2.30
43	002683	宏大爆破	8,119,911.00	2.20
44	002371	北方华创	8,024,878.00	2.18

45	600048	保利地产	7,399,178.40	2.01
----	--------	------	--------------	------

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	002456	欧菲科技	45,332,916.78	12.30
2	002460	赣锋锂业	28,234,949.95	7.66
3	300136	信维通信	27,714,501.38	7.52
4	002594	比亚迪	24,148,108.04	6.55
5	603799	华友钴业	22,347,834.95	6.06
6	300347	泰格医药	21,856,146.90	5.93
7	000002	万科 A	21,704,282.62	5.89
8	002236	大华股份	21,366,316.04	5.80
9	002008	大族激光	20,752,119.39	5.63
10	002202	金风科技	20,657,495.95	5.61
11	603993	洛阳钼业	20,146,826.01	5.47
12	600048	保利地产	19,066,792.38	5.17
13	601398	工商银行	17,330,578.73	4.70
14	000858	五粮液	16,398,759.11	4.45
15	300316	晶盛机电	15,540,194.61	4.22
16	002466	天齐锂业	15,092,029.49	4.10
17	600466	蓝光发展	13,851,762.46	3.76
18	600570	恒生电子	13,544,042.73	3.68
19	601155	新城控股	12,557,839.80	3.41
20	300251	光线传媒	11,829,462.00	3.21
21	300450	先导智能	11,647,840.20	3.16
22	002709	天赐材料	11,535,110.20	3.13
23	600019	宝钢股份	11,514,895.38	3.12
24	300348	长亮科技	10,668,087.84	2.89
25	600967	内蒙一机	10,588,411.00	2.87
26	603986	兆易创新	10,377,897.05	2.82
27	600585	海螺水泥	10,098,569.71	2.74
28	002343	慈文传媒	9,792,853.52	2.66
29	002602	世纪华通	9,639,479.78	2.62
30	300024	机器人	9,573,026.40	2.60

31	000977	浪潮信息	9,383,445.67	2.55
32	300571	平治信息	9,357,335.63	2.54
33	600845	宝信软件	9,173,754.16	2.49
34	002340	格林美	8,901,970.75	2.42
35	600338	西藏珠峰	8,708,162.36	2.36
36	300188	美亚柏科	8,139,366.48	2.21
37	300550	和仁科技	8,104,257.22	2.20
38	002768	国恩股份	8,000,970.25	2.17
39	002146	荣盛发展	7,705,342.23	2.09
40	002683	宏大爆破	7,658,672.32	2.08
41	600211	西藏药业	7,612,290.65	2.07
42	000725	京东方 A	7,467,995.46	2.03
43	600519	贵州茅台	7,427,967.24	2.02

注：本项的“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	952,157,405.53
卖出股票收入（成交）总额	940,808,042.28

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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。

### 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	303,756.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,491.04
5	应收申购款	60,350.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	370,598.43

### 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**

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### **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
30,763	14,634.19	2,943,793.32	0.65%	447,247,942.40	99.35%

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	0.00	0.0000%

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。

### 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（2006年12月15日）基金份额总额	2,144,214,669.67
本报告期期初基金份额总额	467,260,933.47
本报告期基金总申购份额	22,492,297.25
减：本报告期基金总赎回份额	39,561,495.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	450,191,735.72

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发生以下人事变动：

2018 年 4 月 3 日，徐军女士因工作调动辞去公司督察长职务，由吕晖先生担任公司督察长职务，同时吕晖先生辞去其所担任的公司副总经理职务。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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）上海分所。

### 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

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，上海证监局对公司采取责令改正的决定。公司高度重视，按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程，针对性的制定、落实整改措施，并将及时向监管部门提交整改报告。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
首创证券	2	432,611,548.68	22.88%	394,239.38	22.72%	-
申港证券	2	414,096,344.47	21.90%	382,084.22	22.02%	-
长江证券	1	322,109,009.31	17.03%	293,537.83	16.91%	-
兴业证券	1	149,415,799.26	7.90%	139,151.20	8.02%	-

东兴证券	1	132,910,467.35	7.03%	123,778.79	7.13%	-
天风证券	2	106,758,892.59	5.65%	97,289.79	5.61%	-
东吴证券	2	100,318,809.66	5.30%	91,420.33	5.27%	-
华信证券	1	85,528,325.46	4.52%	79,651.94	4.59%	-
招商证券	1	67,773,168.80	3.58%	61,762.12	3.56%	-
中泰证券	2	52,709,919.89	2.79%	48,034.95	2.77%	-
东方证券	1	26,859,389.08	1.42%	24,476.74	1.41%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

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：申港证券、方正证券；退租 2 个交易单元：金元证券、国金证券。

### **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**

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## §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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司

2018 年 8 月 29 日