

东吴移动互联网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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

§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.....	6
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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
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	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东吴移动互联	
基金主代码	001323	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,799,795.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C
下属分级基金的交易代码:	001323	002170
报告期末下属分级基金的份额总额	110,798,796.50 份	999.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于移动互联主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	中证移动互联网指数×50% + 中债综合指数×50%
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	李帅帅
	联系电话	021-50509888-8206	0755-22168168
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95511 转 3
传真		021-50509888-8211	0755-25878287
注册地址		上海浦东源深路 279 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		200135	518001
法定代表人		王炯	谢永林

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

基金级别	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	3,144,105.42	24.25
本期利润	14,921,006.73	115.46
加权平均基金份额本期利润	0.1239	0.1156
本期加权平均净值利润率	14.61%	13.73%
本期基金份额净值增长率	15.16%	15.18%
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	-17,386,769.38	-142.07
期末可供分配基金份额利润	-0.1569	-0.1422
期末基金资产净值	98,475,523.90	878.88
期末基金份额净值	0.889	0.880
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	-11.10%	-12.26%

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

东吴移动互联混合 A

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	4.47%	0.76%	3.23%	0.74%	1.24%	0.02%
过去三个月	0.45%	0.65%	-2.89%	0.98%	3.34%	-0.33%
过去六个月	15.16%	0.80%	13.87%	0.99%	1.29%	-0.19%
过去一年	-17.84%	1.53%	-0.03%	0.98%	-17.81%	0.55%
过去三年	-11.98%	1.15%	-9.99%	0.76%	-1.99%	0.39%
自基金合同生效起至今	-11.10%	0.99%	-27.84%	1.08%	16.74%	-0.09%

东吴移动互联混合 C

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	4.39%	0.75%	3.23%	0.74%	1.16%	0.01%
过去三个月	0.46%	0.66%	-2.89%	0.98%	3.35%	-0.32%
过去六个月	15.18%	0.81%	13.87%	0.99%	1.31%	-0.18%
过去一年	-17.91%	1.54%	-0.03%	0.98%	-17.88%	0.56%
过去三年	-12.78%	1.16%	-9.99%	0.76%	-2.79%	0.40%
自基金合同生效起至今	-12.26%	1.11%	-7.70%	0.78%	-4.56%	0.33%

