

东吴行业轮动混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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。

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	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§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.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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	50

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	东吴行业轮动混合
基金主代码	580003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 23 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	594,631,334.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下策略，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。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
业绩比较基准	75%*沪深 300 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和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	郑鹏
	联系电话	021-50509888-8206	010-85238667
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95577
传真		021-50509888-8211	010-85238680
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 22 号

		号
邮政编码	200135	100005
法定代表人	王炯	李民吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-12,309,007.53
本期利润	-77,087,092.12
加权平均基金份额本期利润	-0.1315
本期加权平均净值利润率	-17.91%
本期基金份额净值增长率	-17.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-208,404,069.20
期末可供分配基金份额利润	-0.3505
期末基金资产净值	386,227,265.00
期末基金份额净值	0.6495
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-30.77%

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

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

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

3.2 基金净值表现

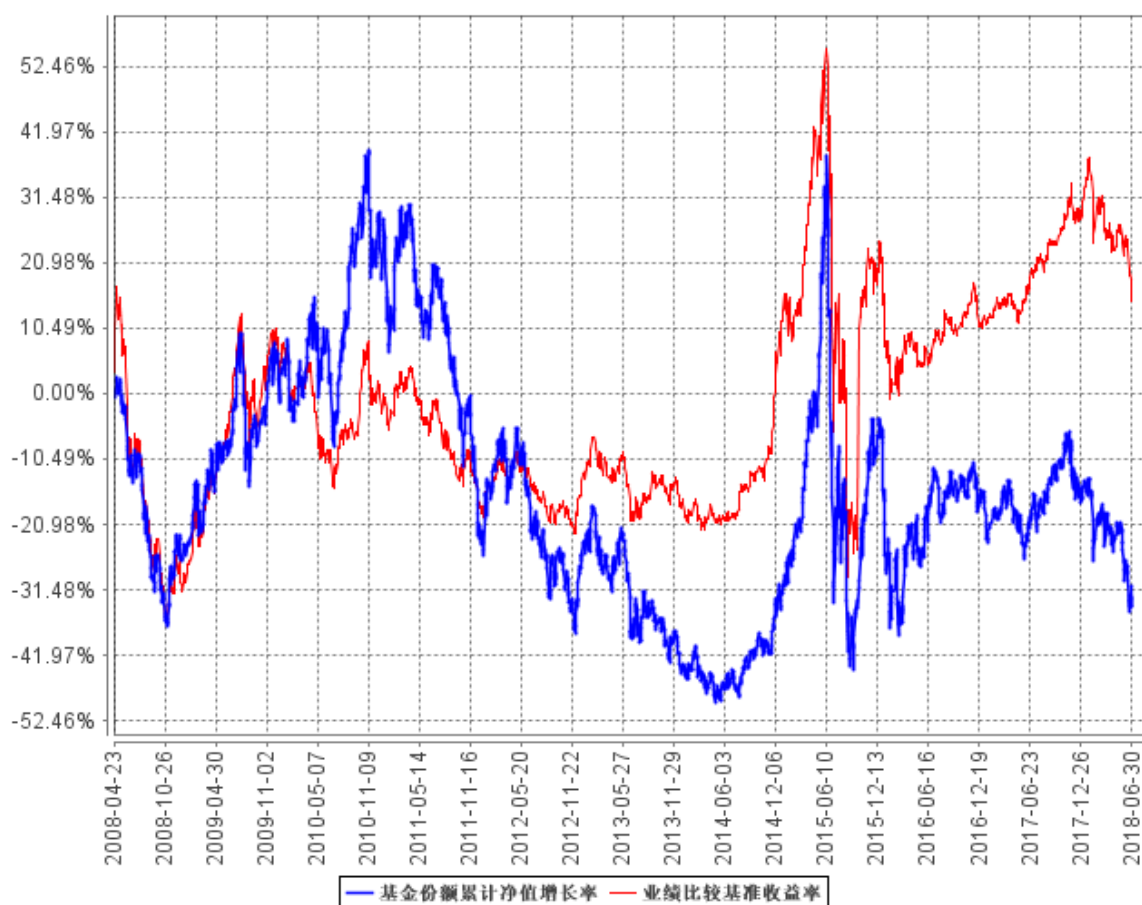
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率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	-5.51%	2.49%	-5.58%	0.96%	0.07%	1.53%
过去三个月	-14.47%	1.84%	-6.91%	0.85%	-7.56%	0.99%
过去六个月	-17.07%	1.75%	-8.58%	0.86%	-8.49%	0.89%
过去一年	-14.84%	1.54%	-2.13%	0.71%	-12.71%	0.83%
过去三年	-27.45%	2.25%	-13.41%	1.12%	-14.04%	1.13%
自基金合同 生效起至今	-30.77%	1.91%	17.17%	1.28%	-47.94%	0.63%

