

# 东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

## 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：江苏银行股份有限公司

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。

基金托管人江苏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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴安鑫量化
基金主代码	002561
交易代码	002561
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 3 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	134,793,060.83 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化策略进行选股和择时，控制风险，追求持续的资产增值。
投资策略	本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略，进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损，另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合，以期为投资者带来稳定收益。
业绩比较基准	65%×中证 800 指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	柯振林
	联系电话	021-50509888-8206	025-58588217
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	kezhenlin@jsbchina.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95319
传真		021-50509888-8211	025-58588155
注册地址		上海浦东源深路 279 号	南京市中华路 26 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	南京市中华路 26 号
邮政编码		200135	210001
法定代表人		王炯	夏平

### 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
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	688,806.78
本期利润	2,360,044.47
加权平均基金份额本期利润	0.1370
本期加权平均净值利润率	13.95%
本期基金份额净值增长率	13.54%
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	258,617.28
期末可供分配基金份额利润	0.0019
期末基金资产净值	135,650,647.55
期末基金份额净值	1.006
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	12.68%

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

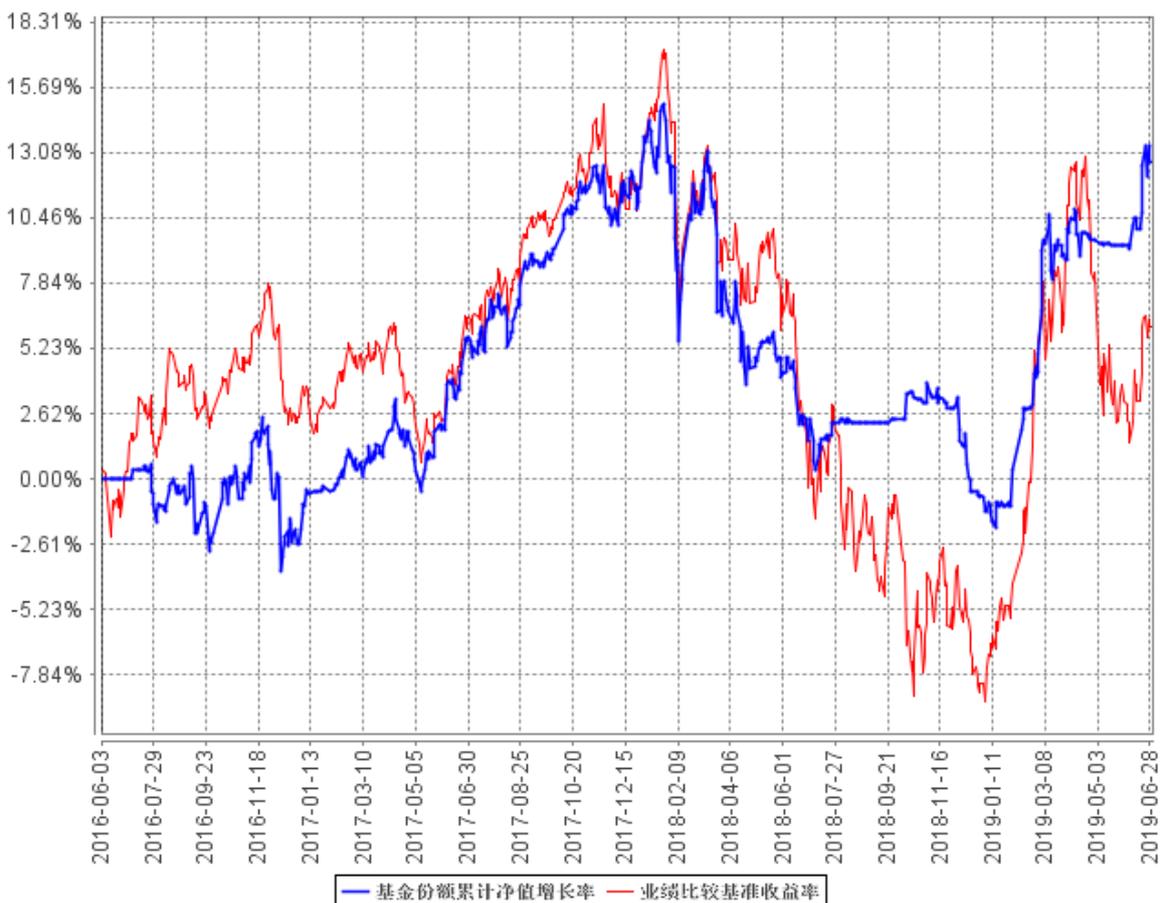
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.07%	0.57%	2.88%	0.77%	0.19%	-0.20%
过去三个月	3.60%	0.42%	-2.42%	1.01%	6.02%	-0.59%
过去六个月	13.54%	0.51%	16.36%	1.01%	-2.82%	-0.50%
过去一年	10.07%	0.41%	4.49%	0.99%	5.58%	-0.58%
过去三年	12.72%	0.51%	5.80%	0.73%	6.92%	-0.22%
自基金合同生效起至今	12.72%	0.51%	6.12%	0.73%	6.60%	-0.22%