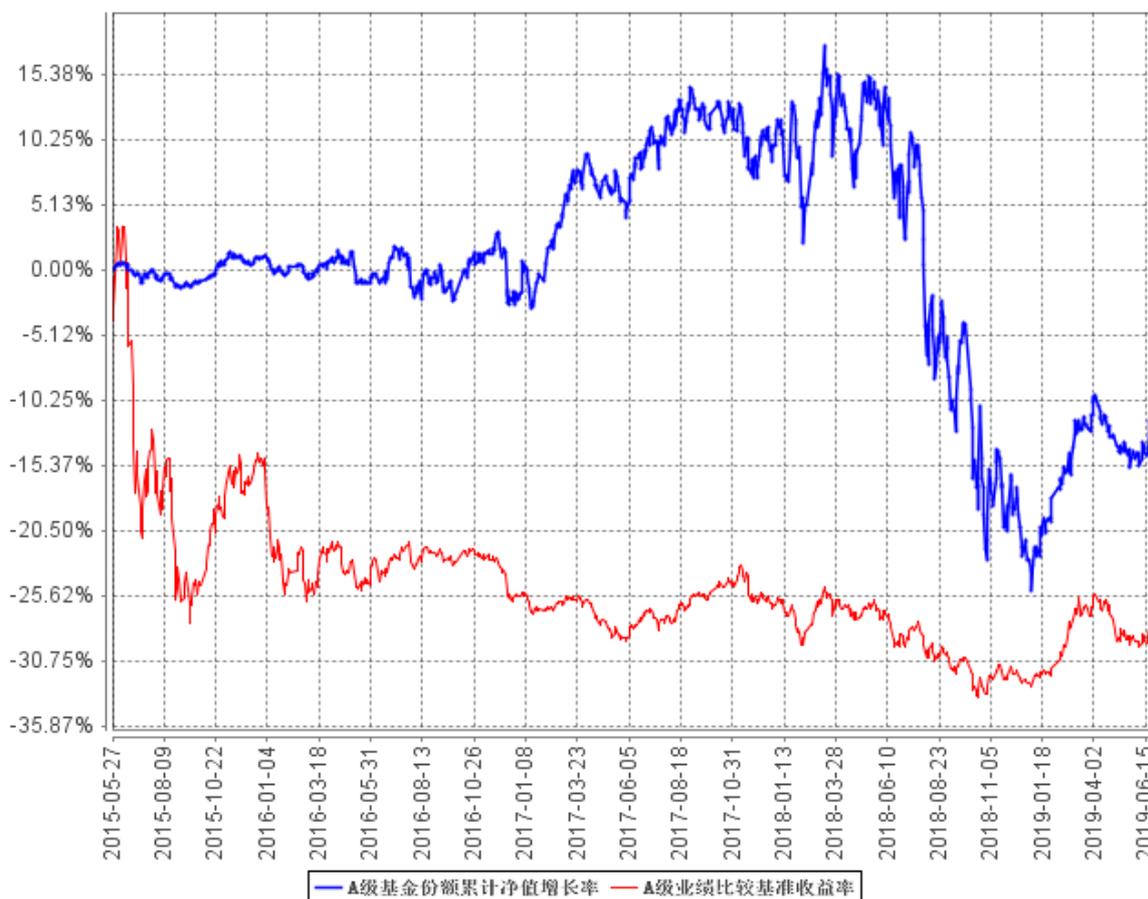
注：1、比较基准=中证移动互联网指数×50% +中债综合指数×50%

2、本基金于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

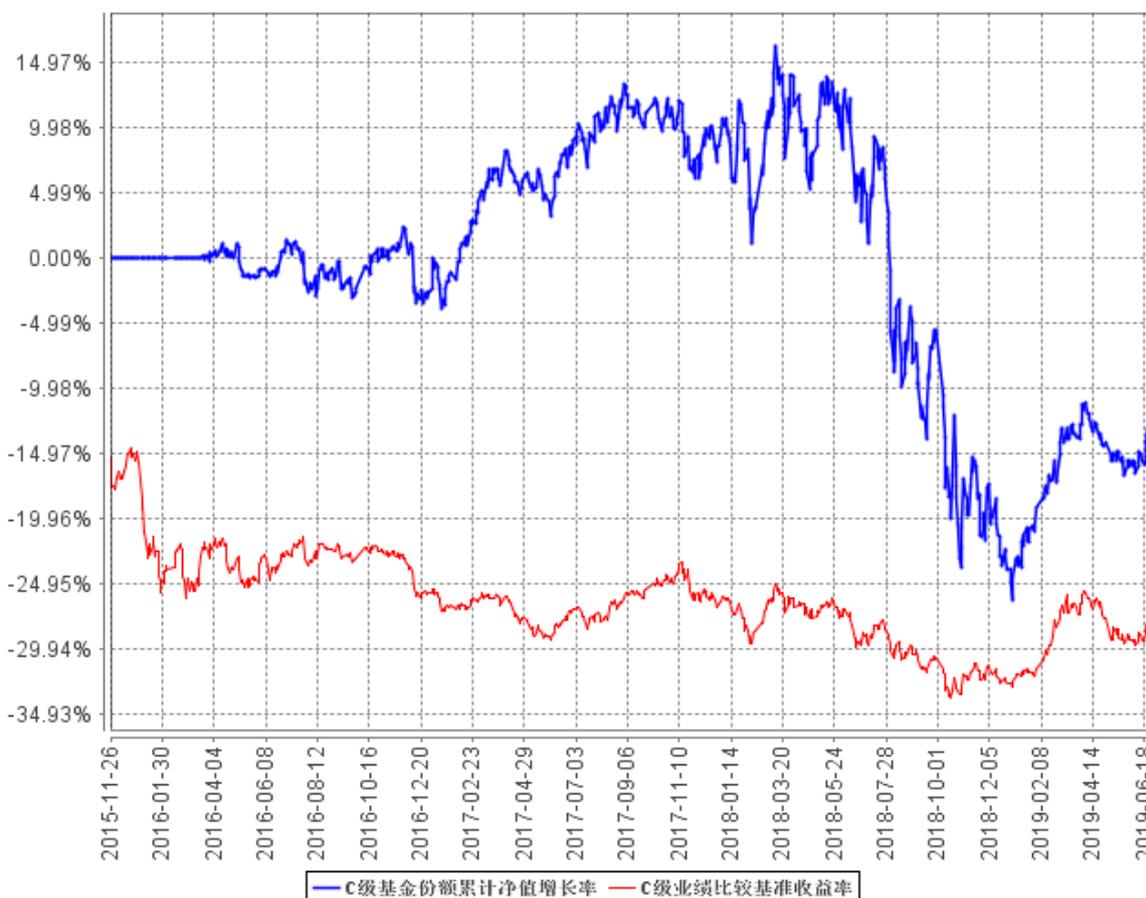
3、本基金 C 类份额在 2016 年 3 月 18 日前无申购，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于 2016 年 3 月 18 日起计算。