注：比较基准=75%*沪深 300 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：1、东吴行业轮动基金于 2008 年 4 月 23 日成立。

2、比较基准=75%*沪深 300 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		
王立立	权益投	2015 年 5 月 29	-	7 年	王立立, 硕士, 复旦大学

	资总部 副总经理、基金 经理	日			世界经济专业。2010 年 7 月至 2010 年 12 月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员，自 2012 年 7 月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理，现任权益投资总部副总经理、基金经理，其中，自 2015 年 2 月 6 日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、自 2015 年 5 月 29 日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理。其中，2015 年 12 月 30 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 24 日至 2018 年 2 月 27 日担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，2014 年 6 月 14 日至 2018 年 3 月 3 日担任东吴阿尔法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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金因持有的个别股票连续停牌，出现连续十个交易日以上持有一家公司发行的证券市值超过基金资产净值 10%的情形。除此之外，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 年初以来，国际国内政治经济环境较为复杂，市场也出现了大幅波动。年初权重板块大涨，而后又出现大幅下跌，在国内金融去杠杆，中美贸易摩擦的背景之下，市场情绪极度悲观。

年初，在分析宏观经济环境、各行业政策和上市公司业绩的基础上，行业轮动基金配置了制造业龙头和金融地产权重股等相关行业的股票。一月份权重股暴动，而后受国际国内环境变化又出现大幅调整，波动巨大，基金净值也随之大幅波动。在中美贸易摩擦加剧的背景之下，我们进一步体会到关键技术和核心领域受制于人的尴尬，国家也将大力支持这些技术领域的发展。目前基金持仓主要集中在高端制造业。

国内紧信用去杠杆，国际贸易争端不断，资产价格波动剧烈，在一片混沌之中也孕育着新的方向。制造强国立意深远，高端制造领域面临新的突破。

展望 2018 年下半年的宏观格局与投资策略，我们认为金融去杠杆和贸易摩擦对于市场的边际影响将会减弱，经过三年下跌，成长股的机会将逐步显现。

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 0.6495 元，累计净值 0.7295 元；本报告期份额净值增长率-17.07%，同期业绩比较基准收益率为-8.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年的宏观格局与投资策略,我们认为金融去杠杆和贸易摩擦对于市场的边际影响将会减弱,经过三年下跌,成长股的机会将逐步显现。金融监管继续推进、行业集中度进一步提升、MSCI 带来的海外增量资金与国内长线配置资金的风险偏好这三方面趋势性因素持续拥抱核心资产。

市场正在逐步走向均衡,成长也有龙头,盈利推升估值重估的动能在局部依然较强,优质的真成长股将逐渐成为资金追逐的资本市场新龙头。

中美贸易摩擦带来启示,把握经济结构转型重点,寻找技术短板和战略突破点。一是创新驱动的制造业产业升级方向。新能源汽车、半导体、自主可控等领域受益政策与技术的双重驱动。二是主要矛盾转变和“美好生活”需求驱动的消费升级。三是“高质量发展”重点方向之一的生态文明。环保园林提供重要投资机会。四是金融地产的核心资产配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会,成员由公司副总经理、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组成,同时,督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上,由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算,并参与公司对基金的估值方法的计算;公司副总经理、基金会计等参与基金组合估值方法的确定,复核估值价格,并与相关托管行进行核对确认;督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论,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

本基金本报告期内，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情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2018 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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：东吴行业轮动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	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	18,446,888.92	26,582,499.98
结算备付金		981,065.24	4,641,620.90
存出保证金		932,953.51	742,777.14
交易性金融资产	6.4.7.2	358,881,102.72	448,175,712.60
其中：股票投资		358,881,102.72	448,175,712.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,572,846.82	726,205.70
应收利息	6.4.7.5	4,994.61	7,617.04
应收股利		-	-
应收申购款		233,086.66	500,386.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		390,052,938.48	481,376,819.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		2,291,692.51	4,073,706.66
应付赎回款		378,753.96	516,202.20
应付管理人报酬		476,486.84	613,983.34
应付托管费		79,414.47	102,330.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	420,237.50	1,909,894.75
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	179,088.20	60,414.75
负债合计		3,825,673.48	7,276,532.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	594,631,334.20	605,332,966.69
未分配利润	6.4.7.10	-208,404,069.20	-131,232,679.31
所有者权益合计		386,227,265.00	474,100,287.38
负债和所有者权益总计		390,052,938.48	481,376,819.61

