

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 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.....	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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金
基金简称	东吴嘉禾优势精选混合
基金主代码	580001
交易代码	580001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 2 月 1 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	673,962,226.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济成长，以中低风险水平获得中长期较高收益。
投资策略	在资产配置上，本基金根据各类别资产风险收益水平及本基金风险收益目标，确定大类资产配置比例。在平衡风险收益基础上，把握优势成长，追求中长期较高收益。在股票选择上，本基金根据个股在行业、企业、价格三方面比较优势的分析，精选出具有行业、企业、价格三重比较优势及具有企业、价格两重比较优势的个股作为投资对象。在股票具体操作策略上，将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在中长时间段上进行周期持有，同时根据指数及个股运行的时空和量价效应进行中短时间段上的波段操作。
业绩比较基准	65%*(60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数)+35%*中证全债指数。
风险收益特征	本基金定位于中低风险水平，力求通过选股方法、投资策略等，谋求中长期较高收益。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	郭明
	联系电话	021-50509888-8206	010-66105799
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95588
传真		021-50509888-8211	010-66105798
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区复兴门内大街 55

		号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	王炯	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	27,918,864.37
本期利润	63,097,661.88
加权平均基金份额本期利润	0.0972
本期加权平均净值利润率	13.20%
本期基金份额净值增长率	15.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-171,421,136.56
期末可供分配基金份额利润	-0.2543
期末基金资产净值	502,541,090.43
期末基金份额净值	0.7457
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	199.37%

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

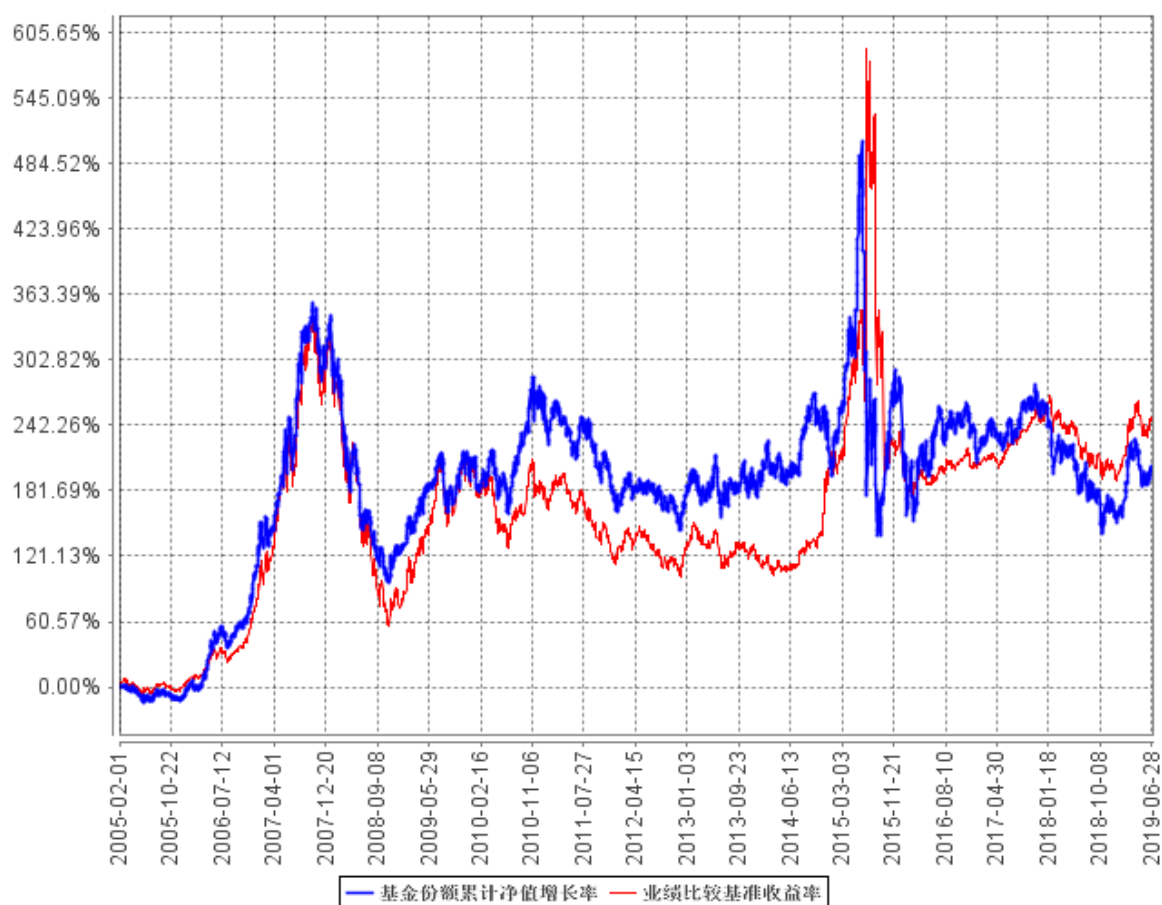
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.52%	1.11%	3.78%	0.78%	-2.26%	0.33%
过去三个月	-6.51%	1.39%	-0.42%	1.02%	-6.09%	0.37%
过去六个月	15.77%	1.42%	19.89%	1.03%	-4.12%	0.39%
过去一年	2.22%	1.52%	8.47%	1.01%	-6.25%	0.51%
过去三年	-13.56%	1.26%	18.33%	0.74%	-31.89%	0.52%
自基金合同生效起至今	199.37%	1.68%	248.53%	1.14%	-49.16%	0.54%