注：业绩比较基准=65%×中证800指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率

### 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：本基金业绩比较基准=65%×中证 800 指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率

## § 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		
秦斌	本基金基金经理	2016 年 7 月 7 日	-	9 年	秦斌同志,硕士,2009 年 07 月至 2015 年 6 月就职于东吴证券股份有限公司,历任研究所金融工程分析师、投资总部数量化与衍生品交易研究员,2015 年 7 月加入东吴基金管理有限公司,曾任研究策划部研究员、基金经理助理,现任基金经理,自 2016 年 7 月 7 日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经

					理，自 2016 年 10 月 18 日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，其中，2016 年 7 月 7 日至 2018 年 10 月 13 日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为对外公告之日。

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

在经历了五个季度连续下跌之后，一季度，wind 全 A 大涨 30.71%，二季度短暂冲高后回落，累计下跌 4.62%，振幅高达 17.77%，而 wind 概念指数中业绩暴雷指数下跌 17.98%，振幅 35.57%，二线龙头指数下跌 7.83%，但白马股指数二季度上涨 1.63%，上证 50 上涨 3.24%，市场调整期间

资金迅速向业绩较为确定的大市值龙头集中。市场结构出现较为明显的“二八分化”。

本基金侧重在严格控制回撤风险的前提下，进行高胜率高质量的策略交易，二季度净值累计上涨 3.6%，有明显的绝对及相对收益，本基金严格按照量化模型在股票池内进行选股并结合择时模型进行仓位管理，由于选股加大了对个股基本面业绩确定性及市场一致预期的权重，且主线配置个股集中于各个细分子行业龙头，随着市场结构的逆转，量化系基金将逐步体现其优势。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.006 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.54%，业绩比较基准收益率为 16.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年的经济特征是建筑业景气、制造业疲弱，前者源于货币修复和财政前移，后者与出口下沉有关，下半年外贸环境的变化对宏观面演绎尤其关键。从股利贴现模型来看，2018 年-2019 年 A 股的核心驱动因素有所转变，金融供给侧改革主导广谱利率回落和风险偏好结构性改善，贴现率成为股价变化的牵引。从市场结构来看，A 股大小市值公司的流动性折溢价有所收敛，而不变的是绩优股的牛市和绩劣股的熊市仍在并行。

金融供给侧改革将从实体和金融两端影响企业盈利以及投资者对于企业盈利的偏好。股票市场分层明显，金融供给侧改革从股票供需两端推动 A 股优胜劣汰，流动性向优质公司集中，股票市场进入流动性分层时代。当前市场优质公司表现较好，市值上并非抱团取暖而是流动性分化趋势下的必然选择，A 股将经历一场优胜劣汰，以中国优势企业为代表的优质公司胜出。

上证指数处在迄今第三次季度 K 线连续五连阴后大幅反弹后的休整期，从市场运行的周期结构来看，处于中期上行趋势的回档区域，盈利回落、估值修复。预计三季度之后，待盈利见底后，市场有望迎来盈利及估值的戴维斯向上双击。