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6495 元，基金份额总额 594,631,334.20 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴行业轮动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	附注号	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
一、收入		-69,604,802.06	-9,030,101.14
1.利息收入		123,688.60	173,141.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	123,688.60	173,141.49
债券利息收入		-	-
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）		-4,981,795.50	16,395,067.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,401,615.79	15,640,512.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	1,419,820.29	754,555.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-64,778,084.59	-25,682,041.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	31,389.43	83,730.62
减：二、费用		7,482,290.06	6,808,712.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,195,404.08	4,097,860.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	532,567.32	682,976.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	3,557,452.77	1,825,179.21
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	6.4.7.19	196,865.89	202,696.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-77,087,092.12	-15,838,813.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-77,087,092.12	-15,838,813.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴行业轮动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）	605,332,966.69	-131,232,679.31	474,100,287.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-77,087,092.12	-77,087,092.12
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）	-10,701,632.49	-84,297.77	-10,785,930.26
其中：1.基金申购款	61,347,661.56	-17,852,402.51	43,495,259.05
2.基金赎回款	-72,049,294.05	17,768,104.74	-54,281,189.31
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）	594,631,334.20	-208,404,069.20	386,227,265.00
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)	708,925,682.81	-154,553,515.30	554,372,167.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,838,813.89	-15,838,813.89
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)	41,473,042.07	-7,649,763.63	33,823,278.44
其中：1.基金申购款	156,609,427.88	-34,601,767.52	122,007,660.36
2.基金赎回款	-115,136,385.81	26,952,003.89	-88,184,381.92
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)	750,398,724.88	-178,042,092.82	572,356,632.06

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：

<u>王炯</u>	<u>徐明</u>	<u>吴婷</u>
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

东吴行业轮动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[2008]296号文《关于核准东吴行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于2008年4月23日正式生效，首次设立募集规模为3,173,064,234.06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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准=75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具

体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 半年度的经营成果和净值变动情况。

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 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	18,446,888.92
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	18,446,888.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	388,722,297.09	358,881,102.72	-29,841,194.37
贵金属投资 - 金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	388,722,297.09	358,881,102.72	-29,841,194.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,219.34
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	397.35
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	377.91
合计	4,994.61

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	420,237.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	420,237.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	222.31
预提费用	178,865.89
-	-
合计	179,088.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	605,332,966.69	605,332,966.69
本期申购	61,347,661.56	61,347,661.56
本期赎回(以“-”号填列)	-72,049,294.05	-72,049,294.05
- 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	594,631,334.20	594,631,334.20

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-181,272,768.07	50,040,088.76	-131,232,679.31
本期利润	-12,309,007.53	-64,778,084.59	-77,087,092.12
本期基金份额交易产生的变动数	2,823,610.24	-2,907,908.01	-84,297.77
其中：基金申购款	-18,980,554.70	1,128,152.19	-17,852,402.51
基金赎回款	21,804,164.94	-4,036,060.20	17,768,104.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-190,758,165.36	-17,645,903.84	-208,404,069.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	95,662.21
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	19,415.04
其他	8,611.35
合计	123,688.60

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	1,185,804,883.33
减：卖出股票成本总额	1,192,206,499.12
买卖股票差价收入	-6,401,615.79

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末进行债券投资交易。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资交易。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末进行其他投资交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,419,820.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,419,820.29

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-64,778,084.59
——股票投资	-64,778,084.59
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-64,778,084.59

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	30,529.15
转换费收入	860.28
合计	31,389.43

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,557,452.77
银行间市场交易费用	-
合计	3,557,452.77

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	30,100.18
信息披露费	148,765.71
帐户维护费	18,000.00
其他费用	-
数字证书服务费	-
汇划费	-
合计	196,865.89

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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

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、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	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 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	754,533,136.43	32.08%	119,073,985.08	9.82%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	693,839.78	32.08%	-	-
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	110,894.48	9.95%	-	-

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 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	3,195,404.08	4,097,860.15
其中：支付销售机构的客户维护费	808,029.57	836,837.10

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 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	532,567.32	682,976.70

注：支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

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 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
华夏银行股份有限公司	18,446,888.92	95,662.21	27,049,932.91	150,231.62

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

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（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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**