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

A级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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、比较基准=中证移动互联网指数×50% +中债综合指数×50%

2、本基金于 2015 年 11 月 26 日分为 A、C 两类，具体内容详见本基金管理人于 2015 年 11 月 24 日刊登的《关于东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类收费模式并修改基金合同的公告》。

3、本基金 C 类份额在 2016 年 3 月 18 日前无申购，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于 2016 年 3 月 18 日起计算。

§ 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		
刘元海	权益投资总部副总经理、基金经理	2016 年 4 月 27 日	-	14 年	刘元海,博士,同济大学毕业。2004 年 2 月至 2015 年 6 月就职于东吴基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理等职务,2016 年 2 月再次加入我司,现任权益投资总部副总经理、基金经理,自 2016 年 4 月 27 日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2017 年 2 月 9 日起

					担任东吴优信稳健债券投资基金基金经理，自 2019 年 4 月 29 日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理。其中，2011 年 10 月 26 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新产业精选混合型证券投资基金基金经理，2013 年 01 月 30 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理，2014 年 1 月 13 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理，2012 年 03 月 13 日至 2013 年 06 月 05 日担任东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2019 年上半年，A 股市场走出先扬后抑走势。1 季度，A 股市场出现较大幅度反弹，反弹主要原因是：第一，2018 年 A 股市场持续下跌至年底，当时市场股权风险溢价回到历史高位，市场风险偏好降到历史低点，市场存在反弹需要；第二，在经济下行背景下，国内货币政策和财政政策放松迹象明显；第三，中美贸易战达成一定共识可能性较大；第四、年初以来，北上资金大规模流入 A 股市场，对 A 股市场稳定和上涨起到中流砥柱作用。

2 季度，从 4 月中下旬开始，A 股市场出现短期快速下跌，主要原因是：第一，市场风险溢价降到较低历史位置，估值水平处于历史相对高位；第二，4 月中旬央行货币政策委员会重提把好货币供给总闸门，强调不搞大水漫灌，货币政策较年初出现微调迹象；第三，5 月初中美贸易谈判冲突突然升级，美国对中国 2000 亿商品关税从 10%提高到 25%，超出市场预期；第四，4、5 月份，北上资金大规模流出 A 股市场。