#### 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**

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 10 日出现基金资产净值低于五千万元的情形，于 2019 年 2 月 26 日至 2019 年 4 月 22 日、2019 年 4 月 29 日至 2019 年 6 月 30 日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。

## § 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，本基金托管人江苏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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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

本报告期内，东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴安鑫量化灵活配置混合型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，东吴安鑫量化灵活配置混合型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安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 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：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	52,058,092.48	3,224,361.93
结算备付金		-	29,550.36
存出保证金		47,592.48	96,875.99
交易性金融资产	6.4.7.2	78,299,255.19	1,075,629.00
其中：股票投资		78,299,255.19	1,075,629.00
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		5,370,856.34	18,375.96
应收利息	6.4.7.5	4,614.75	838.19
应收股利		-	-
应收申购款		99.85	99.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		135,780,511.09	4,445,731.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,046.38	-
应付管理人报酬		40,829.12	2,979.60
应付托管费		12,759.08	931.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	49,432.47	223.17
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	24,796.49	150,000.00
负债合计		129,863.54	154,133.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	134,793,060.83	4,842,592.23
未分配利润	6.4.7.10	857,586.72	-550,994.82
所有者权益合计		135,650,647.55	4,291,597.41
负债和所有者权益总计		135,780,511.09	4,445,731.28

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 134,793,060.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		2,653,432.63	-13,309,087.40
1.利息收入		32,781.06	1,239,785.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,781.06	95,626.35
债券利息收入		-	379,096.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	765,062.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		948,748.66	-9,697,016.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	364,158.72	-10,007,281.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	67,609.86
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	584,589.94	242,655.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,671,237.69	-4,856,484.55
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	665.22	4,627.95
<b>减：二、费用</b>		293,388.16	1,340,040.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	63,999.30	676,952.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,999.72	211,547.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	165,993.95	318,263.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	420.95
7. 其他费用	6.4.7.19	43,395.19	132,855.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,360,044.47	-14,649,127.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,360,044.47	-14,649,127.80

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

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）	4,842,592.23	-550,994.82	4,291,597.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,360,044.47	2,360,044.47
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）	129,950,468.60	-951,462.93	128,999,005.67
其中：1.基金申购款	131,196,599.89	-1,017,668.40	130,178,931.49
2.基金赎回款	-1,246,131.29	66,205.47	-1,179,925.82
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）	134,793,060.83	857,586.72	135,650,647.55
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)	178,044,631.55	-572,981.39	177,471,650.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,649,127.80	-14,649,127.80
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)	-1,962,233.01	46,608.26	-1,915,624.75
其中：1.基金申购款	660,252.23	-6,416.92	653,835.31
2.基金赎回款	-2,622,485.24	53,025.18	-2,569,460.06
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)	176,082,398.54	-15,175,500.93	160,906,897.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2016]198号《关于同意东吴安鑫量化灵活配置混合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2016年6月3日正式生效，首次设立募集规模为254,749,688.49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，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金投资于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（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的业绩比较基准为： $65\% \times$  中证 800 指数收益率 $+35\% \times$  中国债券综合全价（总值）指数收益率。

#### 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 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 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、地方政府债券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发展费附加的单位外）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	52,058,092.48
定期存款	-
其他存款	-
合计:	52,058,092.48

#### 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	76,643,639.61	78,299,255.19	1,655,615.58
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	76,643,639.61	78,299,255.19	1,655,615.58

#### 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 2019年6月30日
应收活期存款利息	4,595.40
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	-
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.35
合计	4,614.75

#### 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	49,432.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	49,432.47

#### 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	1.30
预提费用	24,795.19
应付审计费	-
应付信息披露费	-
合计	24,796.49

#### 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	4,842,592.23	4,842,592.23
本期申购	131,196,599.89	131,196,599.89
本期赎回(以“-”号填列)	-1,246,131.29	-1,246,131.29
- 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	134,793,060.83	134,793,060.83