注：比较基准=65%*(60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数)+35%*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. 东吴嘉禾基金于 2005 年 2 月 1 日成立。

2. 比较基准=65%*(60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数)+35%*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。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 2019 年 6 月末,公司旗下管理着 29 只公募基金,资产管理总规模 688 亿元(包括专户、专项资产管理规模),涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求。自 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,进一步引入了量化投资策略,并在业内率先成立了绝对收益部,谋求穿越牛熊的长期业绩回报。

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,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,兼顾流动性与收益率,为大类资产配置提供基础性工具。

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		
曹松涛	基金经理	2017 年 4 月 14 日	2019 年 5 月 13 日	12 年	曹松涛,金融学博士。2004 年 4 月至 2005 年 12 月在招商证券总裁办工作,任研究员,2006 年 9 月至 2007 年 7 月脱产读博士一年,2007 年 9 月至 2011 年 3 月在招商证券战略发展部工作,历任高级研究员,总经理助理,2011 年 4 月至 2014 年 8 月在招商证券股票投资部工作,任海外投资董事。2014 年 8 月至 2016 年 12 月在宝盈

					基金管理有限公司工作，任专户投资部投资经理。2017年1月3日加入东吴基金管理有限公司，曾任基金经理，其中，2017年4月14日至2019年5月13日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，2017年12月5日至2019年5月13日任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
彭敢	首席投资官兼权益投资总部总经理、基金经理	2017年7月14日	-	17年	彭敢，硕士研究生。曾任大鹏证券研究所研究员、银华基金有限公司投资部研究员、银华基金管理有限公司投资管理部研究员、万联证券有限责任公司研发中心首席分析师、财富证券有限责任公司证券投资部投资经理、宝盈基金管理有限公司基金经理等职，2017年2月28日加入我司，现任公司首席投资官兼权益投资总部总经理，自2017年7月14日起担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，自2017年12月5日起担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
胡启聪	基金经理	2019年6月21日	-	4.5年	胡启聪，2012年11月毕业于香港科技大学，获硕士学位。2012年08月至2014年06月就职于国信证券深圳红岭分公司，从事机构相关业务；2014年06月至2014年09月实业企业学习深造；2014年09月至2016年12月就职于宝盈基金管理有限公司，任投资部投资秘书。2016年12月至今就职于东吴

					基金管理有限公司，从事投资研究工作，现任基金经理，其中，自 2019 年 6 月 21 日起任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理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

19 年二季度，市场在经历了年初一波的快速普涨后，进入震荡期，在内部流动性宽松的边际转向、重提去杠杆、和外部贸易战谈判进度不及预期等各种因素影响下，市场快速调整，半个月各大主要指数下跌幅度超过 10%。

1 季度市场的大幅上涨后，我们判断市场短期上涨过快，各种利好因素已经相对充分反映，

继续向上的动力不足，随时有可能面临调整。基于这样的判断，4 月份以来，我们适当降低了仓位，对前期涨幅较大的品种进行了减仓，转而配置一些基本面扎实、安全边际较高的低位品种。从二季度的具体操作来看，我们减持了前期涨幅较大的 5G 零部件厂商、互联网内容审核的龙头公司，加配了基本面好转的非银龙头、成长性突出的小银行龙头和公用事业领域的水电公司，使得整体组合的估值大幅下降，对基金净值的整体回撤做了正贡献。在具体行业配置上，我们从着眼于 3-5 年长期思路，坚持看好以满足美好生活需求为核心的消费、以及建设科技强国为目标的创新产业投资主线，重点布局具备“新成长股”特征的优质标的，涵盖互联网云计算、基因检测、5G 通信、新能源产业链后端服务、人工智能、高端装备制造等行业。在此前提下，根据市场环境的变化，灵活调整组合配置，适当选择估值低、业绩增长确定性强的周期行业品种。

从长期来看，我们认为“以满足人们各种需求和提高生活品质的新消费方式和产品、以人工智能、新能源为主线，新技术新产品的探索、以自主可控、自强为目标的核心技术与设备的研发制造”等会是未来经济发展的中流砥柱，这些行业的优质公司也会成为资本市场的中坚力量。在经历了外部和内部冲击过后，中国社会从上至下更加意识到创新的力量，拥有核心技术的重要性，伴随着科创板的推出，我们有信心未来科技创新将会在社会进步、经济发展中扮演愈发重要的角色。

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 0.7457 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.77%，业绩比较基准收益率为 19.89%。

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，在中美贸易战出现缓和、预期基本面触底走平和政策支持力度加大的背景下，我们预计 A 股市场将会出现阶段性的投资机会。