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

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股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，追求超额收益。

本基金投资目标为通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。基于该投资目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金基金合同约定投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，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；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	18,446,888.92	-	-	-	-	-	18,446,888.92

结算备付金	981,065.24	-	-	-	-	-	981,065.24
存出保证金	932,953.51	-	-	-	-	-	932,953.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	358,881,102.72	358,881,102.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,572,846.82	10,572,846.82
应收利息	-	-	-	-	-	4,994.61	4,994.61
应收申购款	-	-	-	-	-	233,086.66	233,086.66
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,360,907.67	-	-	-	-	369,692,030.81	390,052,938.48
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,291,692.51	2,291,692.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	378,753.96	378,753.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	476,486.84	476,486.84
应付托管费	-	-	-	-	-	79,414.47	79,414.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	420,237.50	420,237.50
其他负债	-	-	-	-	-	179,088.20	179,088.20
负债总计	-	-	-	-	-	3,825,673.48	3,825,673.48
利率敏感度缺口	20,360,907.67	-	-	-	-	365,866,357.33	386,227,265.00
上年度末 2017 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	26,582,499.98	-	-	-	-	-	26,582,499.98
结算备付金	4,641,620.90	-	-	-	-	-	4,641,620.90
存出保证金	742,777.14	-	-	-	-	-	742,777.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	448,175,712.60	448,175,712.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	726,205.70	726,205.70
应收利息	-	-	-	-	-	7,617.04	7,617.04
应收申购款	-	-	-	-	-	500,386.25	500,386.25
资产总计	31,966,898.02	-	-	-	-	449,409,921.59	481,376,819.61
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,073,706.66	4,073,706.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	516,202.20	516,202.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	613,983.34	613,983.34
应付托管费	-	-	-	-	-	102,330.53	102,330.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,909,894.75	1,909,894.75
其他负债	-	-	-	-	-	60,414.75	60,414.75
负债总计	-	-	-	-	-	7,276,532.23	7,276,532.23
利率敏感度缺口	31,966,898.02	-	-	-	-	442,133,389.36	474,100,287.38

注：下表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)，银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	358,881,102.72	92.92	448,175,712.60	94.53
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	358,881,102.72	92.92	448,175,712.60	94.53

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%；投资于债券资产比例为基金资产的 0-35%；现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

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	
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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-5,754,786.25	-6,627,447.92
	2. 业绩基准下跌 5%	-28,773,931.24	-33,137,239.59
	3. 业绩基准下跌 10%	-57,547,862.49	-66,274,479.17

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§ 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	358,881,102.72	92.01
	其中：股票	358,881,102.72	92.01
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	19,427,954.16	4.98
7	其他各项资产	11,743,881.60	3.01
8	合计	390,052,938.48	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	297,308,045.83	76.98
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	11,080,022.46	2.87
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	27,644,049.80	7.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,777,641.00	2.79
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	12,071,343.63	3.13
S	综合	-	-
	合计	358,881,102.72	92.92

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	300037	新宙邦	1,012,900	27,135,591.00	7.03
2	603986	兆易创新	245,706	26,664,015.12	6.90
3	300073	当升科技	750,500	25,562,030.00	6.62
4	603799	华友钴业	260,837	25,423,782.39	6.58
5	600884	杉杉股份	1,021,799	22,581,757.90	5.85
6	300316	晶盛机电	1,637,667	21,764,594.43	5.64
7	300296	利亚德	1,128,300	14,532,504.00	3.76
8	603019	中科曙光	305,847	14,029,201.89	3.63
9	000977	浪潮信息	587,665	14,015,810.25	3.63
10	002460	赣锋锂业	352,400	13,595,592.00	3.52
11	600568	中珠医疗	2,632,831	12,637,588.80	3.27
12	300287	飞利信	1,709,500	12,291,305.00	3.18
13	002343	慈文传媒	643,119	12,071,343.63	3.13
14	300208	恒顺众昇	1,215,200	11,921,112.00	3.09
15	300450	先导智能	390,786	11,817,368.64	3.06
16	300070	碧水源	773,700	10,777,641.00	2.79
17	300750	宁德时代	144,000	10,362,240.00	2.68
18	000768	中航飞机	635,400	9,937,656.00	2.57
19	300059	东方财富	659,160	8,687,728.80	2.25
20	002371	北方华创	166,400	8,265,088.00	2.14
21	002202	金风科技	573,434	7,248,205.76	1.88
22	002640	跨境通	453,099	6,805,546.98	1.76
23	600038	中直股份	137,715	5,507,222.85	1.43
24	300308	中际旭创	85,581	5,138,283.24	1.33
25	300383	光环新网	377,600	5,063,616.00	1.31
26	002589	瑞康医药	284,400	3,879,216.00	1.00
27	000830	鲁西化工	223,800	3,822,504.00	0.99
28	300128	锦富技术	520,000	2,028,000.00	0.53