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	-431,178.66	-119,816.16	-550,994.82
本期利润	688,806.78	1,671,237.69	2,360,044.47
本期基金份额交易产生的变动数	989.16	-952,452.09	-951,462.93
其中：基金申购款	-42,077.38	-975,591.02	-1,017,668.40
基金赎回款	43,066.54	23,138.93	66,205.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	258,617.28	598,969.44	857,586.72

#### 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	31,820.09
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	350.98
其他	609.99
合计	32,781.06

#### 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	86,966,005.30
减：卖出股票成本总额	86,601,846.58
买卖股票差价收入	364,158.72

#### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期未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	584,589.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	584,589.94

**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	1,671,237.69
——股票投资	1,671,237.69
——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	1,671,237.69

**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	665.22

转换费收入	-
合计	665.22

#### 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	165,993.95
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	165,993.95

#### 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	24,795.19
信息披露费	-
其他费用	600.00
账户维护费	18,000.00
数字证书服务费	-
律师费	-
合计	43,395.19

#### 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
江苏银行股份有限公司	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	249,120,240.38	100.00%	361,525,606.88	100.00%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	42,627,013.72	100.00%

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	3,218,500,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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	56,916.19	100.00%	49,432.47	100.00%
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	80,014.63	100.00%	33,876.72	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方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	63,999.30	676,952.79
其中：支付销售机构的客户维护费	5,943.07	4,830.50

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 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	19,999.72	211,547.73
----------------	-----------	------------

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资本基金。

##### 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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
江苏银行股份有限公司	52,058,092.48	31,820.09	25,193,881.32	66,429.83

#### 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（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

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 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国内依法发行上市的股票、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金采用量化策略进行选股和择时，控制风险，追求持续的资产增值。以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略，进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损，另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合，以期为投资者带来稳定收益。

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**

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债券投资。

##### **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**

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债券投资。

##### **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，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	52,058,092.48	-	-	-	-	-	52,058,092.48
存出保证金	47,592.48	-	-	-	-	-	47,592.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	78,299,255.19	78,299,255.19
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,370,856.34	5,370,856.34
应收利息	-	-	-	-	-	4,614.75	4,614.75
应收申购款	-	-	-	-	-	99.85	99.85

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	52,105,684.96	-	-	-	-	-83,674,826.13	135,780,511.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,046.38	2,046.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,829.12	40,829.12
应付托管费	-	-	-	-	-	12,759.08	12,759.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,432.47	49,432.47
其他负债	-	-	-	-	-	24,796.49	24,796.49
负债总计	-	-	-	-	-	129,863.54	129,863.54
利率敏感度缺口	52,105,684.96	-	-	-	-	-83,544,962.59	135,650,647.55
上年度末 2018 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	3,224,361.93	-	-	-	-	-	3,224,361.93
结算备付金	29,550.36	-	-	-	-	-	29,550.36
存出保证金	96,875.99	-	-	-	-	-	96,875.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,075,629.00	1,075,629.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	18,375.96	18,375.96
应收利息	-	-	-	-	-	838.19	838.19
应收申购款	-	-	-	-	-	99.85	99.85
资产总计	3,350,788.28	-	-	-	-	1,094,943.00	4,445,731.28
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,979.60	2,979.60
应付托管费	-	-	-	-	-	931.10	931.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	223.17	223.17
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	154,133.87	154,133.87
利率敏感度缺口	3,350,788.28	-	-	-	-	940,809.13	4,291,597.41

注：上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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 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(2018 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 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	78,299,255.19	57.72	1,075,629.00	25.06
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	78,299,255.19	57.72	1,075,629.00	25.06

注：本基金股票投资占基金资产的 0%-95%；投资于债券等固定收益类资产比例不低于基金资产的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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%	-352,691.68	-16,308.07
	2. 业绩基准下跌 5%	-1,763,458.42	-81,540.35
	3. 业绩基准下跌 10%	-3,526,916.84	-163,080.70

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	78,299,255.19	57.67
	其中：股票	78,299,255.19	57.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	52,058,092.48	38.34
8	其他各项资产	5,423,163.42	3.99
9	合计	135,780,511.09	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	6,843,760.00	5.05
C	制造业	35,588,955.04	26.24
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	11,127,498.88	8.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,777,153.92	3.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	268,800.00	0.20
J	金融业	5,942,759.00	4.38