从外部环境来看，6 月 G20 峰会后中美两国都同意重启谈判，美国不再对中国出口产品加征新的关税，且华为事件也出现了一定转机。虽然目前看尚未达成明确的共识，但重启谈判本身就是市场悲观预期的修复。

从国内情况来看，截止 7 月 15 日约 45% 的 A 股上市公司披露了中报预告，可比口径下，预计主板（剔除中兴通讯）/中小板/创业板 /全部 A 股 2019H1 净利润增速分别为 +8.6%/-6.0%/-3.0%/+1.0%。对应 Q2 单季度盈利增速分别为 2.9%/+5.4%/+7.9%/+5.0%，环比分别 -13.4 %/+27.4 %/+22.2%/+9.0%。主板二季度盈利下滑趋势依旧，而中小板和创业板的环比上升则主要受益于基数影响，但板块中大市值个股业绩明显超过中小市值。虽然披露的公司数量有限，但管中窥豹上市公司基本面的压力还是比较大的。在这样的背景下，市场预期一系列的支撑和促

进政策将会出台，叠加前期对冲政策的效果逐步显现和外部环境的好转，投资者对于基本面的预期边际改善，有利于整体市场信心的恢复。

从政策力度来看，下半年一系列刺激和激励政策有望持续。首先，国内宏观流动性持续充裕，预计 7 月中旬会再次降准；其次，调结构和开放类政策的会持续推出；再次，积极的财政政策也会择机调整。

虽然内外部的压力依然很大，但本基金管理人认为经济将在多重政策支持下企稳，A 股市场也会有结构性机会。经历了过去经济的高速发展，下一阶段改革创新将会是中国经济新的核心动力，在科技进步、产业升级的背景下，我们对未来充满信心。中长期来看，我们认为“以满足人们各种需求和提高生活品质的新消费方式和产品、以人工智能、新能源为主线，新技术新产品的探索、以自主可控、自强为目标的核心技术与设备的研发制造”等会是未来经济发展的中流砥柱，这些行业的优质公司也会成为资本市场的中坚力量。在经历了外部和内部冲击过后，中国社会从上至下更加意识到创新的力量，拥有核心技术的重要性，伴随着科创板的推出，我们有信心未来科技创新将会在社会进步、经济发展中扮演愈发重要的角色。

我们相信，企业的持续盈利才是股票投资长期获利的根本来源；因此，我们将继续在自身能力圈范围以内，严格控制风险，维持稳定的投资风格，专注于自下而上的挑选行业发展空间大、具备竞争优势的龙头公司，分散持股，长期投资，力争通过分享企业价值来获取良好的长期投资回报。

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，成员由分管运营副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、绝对收益部、固定收益部、专户投资部）负责人、合规风控部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

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。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；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遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,293,311.59	30,907,706.20
结算备付金		1,838,972.23	1,791,872.92
存出保证金		486,750.70	342,571.50
交易性金融资产	6.4.7.2	477,894,741.14	382,321,776.06
其中：股票投资		427,932,334.74	371,779,644.48
基金投资		-	-
债券投资		49,962,406.40	10,542,131.58
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	529,588.67	13,966.59
应收股利		-	-
应收申购款		21,292.64	60,303.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		510,064,656.97	415,438,196.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		5,041,120.31	-
应付赎回款		387,554.19	53,794.99
应付管理人报酬		612,439.79	537,390.78
应付托管费		102,073.27	89,565.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,288,062.73	1,289,802.88
应交税费		-	218.76

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	92,316.25	160,009.62
负债合计		7,523,566.54	2,130,782.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	673,962,226.99	641,689,369.80
未分配利润	6.4.7.10	-171,421,136.56	-228,381,955.30
所有者权益合计		502,541,090.43	413,307,414.50
负债和所有者权益总计		510,064,656.97	415,438,196.66

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7457 元，基金份额总额 673,962,226.99 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		74,408,666.29	-92,998,276.79
1.利息收入		518,843.68	393,141.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	268,976.90	359,208.15
债券利息收入		231,155.40	650.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,711.38	33,282.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,688,921.94	-59,955,788.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,526,830.89	-63,442,623.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	175,431.15	-
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	1,986,659.90	3,486,835.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	35,178,797.51	-33,632,759.35
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	22,103.16	197,129.27
减：二、费用		11,311,004.41	10,753,490.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,545,987.17	3,993,984.64

2. 托管费	6.4.10.2.2	590,997.83	665,664.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,063,481.45	5,938,433.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		73.61	2.40
7. 其他费用	6.4.7.19	110,464.35	155,405.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,097,661.88	-103,751,767.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		63,097,661.88	-103,751,767.24

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	641,689,369.80	-228,381,955.30	413,307,414.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,097,661.88	63,097,661.88
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）	32,272,857.19	-6,136,843.14	26,136,014.05
其中：1.基金申购款	75,589,794.36	-16,374,564.84	59,215,229.52
2.基金赎回款	-43,316,937.17	10,237,721.70	-33,079,215.47
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）	673,962,226.99	-171,421,136.56	502,541,090.43