29	002456	欧菲科技	107,900	1,740,427.00	0.45
30	300302	同有科技	157,000	1,601,400.00	0.41
31	600566	济川药业	16,888	813,832.72	0.21
32	002737	葵花药业	29,572	639,642.36	0.17
33	603883	老百姓	4,753	395,259.48	0.10
34	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03

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	601588	北辰实业	49,372,834.68	10.41
2	603799	华友钴业	44,964,195.24	9.48
3	300316	晶盛机电	29,102,988.49	6.14
4	600568	中珠医疗	26,686,473.47	5.63
5	002043	兔宝宝	25,485,668.50	5.38
6	000651	格力电器	23,994,719.00	5.06
7	000830	鲁西化工	23,622,139.00	4.98
8	601398	工商银行	23,480,941.00	4.95
9	300037	新宙邦	23,053,066.00	4.86
10	600036	招商银行	22,991,671.30	4.85
11	300073	当升科技	22,959,846.00	4.84
12	600884	杉杉股份	22,129,380.83	4.67
13	002202	金风科技	21,353,126.31	4.50
14	601318	中国平安	19,632,649.90	4.14
15	002460	赣锋锂业	17,741,191.50	3.74
16	300296	利亚德	16,991,859.00	3.58
17	300287	飞利信	16,381,316.00	3.46
18	300208	恒顺众昇	15,778,608.94	3.33
19	002343	慈文传媒	15,770,765.08	3.33
20	603019	中科曙光	14,837,243.75	3.13
21	002035	华帝股份	14,555,816.43	3.07
22	000069	华侨城 A	14,375,455.94	3.03
23	300450	先导智能	14,291,010.00	3.01
24	600809	山西汾酒	14,210,614.12	3.00
25	600340	华夏幸福	13,796,096.60	2.91

26	300207	欣旺达	13,681,864.02	2.89
27	300070	碧水源	13,251,078.00	2.79
28	300182	捷成股份	13,188,698.86	2.78
29	002635	安洁科技	13,145,595.00	2.77
30	002640	跨境通	13,129,210.28	2.77
31	000977	浪潮信息	12,803,311.50	2.70
32	000002	万科 A	11,959,630.16	2.52
33	603986	兆易创新	11,503,807.20	2.43
34	600352	浙江龙盛	10,961,034.03	2.31
35	300750	宁德时代	10,465,107.00	2.21
36	000768	中航飞机	10,395,672.38	2.19
37	000333	美的集团	10,235,293.50	2.16
38	300136	信维通信	9,947,326.91	2.10
39	600383	金地集团	9,683,277.50	2.04
40	002572	索菲亚	9,649,457.46	2.04

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

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	601588	北辰实业	43,980,206.87	9.28
2	600568	中珠医疗	39,416,157.81	8.31
3	300316	晶盛机电	37,238,757.65	7.85
4	600036	招商银行	35,004,766.16	7.38
5	603986	兆易创新	34,435,148.04	7.26
6	002202	金风科技	32,985,937.46	6.96
7	601398	工商银行	31,804,593.77	6.71
8	002043	兔宝宝	28,932,870.04	6.10
9	600519	贵州茅台	27,796,900.37	5.86
10	603799	华友钴业	25,904,884.17	5.46
11	000651	格力电器	23,792,204.76	5.02
12	002310	东方园林	23,459,648.40	4.95
13	600585	海螺水泥	22,938,677.13	4.84
14	000830	鲁西化工	22,918,755.41	4.83
15	000858	五粮液	22,010,914.00	4.64
16	600029	南方航空	19,740,111.00	4.16