年初本基金保持较高仓位，配置方向主要在消费、科技和非银金融。在经过 1 季度上涨之后，考虑估值水平提升和对宏观经济基本面担心，本基金从 4 月中下旬开始将仓位降低到相对较低水平，以保证年初收益落袋为安。从 6 月中下旬开始，考虑到以上四个因素逐步朝着积极方向变化，因此适当提高了基金仓位。整体来看，上半年本基金通过仓位控制和行业、个股选取降低基金净值波动性，取得较好绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴移动互联混合 A 基金份额净值为 0.889 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.16%；截至本报告期末东吴移动互联混合 C 基金份额净值为 0.880 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.18%；同期业绩比较基准收益率为 13.87%。

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 2019 年下半年，我们判断，对于核心资产白马股，要评估好估值和业绩的匹配；对于新兴产业中成长股，存在黑马潜质。

在中美贸易摩擦不断背景下，全球经济存在下行压力，同时国内新的增长动力尚未看到，国内货币政策和财政政策放松更多是为了经济托底，经济弹性弱化。在当前存量经济环境下，大部分行业中公司增长是通过侵占其它公司份额来实现，因此市场给予行业龙头核心资产白马股估值溢价，而中小公司股票慢慢被边缘化。当然长期来看，中国核心资产跟海外股市一样会享受估值

溢价，但是中短期看，在经济下行背景下部分核心资产估值和业绩存在不匹配可能，短期股价存在调整压力。不过经过适当调整之后，一些不改行业向好趋势的核心资产可以继续持有或配置。

反观一些新兴产业，我们发现投资机会正逐步显现。比如，5G 产业链。从中报业绩快报看，我们发现 5G 产业链上的一些公司 2 季度业绩显著受益于国内 5G 的建设，预计 3 季报会进一步强化这一趋势。展望 2020 年，5G 产业链上大部分公司业绩弹性会更大。随着 5G 网络建设，5G 手机产业链景气也会复苏。其它新兴产业如新能源汽车、军工等等，投资机会正逐步显现。

2019 年下半年本基金在坚守风险控制前提下，把握市场节奏合理布局以获取绝对收益。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由东吴基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：东吴移动互联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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	36,577,943.29	9,545,058.96
结算备付金		1,092,847.20	1,058,162.40
存出保证金		527,733.78	324,455.81
交易性金融资产	6.4.7.2	50,523,028.50	93,139,482.00
其中：股票投资		50,523,028.50	88,139,482.00
基金投资		-	-
债券投资		-	5,000,000.00
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		10,658,969.68	1,651,691.36
应收利息	6.4.7.5	7,778.31	6,554.63
应收股利		-	-
应收申购款		3,388.94	1,487.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		99,391,689.70	105,726,892.56
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		-	945,865.88
应付赎回款		10,019.29	-
应付管理人报酬		118,471.76	136,831.40
应付托管费		19,745.29	22,805.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	681,546.82	851,339.00
应交税费		-	106.28

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,503.76	55,000.00
负债合计		915,286.92	2,011,947.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	110,799,795.50	134,347,616.55
未分配利润	6.4.7.10	-12,323,392.72	-30,632,671.79
所有者权益合计		98,476,402.78	103,714,944.76
负债和所有者权益总计		99,391,689.70	105,726,892.56

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，东吴移动互联混合 A 基金份额净值 0.889 元，基金份额总额 110,798,796.50 份；东吴移动互联混合 C 基金份额净值 0.880 元，基金份额总额 999.00 份。东吴移动互联份额总额合计为 110,799,795.50 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴移动互联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
一、收入		18,711,696.11	2,264,928.21
1.利息收入		245,558.30	110,841.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	234,705.77	110,545.56
债券利息收入		10,852.53	2.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	293.44
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,677,196.51	2,836,358.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,227,113.47	2,114,819.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,616.44	11,974.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	446,466.60	709,564.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	11,776,992.52	-755,540.63
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	11,948.78	73,268.98