项目	上年度可比期间 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)	833,527,544.54	-93,595,431.06	739,932,113.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-103,751,764.84	-103,751,764.84
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)	-182,741,764.30	21,337,099.48	-161,404,664.82
其中：1.基金申购款	26,178,414.62	-5,601,569.36	20,576,845.26
2.基金赎回款	-208,920,178.92	26,938,668.84	-181,981,510.08
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)	650,785,780.24	-176,010,096.42	474,775,683.82

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

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金（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”）证监基金字[2004]201号文《关于同意东吴嘉禾优势精选混合型开放式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发行募集，基金合同于2005年2月1日正式生效，首次设立募集规模为1,029,352,840.95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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资范围为法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金整体业绩比较基准=65%*(60%*上证180+40%*深证100)+35%*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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 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。

5. 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	29,293,311.59
定期存款	-
其他存款	-

合计:	29,293,311.59
-----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	455,416,736.48	427,932,334.74	-27,484,401.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,962,406.40	83,406.40
	银行间市场	-	-
	合计	49,962,406.40	83,406.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	505,295,736.48	477,894,741.14	-27,400,995.34

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	6,521.64
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	744.84
应收债券利息	522,125.00
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	197.19
合计	529,588.67

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,288,062.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,288,062.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	469.90
预提费用	91,846.35
应付审计费	-
应付信息披露费	-
合计	92,316.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	641,689,369.80	641,689,369.80
本期申购	75,589,794.36	75,589,794.36
本期赎回(以“-”号填列)	-43,316,937.17	-43,316,937.17
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	673,962,226.99	673,962,226.99

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	-23,204,256.24	-205,177,699.06	-228,381,955.30
本期利润	27,918,864.37	35,178,797.51	63,097,661.88
本期基金份额交易产生的变动数	2,177,405.44	-8,314,248.58	-6,136,843.14
其中：基金申购款	1,834,893.10	-18,209,457.94	-16,374,564.84
基金赎回款	342,512.34	9,895,209.36	10,237,721.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,892,013.57	-178,313,150.13	-171,421,136.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	229,634.99
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	35,904.45
其他	3,437.46
合计	268,976.90

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	2,362,528,631.63
减：卖出股票成本总额	2,326,001,800.74
买卖股票差价收入	36,526,830.89

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,768,590.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	10,563,400.00

本总额	
减：应收利息总额	29,758.86
买卖债券差价收入	175,431.15

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期未进行权证投资交易。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他投资交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,986,659.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,986,659.90

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	35,178,797.51
——股票投资	35,072,122.69
——债券投资	106,674.82
——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	35,178,797.51

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21,899.48
转换费收入	203.68
合计	22,103.16

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,063,481.45
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	7,063,481.45

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	62,093.57
汇划费	618.00
账户维护费	18,000.00
其他费用	-
数字证书服务费	-
合计	110,464.35

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
中国工商银行股份有限公司	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东吴证券股份有限公 司	1,082,768,436.51	23.00%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 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 2019年1月1日至2019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	996,987.99	23.28%	6,273.62	0.49%
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

注：股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,545,987.17	3,993,984.64
其中：支付销售机构的客户维护费	844,511.83	938,847.32

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付本给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	590,997.83	665,664.16

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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及上年度末均未投资本基金。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
中国工商银行股份有限公司	29,293,311.59	229,634.99	36,352,491.47	330,487.42

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未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（2019 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
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
000791	甘肃电投	2019年6月11日	2019年12月10日	大宗交易买入	3.96	4.05	1,700,000	6,732,000.00	6,885,000.00	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

基金本报告期末未持有因暂时性停牌而流通受限的股票。

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 2019 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 2019 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。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现以中低风险水平获得中长期较高收益的风险收益

目标。

本基金投资目标为通过个股精选、科学的操作策略及严密的风险控制等手段来降低投资风险，力争将本基金的风险水平控制在比较基准的一定幅度范围内；同时，本基金通过对中国经济成长规律的准确把握和对具有价值成长比较优势股票的前瞻性投资来分享中国经济成长，获得中长期较高收益。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，将风险控制限定在限定的范围之内。

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约责任，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。本基金投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	49,960,000.00	-
合计	49,960,000.00	-

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	2,406.40	10,002,000.00
AAA 以下	-	540,131.58
未评级	-	-
合计	2,406.40	10,542,131.58

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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

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 7.4.12 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，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、债券投资、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	29,293,311.59	-	-	-	-	-	29,293,311.59
结算备付金	1,838,972.23	-	-	-	-	-	1,838,972.23
存出保证金	486,750.70	-	-	-	-	-	486,750.70
交易性金融资产	-	-	-	-	2,406.40	427,932,334.74	477,894,741.14
应收利息	-	-	-	-	-	529,588.67	529,588.67
应收申购款	-	-	-	-	-	21,292.64	21,292.64
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,619,034.52	-	-	-	2,406.40	428,483,216.05	510,064,656.97
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,041,120.31	5,041,120.31
应付赎回款	-	-	-	-	-	387,554.19	387,554.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	612,439.79	612,439.79
应付托管费	-	-	-	-	-	102,073.27	102,073.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,288,062.73	1,288,062.73
其他负债	-	-	-	-	-	92,316.25	92,316.25
负债总计	-	-	-	-	-	7,523,566.54	7,523,566.54
利率敏感度缺口	31,619,034.52	-	-	-	2,406.40	420,959,649.51	502,541,090.43
上年度末	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