K	房地产业	3,656,406.35	2.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,115,548.00	5.25
N	水利、环境和公共设施管理业	2,978,374.00	2.20
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,299,255.19	57.72

### 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	603936	博敏电子	394,020	5,350,791.60	3.94
2	603259	药明康德	58,300	5,053,444.00	3.73
3	603520	司太立	212,900	4,917,990.00	3.63
4	600754	锦江股份	193,878	4,777,153.92	3.52
5	601857	中国石油	613,200	4,218,816.00	3.11
6	603883	老百姓	65,600	3,836,288.00	2.83
7	603579	荣泰健康	125,022	3,663,144.60	2.70
8	600606	绿地控股	535,345	3,656,406.35	2.70
9	600993	马应龙	200,000	3,530,000.00	2.60
10	600351	亚宝药业	568,100	3,493,815.00	2.58
11	601398	工商银行	565,100	3,328,439.00	2.45
12	601566	九牧王	262,400	3,232,768.00	2.38
13	600305	恒顺醋业	173,800	3,201,396.00	2.36
14	603233	大参林	67,900	3,055,500.00	2.25
15	600436	片仔癀	26,000	2,995,200.00	2.21
16	600054	黄山旅游	320,600	2,978,374.00	2.20
17	601088	中国神华	128,800	2,624,944.00	1.94
18	601288	农业银行	726,200	2,614,320.00	1.93
19	603660	苏州科达	145,440	2,267,409.60	1.67
20	603139	康惠制药	125,700	2,222,376.00	1.64
21	603127	昭衍新药	42,800	2,062,104.00	1.52
22	603208	江山欧派	57,768	1,988,952.24	1.47

23	600519	贵州茅台	2,000	1,968,000.00	1.45
24	600729	重庆百货	23,337	705,710.88	0.52
25	603658	安图生物	4,200	287,112.00	0.21
26	600588	用友网络	10,000	268,800.00	0.20

#### 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	600754	锦江股份	7,553,695.22	176.01
2	600028	中国石化	7,015,460.00	163.47
3	603986	兆易创新	6,437,922.00	150.01
4	603936	博敏电子	5,137,984.80	119.72
5	603259	药明康德	4,816,534.00	112.23
6	603520	司太立	4,665,302.20	108.71
7	601857	中国石油	4,306,450.00	100.35
8	603883	老百姓	3,808,013.00	88.73
9	600048	保利地产	3,758,125.00	87.57
10	603208	江山欧派	3,699,664.00	86.21
11	601333	广深铁路	3,654,449.00	85.15
12	600606	绿地控股	3,586,106.15	83.56
13	600351	亚宝药业	3,500,297.00	81.56
14	603579	荣泰健康	3,499,198.34	81.54
15	600703	三安光电	3,473,349.00	80.93
16	601006	大秦铁路	3,356,768.00	78.22
17	603228	景旺电子	3,335,594.26	77.72
18	600993	马应龙	3,328,554.00	77.56
19	601398	工商银行	3,286,023.00	76.57
20	601566	九牧王	3,244,041.00	75.59
21	601998	中信银行	3,241,148.60	75.52
22	601318	中国平安	3,106,450.00	72.38
23	600837	海通证券	3,097,366.58	72.17
24	600436	片仔癀	3,061,412.00	71.34
25	603233	大参林	3,001,269.00	69.93
26	600305	恒顺醋业	3,000,167.78	69.91
27	600054	黄山旅游	2,944,130.00	68.60