17	002129	中环股份	19,061,640.82	4.02
18	002050	三花智控	17,954,155.36	3.79
19	002027	分众传媒	17,834,342.73	3.76
20	601318	中国平安	17,594,692.82	3.71
21	300064	豫金刚石	16,379,019.02	3.45
22	601233	桐昆股份	15,354,373.07	3.24
23	002594	比亚迪	14,930,354.36	3.15
24	600887	伊利股份	14,725,029.94	3.11
25	601766	中国中车	14,568,745.46	3.07
26	600031	三一重工	14,247,141.72	3.01
27	000717	韶钢松山	13,633,242.00	2.88
28	600362	江西铜业	13,533,908.30	2.85
29	600340	华夏幸福	13,495,180.52	2.85
30	000002	万科 A	13,292,008.20	2.80
31	600809	山西汾酒	13,100,752.86	2.76
32	300207	欣旺达	12,804,719.82	2.70
33	002035	华帝股份	12,732,137.58	2.69
34	000069	华侨城 A	12,414,065.63	2.62
35	300182	捷成股份	11,870,084.18	2.50
36	000063	中兴通讯	11,459,176.86	2.42
37	300168	万达信息	11,074,582.63	2.34
38	002635	安洁科技	11,016,590.15	2.32
39	600352	浙江龙盛	10,948,262.67	2.31
40	000333	美的集团	10,298,604.80	2.17

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	1,167,689,973.83
卖出股票收入（成交）总额	1,185,804,883.33

注：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

本基金报告期末未投资债券。

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

本基金报告期末未投资债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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	932,953.51
2	应收证券清算款	10,572,846.82
3	应收股利	-

4	应收利息	4,994.61
5	应收申购款	233,086.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,743,881.60

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
32,141	18,500.71	35,785,052.12	6.02%	558,846,282.08	93.98%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

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（2008 年 4 月 23 日）基金份额总额	3,173,064,234.06
本报告期期初基金份额总额	605,332,966.69
本报告期基金总申购份额	61,347,661.56
减：本报告期基金总赎回份额	72,049,294.05
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	594,631,334.20

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。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本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	
东吴证券	2	754,533,136.43	32.08%	693,839.78	32.08%	-
渤海证券	2	410,397,055.59	17.45%	376,051.98	17.39%	-
安信证券	1	358,066,735.36	15.22%	333,467.65	15.42%	-
国泰君安	1	338,772,354.91	14.40%	308,723.59	14.27%	-
光大证券	1	240,710,185.04	10.23%	219,359.18	10.14%	-

招商证券	1	208,976,054.01	8.89%	194,619.30	9.00%	-
中信证券	2	35,674,863.37	1.52%	32,510.66	1.50%	-
申银万国	1	4,768,435.94	0.20%	4,440.90	0.21%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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 3 个交易单元，退租 0 个交易单元。

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。

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 2017 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2018 年 1 月 2 日

2	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	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）	2018 年 1 月 10 日
3	东吴基金管理有限公司关于参加南京苏宁基金销售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）	2018 年 1 月 10 日
4	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 19 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在大泰金石基金销售有限公司的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）	2018 年 1 月 31 日
6	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石基金销售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）	2018 年 1 月 31 日
7	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 5 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海利得基金销售有限公司的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）	2018 年 2 月 5 日
9	东吴基金管理有限公司关于参加上海利得基金销售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）	2018 年 2 月 5 日
10	东吴基金管理有限公司关于参加北京恒天明泽基金销售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）	2018 年 2 月 6 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 9 日

12	东吴基金管理有限公司关于修改东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同、托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 26 日
13	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）	2018 年 3 月 30 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2018 年 3 月 30 日
15	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）	2018 年 3 月 30 日
16	东吴基金管理有限公司关于参加东海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）	2018 年 3 月 30 日
17	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2017 年年度报告以及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 31 日
18	东吴基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告	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）	2018 年 4 月 3 日
19	东吴基金管理有限公司关于公司副总经理解聘的公告	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）	2018 年 4 月 3 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金惠家保险代理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）	2018 年 4 月 11 日
21	东吴基金管理有限公司关于参加金惠家保险代理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）	2018 年 4 月 11 日

		网)	
22	东吴基金管理有限公司关于工商变更登记的公告	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）	2018 年 4 月 14 日
23	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 19 日
24	东吴基金管理有限公司关于参加中国银河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）	2018 年 5 月 18 日
25	东吴行业轮动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、中国证券报、证券时报、公司网站	2018 年 6 月 6 日
26	东吴基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	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）	2018 年 6 月 11 日
27	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中民财富基金销售（上海）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）	2018 年 6 月 22 日
28	东吴基金管理有限公司关于参加中民财富基金销售（上海）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）	2018 年 6 月 22 日
29	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）	2018 年 6 月 30 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

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。

§ 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行业轮动股票型证券投资基金设立的文件；
2. 《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《东吴行业轮动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. 报告期内东吴行业轮动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

2018 年 8 月 29 日