2018 年 12 月 31 日		月	-1 年				
资产							
银行存款	30,907,706.20	-	-	-	-	-	30,907,706.20
结算备付金	1,791,872.92	-	-	-	-	-	1,791,872.92
存出保证金	342,571.50	-	-	-	-	-	342,571.50
交易性金融资产	-	-	-	10,540,131.58	2,000.00	371,779,644.48	382,321,776.06
应收利息	-	-	-	-	-	13,966.59	13,966.59
应收申购款	-	-	-	-	-	60,303.39	60,303.39
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,042,150.62	-	-	10,540,131.58	2,000.00	371,853,914.46	415,438,196.66
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,794.99	53,794.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	537,390.78	537,390.78
应付托管费	-	-	-	-	-	89,565.13	89,565.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,289,802.88	1,289,802.88
应交税费	-	-	-	-	-	218.76	218.76
其他负债	-	-	-	-	-	160,009.62	160,009.62
负债总计	-	-	-	-	-	2,130,782.16	2,130,782.16
利率敏感度缺口	33,042,150.62	-	-	10,540,131.58	2,000.00	369,723,132.30	413,307,414.50

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	67,306.84	30,741.83
	利率上升 25 个基点	-67,052.17	-30,531.69

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

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和债券，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 2019年6月30日		上年度末 2018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	427,932,334.74	85.15	371,779,644.48	89.95
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	427,932,334.74	85.15	371,779,644.48	89.95

注：本基金投资组合中股票投资比例为 30%-95%；投资债券资产不高于基金资产的 60%；现金类资产最低比例为 5%，其中，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		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-6,231,509.52	-5,827,634.54
	2. 业绩基准下跌 5%	-31,157,547.61	-29,138,172.72
	3. 业绩基准下跌 10%	-62,315,095.21	-58,276,345.44

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	427,932,334.74	83.90
	其中：股票	427,932,334.74	83.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,962,406.40	9.80
	其中：债券	49,962,406.40	9.80
	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	-	-
	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	31,132,283.82	6.10
8	其他各项资产	1,037,632.01	0.20
9	合计	510,064,656.97	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	54,128,973.54	10.77
B	采矿业	9,666,027.00	1.92
C	制造业	185,403,595.73	36.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,196,946.00	3.62
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,439,553.74	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,350,000.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,857,728.70	10.32
J	金融业	30,766,555.28	6.12

K	房地产业	18,272,021.88	3.64
L	租赁和商务服务业	7,837,915.50	1.56
M	科学研究和技术服务业	20,291,239.02	4.04
N	水利、环境和公共设施管理业	15,332,357.75	3.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,389,420.60	0.87
S	综合	-	-
	合计	427,932,334.74	85.15

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	000998	隆平高科	1,263,300	18,292,584.00	3.64
2	603506	南都物业	750,083	18,272,021.88	3.64
3	300676	华大基因	299,200	17,066,368.00	3.40
4	000915	山大华特	800,481	16,369,836.45	3.26
5	002142	宁波银行	660,947	16,021,355.28	3.19
6	300094	国联水产	3,509,454	15,827,637.54	3.15
7	002549	凯美特气	2,666,497	15,332,357.75	3.05
8	600201	生物股份	950,300	14,910,207.00	2.97
9	300624	万兴科技	306,469	14,780,999.87	2.94
10	601128	常熟银行	1,910,000	14,745,200.00	2.93
11	300001	特锐德	750,500	13,524,010.00	2.69
12	300470	日机密封	500,100	12,422,484.00	2.47
13	300601	康泰生物	230,042	12,077,205.00	2.40
14	300684	中石科技	573,860	11,591,972.00	2.31
15	603605	珀莱雅	170,902	11,310,294.36	2.25
16	002675	东诚药业	1,035,021	11,302,429.32	2.25
17	002215	诺普信	1,600,000	11,200,000.00	2.23
18	300755	华致酒行	296,494	10,439,553.74	2.08
19	002458	益生股份	530,000	10,340,300.00	2.06
20	603043	广州酒家	300,300	9,708,699.00	1.93
21	601225	陕西煤业	1,009,800	9,330,552.00	1.86
22	002488	金固股份	1,060,000	8,829,800.00	1.76