28	601939	建设银行	2,802,787.00	65.31
29	601988	中国银行	2,788,535.00	64.98
30	601288	农业银行	2,760,677.00	64.33
31	603288	海天味业	2,620,789.00	61.07
32	601186	中国铁建	2,577,536.00	60.06
33	601088	中国神华	2,522,357.95	58.77
34	601166	兴业银行	2,495,031.00	58.14
35	603517	绝味食品	2,285,196.60	53.25
36	601390	中国中铁	2,284,563.00	53.23
37	603660	苏州科达	2,263,007.60	52.73
38	603139	康惠制药	2,239,904.00	52.19
39	603127	昭衍新药	2,035,530.00	47.43
40	600519	贵州茅台	2,021,758.00	47.11
41	601117	中国化学	2,005,997.00	46.74
42	600729	重庆百货	683,520.34	15.93
43	603658	安图生物	380,173.00	8.86
44	300347	泰格医药	323,546.00	7.54
45	600588	用友网络	317,357.00	7.39
46	300073	当升科技	299,880.00	6.99
47	300014	亿纬锂能	292,094.00	6.81
48	300033	同花顺	290,160.00	6.76
49	300015	爱尔眼科	287,933.00	6.71
50	300059	东方财富	275,300.00	6.41
51	300122	智飞生物	273,840.00	6.38
52	300017	网宿科技	272,792.00	6.36
53	300253	卫宁健康	269,325.00	6.28
54	300760	迈瑞医疗	267,368.00	6.23
55	300450	先导智能	266,643.00	6.21
56	300009	安科生物	265,092.00	6.18
57	300274	阳光电源	263,574.00	6.14
58	300316	晶盛机电	258,860.00	6.03
59	300098	高新兴	254,523.03	5.93
60	300383	光环新网	241,587.00	5.63
61	300115	长盈精密	240,872.00	5.61
62	300408	三环集团	238,627.00	5.56
63	300024	机器人	236,476.00	5.51

64	300088	长信科技	235,043.00	5.48
65	300676	华大基因	233,638.00	5.44
66	300146	汤臣倍健	233,422.00	5.44
67	300168	万达信息	230,892.00	5.38
68	300003	乐普医疗	230,471.00	5.37
69	300170	汉得信息	229,420.00	5.35
70	300699	光威复材	225,732.00	5.26
71	300072	三聚环保	222,127.00	5.18
72	300251	光线传媒	221,740.00	5.17
73	300070	碧水源	219,504.00	5.11
74	300136	信维通信	218,507.00	5.09
75	300038	数知科技	209,857.00	4.89
76	300601	康泰生物	207,996.00	4.85
77	300027	华谊兄弟	206,739.00	4.82
78	300496	中科创达	206,440.00	4.81
79	300618	寒锐钴业	205,860.00	4.80
80	300413	芒果超媒	204,977.00	4.78
81	300433	蓝思科技	204,201.00	4.76
82	300078	思创医惠	194,453.00	4.53
83	300113	顺网科技	193,513.00	4.51
84	300287	飞利信	186,951.00	4.36
85	300634	彩讯股份	186,475.00	4.35
86	300355	蒙草生态	185,342.00	4.32
87	300666	江丰电子	181,916.00	4.24
88	300315	掌趣科技	181,451.00	4.23
89	300124	汇川技术	177,670.00	4.14
90	002146	荣盛发展	162,138.00	3.78
91	000063	中兴通讯	161,599.00	3.77
92	300377	赢时胜	159,029.00	3.71
93	300418	昆仑万维	158,250.00	3.69
94	000858	五粮液	154,748.00	3.61
95	002415	海康威视	147,897.00	3.45
96	000876	新希望	145,926.00	3.40
97	000581	威孚高科	141,706.00	3.30
98	000157	中联重科	136,720.00	3.19
99	002563	森马服饰	135,887.00	3.17