23	002382	蓝帆医疗	620,000	8,568,400.00	1.71
24	002373	千方科技	500,000	8,550,000.00	1.70
25	300454	深信服	89,800	7,861,092.00	1.56
26	300612	宣亚国际	393,075	7,837,915.50	1.56
27	300047	天源迪科	911,811	7,631,858.07	1.52
28	300699	光威复材	230,000	7,521,000.00	1.50
29	000791	甘肃电投	1,793,080	7,285,244.00	1.45
30	002773	康弘药业	220,000	7,242,400.00	1.44
31	002200	*ST 云投	1,037,000	6,429,400.00	1.28
32	300252	金信诺	555,080	5,795,035.20	1.15
33	600886	国投电力	700,000	5,439,000.00	1.08
34	300655	晶瑞股份	331,206	5,229,742.74	1.04
35	300348	长亮科技	330,150	4,787,175.00	0.95
36	600995	文山电力	588,300	4,729,932.00	0.94
37	300074	华平股份	1,110,000	4,662,000.00	0.93
38	000681	视觉中国	225,300	4,366,314.00	0.87
39	300122	智飞生物	90,000	3,879,000.00	0.77
40	300253	卫宁健康	250,000	3,545,000.00	0.71
41	002007	华兰生物	113,710	3,467,017.90	0.69
42	603181	皇马科技	230,340	3,420,549.00	0.68
43	300673	佩蒂股份	123,420	3,285,440.40	0.65
44	300125	易世达	222,866	3,224,871.02	0.64
45	600598	北大荒	300,000	3,219,000.00	0.64
46	300097	智云股份	198,251	1,998,370.08	0.40
47	601021	春秋航空	30,000	1,350,000.00	0.27
48	300241	瑞丰光电	138,900	825,066.00	0.16
49	000966	长源电力	131,000	742,770.00	0.15
50	300142	沃森生物	21,800	618,248.00	0.12
51	600968	海油发展	94,500	335,475.00	0.07
52	600161	天坛生物	5,128	129,482.00	0.03
53	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
54	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
55	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
56	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
57	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
58	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
59	600371	万向德农	900	10,206.00	0.00
60	002041	登海种业	900	9,846.00	0.00

注：本基金本报告期末持有甘肃电投（000791）上市流通及流通受限部分，上表中按同一股票合并计

算。

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	300252	金信诺	90,809,480.29	21.97
2	300001	特锐德	79,446,090.42	19.22
3	601225	陕西煤业	76,925,328.90	18.61
4	001979	招商蛇口	68,396,260.95	16.55
5	300454	深信服	61,020,199.40	14.76
6	300498	温氏股份	59,941,690.72	14.50
7	601238	广汽集团	53,882,674.90	13.04
8	600196	复星医药	50,915,201.23	12.32
9	000002	万科 A	43,725,846.49	10.58
10	300761	立华股份	42,444,182.99	10.27
11	300747	锐科激光	42,205,026.30	10.21
12	300624	万兴科技	40,709,981.80	9.85
13	603885	吉祥航空	38,634,684.65	9.35
14	600115	东方航空	36,254,525.15	8.77
15	002118	紫鑫药业	35,182,750.72	8.51
16	601128	常熟银行	34,004,860.00	8.23
17	300612	宣亚国际	32,794,951.56	7.93
18	603506	南都物业	32,462,485.00	7.85
19	600201	生物股份	30,919,088.90	7.48
20	300097	智云股份	30,280,774.20	7.33
21	300655	晶瑞股份	30,082,162.47	7.28
22	603323	苏农银行	29,960,371.29	7.25
23	000998	隆平高科	29,943,638.07	7.24
24	002007	华兰生物	29,760,510.00	7.20
25	600975	新五丰	29,204,275.60	7.07
26	600572	康恩贝	28,610,002.08	6.92
27	000710	贝瑞基因	27,322,575.00	6.61
28	002027	分众传媒	27,153,793.00	6.57
29	002352	顺丰控股	25,727,395.42	6.22

30	000915	山大华特	24,330,043.25	5.89
31	300545	联得装备	24,261,005.44	5.87
32	000791	甘肃电投	24,239,704.00	5.86
33	600546	山煤国际	23,906,074.69	5.78
34	002142	宁波银行	23,599,920.02	5.71
35	601021	春秋航空	23,369,503.40	5.65
36	601088	中国神华	23,181,936.10	5.61
37	002773	康弘药业	22,916,516.00	5.54
38	000681	视觉中国	22,610,335.00	5.47
39	300047	天源迪科	22,146,876.09	5.36
40	001965	招商公路	22,092,631.54	5.35
41	600050	中国联通	21,984,599.88	5.32
42	002549	凯美特气	21,968,384.70	5.32
43	002368	太极股份	21,568,441.36	5.22
44	300666	江丰电子	21,349,328.00	5.17
45	300470	日机密封	21,114,967.54	5.11
46	002075	沙钢股份	20,899,633.00	5.06
47	300684	中石科技	20,618,366.20	4.99
48	603605	珀莱雅	19,891,757.06	4.81
49	300348	长亮科技	19,362,427.00	4.68
50	603259	药明康德	19,170,890.00	4.64
51	300676	华大基因	18,590,471.00	4.50
52	002926	华西证券	17,259,197.55	4.18
53	300601	康泰生物	16,519,603.53	4.00
54	300142	沃森生物	15,195,601.96	3.68
55	300125	易世达	14,933,966.53	3.61
56	300408	三环集团	14,430,673.00	3.49
57	002215	诺普信	13,882,280.00	3.36
58	002458	益生股份	13,673,523.70	3.31
59	600426	华鲁恒升	13,639,617.93	3.30
60	601601	中国太保	13,616,914.00	3.29
61	600486	扬农化工	13,591,193.50	3.29
62	600745	闻泰科技	13,517,564.60	3.27
63	600048	保利地产	13,320,322.00	3.22
64	600633	浙数文化	13,300,345.00	3.22
65	600570	恒生电子	12,869,833.00	3.11

66	300122	智飞生物	12,693,756.00	3.07
67	603160	汇顶科技	12,153,137.00	2.94
68	600886	国投电力	12,141,745.03	2.94
69	002675	东诚药业	11,789,793.00	2.85
70	002624	完美世界	11,766,268.00	2.85
71	002373	千方科技	11,630,166.44	2.81
72	002488	金固股份	11,383,313.50	2.75
73	600995	文山电力	11,091,289.00	2.68
74	300094	国联水产	11,068,166.41	2.68
75	600703	三安光电	10,634,935.00	2.57
76	601318	中国平安	10,554,469.00	2.55
77	600161	天坛生物	10,498,826.00	2.54
78	603043	广州酒家	10,293,913.70	2.49
79	000766	通化金马	10,126,912.00	2.45
80	600332	白云山	9,918,339.00	2.40
81	603713	密尔克卫	9,715,102.00	2.35
82	600585	海螺水泥	9,421,848.64	2.28
83	300253	卫宁健康	9,368,974.00	2.27
84	300755	华致酒行	9,343,598.67	2.26
85	600837	海通证券	8,895,683.85	2.15
86	002382	蓝帆医疗	8,678,548.15	2.10
87	600598	北大荒	8,408,622.00	2.03

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	300252	金信诺	101,960,067.97	24.67
2	601225	陕西煤业	88,330,357.89	21.37
3	300454	深信服	83,962,411.30	20.31
4	001979	招商蛇口	67,649,082.58	16.37
5	300001	特锐德	65,261,511.19	15.79
6	300498	温氏股份	62,155,350.50	15.04
7	601238	广汽集团	58,486,643.58	14.15
8	600196	复星医药	57,433,809.92	13.90

9	300097	智云股份	53,177,970.38	12.87
10	300747	锐科激光	50,128,358.44	12.13
11	300655	晶瑞股份	45,156,870.64	10.93
12	000002	万科 A	42,985,166.84	10.40
13	002773	康弘药业	41,302,112.98	9.99
14	300624	万兴科技	40,947,279.32	9.91
15	603885	吉祥航空	40,707,987.11	9.85
16	002352	顺丰控股	40,575,755.47	9.82
17	000710	贝瑞基因	38,462,735.00	9.31
18	600115	东方航空	37,175,186.45	8.99
19	002118	紫鑫药业	35,810,769.04	8.66
20	300761	立华股份	34,302,957.70	8.30
21	000915	山大华特	31,376,987.96	7.59
22	600975	新五丰	31,085,733.10	7.52
23	603323	苏农银行	28,874,478.75	6.99
24	000681	视觉中国	27,630,995.56	6.69
25	002007	华兰生物	27,246,756.84	6.59
26	600572	康恩贝	27,092,546.00	6.56
27	002027	分众传媒	26,950,989.80	6.52
28	601021	春秋航空	25,759,726.93	6.23
29	600546	山煤国际	24,906,256.59	6.03
30	600859	王府井	24,886,848.47	6.02
31	300545	联得装备	24,835,855.82	6.01
32	300676	华大基因	23,766,043.00	5.75
33	002368	太极股份	23,630,501.32	5.72
34	300612	宣亚国际	23,204,094.00	5.61
35	601088	中国神华	22,983,449.76	5.56
36	002075	沙钢股份	22,623,584.00	5.47
37	600050	中国联通	22,460,937.90	5.43
38	300666	江丰电子	22,460,925.00	5.43
39	002465	海格通信	21,309,969.59	5.16
40	001965	招商公路	20,821,181.38	5.04
41	603506	南都物业	20,247,618.82	4.90
42	601128	常熟银行	20,119,039.00	4.87
43	603259	药明康德	19,678,534.00	4.76
44	300613	富瀚微	18,487,264.00	4.47
45	002926	华西证券	17,966,976.20	4.35
46	600201	生物股份	17,765,792.20	4.30