100	000069	华侨城 A	135,331.00	3.15
101	000046	泛海控股	134,883.00	3.14
102	000839	中信国安	133,540.00	3.11
103	000012	南玻 A	132,766.00	3.09
104	000039	中集集团	131,446.00	3.06
105	000539	粤电力 A	129,894.00	3.03
106	000402	金融街	128,678.00	3.00
107	002001	新和成	127,187.00	2.96
108	000559	万向钱潮	125,349.00	2.92
109	000002	万科 A	125,046.00	2.91
110	000550	江铃汽车	124,377.00	2.90
111	000001	平安银行	124,191.00	2.89
112	000895	双汇发展	123,623.00	2.88
113	000338	潍柴动力	122,530.00	2.86
114	000625	长安汽车	118,864.00	2.77
115	000333	美的集团	118,846.00	2.77
116	000776	广发证券	118,502.00	2.76
117	000423	东阿阿胶	116,037.00	2.70
118	000568	泸州老窖	111,349.00	2.59
119	002736	国信证券	110,625.00	2.58
120	002498	汉缆股份	109,135.00	2.54
121	000783	长江证券	106,476.00	2.48
122	002142	宁波银行	104,031.00	2.42
123	000027	深圳能源	103,198.00	2.40
124	000540	中天金融	102,116.00	2.38
125	000166	申万宏源	101,028.00	2.35
126	001979	招商蛇口	100,971.00	2.35
127	000651	格力电器	97,656.00	2.28
128	600999	招商证券	97,577.00	2.27
129	000100	TCL 集团	97,206.00	2.27
130	002304	洋河股份	95,073.00	2.22

#### 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	600028	中国石化	7,076,439.00	164.89

2	603986	兆易创新	6,474,413.00	150.86
3	600048	保利地产	3,800,926.00	88.57
4	601333	广深铁路	3,661,248.00	85.31
5	600703	三安光电	3,413,610.24	79.54
6	601998	中信银行	3,277,981.99	76.38
7	601006	大秦铁路	3,258,661.00	75.93
8	603228	景旺电子	3,229,698.00	75.26
9	601318	中国平安	3,080,281.00	71.77
10	600837	海通证券	3,040,618.00	70.85
11	600754	锦江股份	2,868,109.64	66.83
12	601939	建设银行	2,863,311.00	66.72
13	601988	中国银行	2,815,040.00	65.59
14	601186	中国铁建	2,618,171.00	61.01
15	603288	海天味业	2,591,542.00	60.39
16	601166	兴业银行	2,497,940.00	58.21
17	601390	中国中铁	2,263,452.00	52.74
18	603517	绝味食品	2,222,487.20	51.79
19	603208	江山欧派	2,000,792.64	46.62
20	601117	中国化学	1,966,932.00	45.83
21	300347	泰格医药	333,887.36	7.78
22	300059	东方财富	318,721.80	7.43
23	300033	同花顺	318,711.00	7.43
24	300014	亿纬锂能	303,772.00	7.08
25	300015	爱尔眼科	302,466.00	7.05
26	300073	当升科技	299,379.00	6.98
27	300760	迈瑞医疗	292,914.00	6.83
28	300017	网宿科技	290,546.00	6.77
29	300122	智飞生物	287,816.00	6.71
30	300253	卫宁健康	273,438.00	6.37
31	300009	安科生物	272,919.00	6.36
32	300450	先导智能	271,333.00	6.32
33	300316	晶盛机电	270,567.00	6.30
34	300274	阳光电源	270,364.00	6.30
35	300098	高新兴	262,051.00	6.11
36	300146	汤臣倍健	260,366.00	6.07
37	300115	长盈精密	248,851.00	5.80
38	300383	光环新网	247,216.00	5.76
39	300168	万达信息	245,779.00	5.73

40	300024	机器人	244,842.00	5.71
41	300408	三环集团	243,867.00	5.68
42	300088	长信科技	243,027.00	5.66
43	300170	汉得信息	239,373.00	5.58
44	300676	华大基因	237,988.00	5.55
45	300070	碧水源	237,967.00	5.54
46	300136	信维通信	237,358.00	5.53
47	300072	三聚环保	236,453.00	5.51
48	300003	乐普医疗	234,511.00	5.46
49	300699	光威复材	233,722.00	5.45
50	300251	光线传媒	223,194.00	5.20
51	300601	康泰生物	215,907.00	5.03
52	300038	数知科技	215,657.00	5.03
53	300618	寒锐钴业	214,893.00	5.01
54	300433	蓝思科技	214,799.00	5.01
55	300027	华谊兄弟	212,532.00	4.95
56	300496	中科创达	212,291.00	4.95
57	300413	芒果超媒	205,751.00	4.79
58	300113	顺网科技	198,083.00	4.62
59	300078	思创医惠	196,695.00	4.58
60	300287	飞利信	191,805.00	4.47
61	300355	蒙草生态	191,239.00	4.46
62	300634	彩讯股份	186,933.00	4.36
63	300315	掌趣科技	185,711.00	4.33
64	300666	江丰电子	183,527.00	4.28
65	300124	汇川技术	182,467.00	4.25
66	000063	中兴通讯	168,796.89	3.93
67	002146	荣盛发展	162,858.00	3.79
68	300377	赢时胜	160,803.77	3.75
69	000858	五粮液	160,682.32	3.74
70	300418	昆仑万维	159,996.00	3.73
71	002415	海康威视	146,503.00	3.41
72	000876	新希望	145,975.00	3.40
73	000581	威孚高科	143,190.00	3.34
74	000157	中联重科	141,113.00	3.29
75	000550	江铃汽车	139,349.00	3.25
76	000069	华侨城 A	137,556.00	3.21
77	000046	泛海控股	136,376.00	3.18