47	600995	文山电力	16,852,980.50	4.08
48	600745	闻泰科技	16,643,622.81	4.03
49	300142	沃森生物	15,568,314.90	3.77
50	300408	三环集团	15,566,370.00	3.77
51	600633	浙数文化	14,227,575.64	3.44
52	300047	天源迪科	14,174,577.54	3.43
53	600426	华鲁恒升	14,097,500.84	3.41
54	600486	扬农化工	14,043,716.75	3.40
55	603160	汇顶科技	13,978,195.05	3.38
56	000001	平安银行	13,949,327.76	3.38
57	300348	长亮科技	13,898,486.50	3.36
58	600048	保利地产	13,564,256.33	3.28
59	601601	中国太保	13,269,818.00	3.21
60	600570	恒生电子	13,106,412.52	3.17
61	000028	国药一致	12,475,764.08	3.02
62	300122	智飞生物	12,451,354.70	3.01
63	000998	隆平高科	12,328,181.60	2.98
64	600703	三安光电	12,213,171.90	2.95
65	601336	新华保险	12,181,274.00	2.95
66	002624	完美世界	11,437,692.00	2.77
67	600161	天坛生物	11,337,824.70	2.74
68	000791	甘肃电投	11,302,527.19	2.73
69	300125	易世达	11,177,670.11	2.70
70	300094	国联水产	11,119,743.20	2.69
71	601318	中国平安	10,767,531.00	2.61
72	603713	密尔克卫	10,125,117.00	2.45
73	603605	珀莱雅	10,095,641.00	2.44
74	300470	日机密封	10,046,556.40	2.43
75	600332	白云山	9,862,465.04	2.39
76	600585	海螺水泥	9,682,015.58	2.34
77	600837	海通证券	8,886,433.25	2.15
78	300324	旋极信息	8,626,244.47	2.09
79	000766	通化金马	8,602,550.00	2.08
80	002142	宁波银行	8,364,772.00	2.02
81	601328	交通银行	8,361,343.10	2.02

注：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	2,347,082,368.31
卖出股票收入（成交）总额	2,362,528,631.63

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

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	49,960,000.00	9.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,406.40	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,962,406.40	9.94

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	019611	19 国债 01	500,000	49,960,000.00	9.94
2	110049	海尔转债	20	2,406.40	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

本基金报告期末未持有贵金属投资。

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受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	486,750.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	529,588.67
5	应收申购款	21,292.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,037,632.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110049	海尔转债	2,406.40	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本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
43,899	15,352.56	62,566,562.47	9.28%	611,395,664.52	90.72%

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	12,567.07	0.0019%

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

高级管理人员、基金投资和研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（2005年2月1日）基金份额总额	1,029,352,840.95
本报告期期初基金份额总额	641,689,369.80
本报告期期间基金总申购份额	75,589,794.36
减：本报告期期间基金总赎回份额	43,316,937.17
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	673,962,226.99

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

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证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。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，制定相关整改措施，落实整改工作。

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	1,082,768,436.51	23.00%	996,987.99	23.28%	-
民生证券	1	479,580,905.30	10.19%	446,633.10	10.43%	-
中信证券	3	468,303,827.95	9.95%	388,650.92	9.07%	-
国盛证券	1	467,910,087.05	9.94%	426,405.96	9.95%	-
长江证券	1	457,938,566.05	9.73%	417,319.53	9.74%	-
海通证券	1	450,919,242.07	9.58%	410,922.67	9.59%	-
兴业证券	1	347,209,046.45	7.38%	316,413.37	7.39%	-

申银万国	1	242,027,969.03	5.14%	225,402.44	5.26%	-
东方财富	1	153,157,476.11	3.25%	139,572.89	3.26%	-
中信建投	1	122,875,071.44	2.61%	111,976.08	2.61%	-
光大证券	1	101,305,218.94	2.15%	94,344.59	2.20%	-
国泰君安	1	93,390,200.89	1.98%	86,974.44	2.03%	-
江海证券	2	93,296,997.84	1.98%	85,021.75	1.98%	-
长城证券	1	91,573,266.93	1.95%	85,282.66	1.99%	-
国信证券	1	32,302,965.01	0.69%	30,083.36	0.70%	-
东兴证券	2	22,981,891.51	0.49%	21,403.05	0.50%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 2 个交易单元，分别为国盛证券、天风证券；减少 1 个交易单元，为中信证券。

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	-	-	-	-	-	-
民生证券	10,007,232.87	16.51%	-	-	-	-
中信证券	732,425.63	1.21%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
申银万国	49,877,000.00	82.28%	175,000,000.00	100.00%	-
东方财富	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-

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 2018 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）	2019 年 1 月 2 日
2	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
3	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、证券日报、公司网站	2019 年 3 月 8 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额、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	2019 年 3 月 8 日
5	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金更新招募说明书以及摘要	上海证券报、公司网站	2019 年 3 月 15 日
6	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	上海证券报、公司网站	2019 年 3 月 29 日

7	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）	2019年3月30日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	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）	2019年4月12日
9	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、证券日报、公司网站	2019年4月17日
10	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金2019年第1季度报告	上海证券报、公司网站	2019年4月20日
11	东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站	2019年5月11日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国民生银行直销银行基金通平台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、证券日报、公司网站	2019年5月15日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年6月14日
14	东吴基金管理有限公司关于参加华瑞保险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	2019年6月14日
15	东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站	2019年6月21日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年6月21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

本报告期内没有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嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴嘉禾优势精选混合型开放式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、报告期内东吴嘉禾优势精选混合型开放式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

2019年8月27日