78	000839	中信国安	134,314.00	3.13
79	002563	森马服饰	133,869.00	3.12
80	000012	南玻 A	131,254.00	3.06
81	000039	中集集团	130,187.00	3.03
82	002001	新和成	128,827.00	3.00
83	000402	金融街	128,460.00	2.99
84	000338	潍柴动力	127,984.00	2.98
85	000539	粤电力 A	127,640.00	2.97
86	000001	平安银行	126,199.00	2.94
87	000895	双汇发展	125,207.00	2.92
88	000559	万向钱潮	125,049.00	2.91
89	000002	万科 A	124,919.00	2.91
90	000333	美的集团	120,244.00	2.80
91	000625	长安汽车	119,824.00	2.79
92	000776	广发证券	116,888.00	2.72
93	000423	东阿阿胶	116,824.00	2.72
94	000568	泸州老窖	116,776.00	2.72
95	002736	国信证券	110,380.00	2.57
96	002498	汉缆股份	109,321.00	2.55
97	002142	宁波银行	107,097.00	2.50
98	000783	长江证券	107,056.00	2.49
99	603658	安图生物	103,954.00	2.42
100	000540	中天金融	102,985.00	2.40
101	000027	深圳能源	102,628.00	2.39
102	001979	招商蛇口	102,207.00	2.38
103	000166	申万宏源	100,963.00	2.35
104	000651	格力电器	100,917.00	2.35
105	600999	招商证券	98,145.00	2.29
106	000100	TCL 集团	96,520.00	2.25
107	002304	洋河股份	95,090.00	2.22

#### 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	162,154,235.08
卖出股票收入（成交）总额	86,966,005.30

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券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	47,592.48
2	应收证券清算款	5,370,856.34
3	应收股利	-
4	应收利息	4,614.75
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,423,163.42

**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
198	680,773.03	24,831,330.78	18.42%	109,961,730.05	81.58%

### 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	17,616.67	0.0131%

### 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（2016年6月3日）基金份额总额	254,749,688.49
本报告期期初基金份额总额	4,842,592.23
本报告期期间基金总申购份额	131,196,599.89
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,246,131.29
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	134,793,060.83

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	249,120,240.38	100.00%	56,916.19	100.00%	-

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

本报告期本基金交易单元无变更。

## 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

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 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	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	中国证券报、上海证券报、公司网站	2019 年 1 月 16 日
3	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
4	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
5	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
6	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国中投证券有限责任公司申购及定期定额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	2019 年 3 月 28 日
7	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	中国证券报、公司网站	2019 年 3 月 29 日
8	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
9	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

10	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
11	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2019 年 4 月 20 日
12	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
13	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
14	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
15	东吴基金管理有限公司关于在公司直销中心柜台开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2019 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20190101 - 20190416	988,111.57	-	-	988,111.57	0.73%
	2	20190417 - 20190630	-	39,490,609.02	-	39,490,609.02	29.30%
	3	20190417 - 20190630	-	35,613,114.01	-	35,613,114.01	26.42%
	4	20190626 - 20190630	-	29,969,030.97	-	29,969,030.97	22.23%
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2019年8月27日