列)			
减：二、费用		3,790,573.92	4,857,374.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	760,938.97	1,357,737.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	126,823.20	226,289.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	1.81
4. 交易费用	6.4.7.18	2,798,688.69	3,175,404.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		35.82	-
7. 其他费用	6.4.7.19	104,087.24	97,941.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,921,122.19	-2,592,446.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,921,122.19	-2,592,446.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴移动互联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）	134,347,616.55	-30,632,671.79	103,714,944.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,921,122.19	14,921,122.19
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）	-23,547,821.05	3,388,156.88	-20,159,664.17
其中：1.基金申购款	1,101,327.81	-156,061.21	945,266.60
2.基金赎回款	-24,649,148.86	3,544,218.09	-21,104,930.77
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	110,799,795.50	-12,323,392.72	98,476,402.78

创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券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的相关规定)。

本基金业绩比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%。

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>》、其他中国证监会及中国证券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	36,577,943.29
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：	36,577,943.29

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	46,598,032.37	50,523,028.50	3,924,996.13
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	46,598,032.37	50,523,028.50	3,924,996.13

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	7,121.94
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	442.62
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	213.75
合计	7,778.31

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	681,546.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	681,546.82

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	16.52
预提信息披露费	58,214.16
应付审计费	27,273.08
合计	85,503.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴移动互联混合 A	
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	134,346,617.55	134,346,617.55
本期申购	1,101,327.81	1,101,327.81
本期赎回(以“-”号填列)	-24,649,148.86	-24,649,148.86
- 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	110,798,796.50	110,798,796.50

金额单位：人民币元

东吴移动互联混合 C		
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	999.00	999.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	999.00	999.00

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

东吴移动互联混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,383,387.34	-6,249,048.87	-30,632,436.21
本期利润	3,144,105.42	11,776,901.31	14,921,006.73
本期基金份额交易产生的变动数	3,852,512.54	-464,355.66	3,388,156.88
其中：基金申购款	-175,482.20	19,420.99	-156,061.21
基金赎回款	4,027,994.74	-483,776.65	3,544,218.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,386,769.38	5,063,496.78	-12,323,272.60

单位：人民币元

东吴移动互联混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-166.32	-69.26	-235.58
本期利润	24.25	91.21	115.46
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-142.07	21.95	-120.12

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	219,489.70
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	11,747.60
其他	3,468.47
合计	234,705.77

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	946,317,307.84
减：卖出股票成本总额	940,090,194.37
买卖股票差价收入	6,227,113.47

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,616.44
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,616.44

6.4.7.13.2 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	5,018,082.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,000,000.00
减：应收利息总额	14,465.75
买卖债券差价收入	3,616.44

6.4.7.13.3 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**

本基金本报告期末无权证投资收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

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	446,466.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	446,466.60

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	11,776,992.52
——股票投资	11,776,992.52
——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	11,776,992.52

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	11,658.59
基金转换费收入	290.19
合计	11,948.78

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	2,798,688.69
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,798,688.69

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	27,273.08
信息披露费	58,214.16
其他费用	600.00
帐户维护费	18,000.00
合计	104,087.24

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
中国平安银行股份有限公司	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	192,659,608.57	10.50%	246,632,895.86	11.85%

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	177,833.83	10.53%	-	-
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	226,483.49	11.82%	-	-

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	760,938.97	1,357,737.41
其中：支付销售机构的客户维护费	292,704.24	480,962.53

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

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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	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

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	126,823.20	226,289.48

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

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C	合计
	东吴基金管理有限公司	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C	合计
	东吴基金管理有限公司	-	1.81
合计	-	1.81	1.81

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给

基金管理人，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假期等，支付日期顺延。

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

本基金的基金管理人本报告期末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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国平安银行股份有限公司	36,577,943.29	219,489.70	17,598,547.92	91,172.81

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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	

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、债券、权证、货币市场工具、股指期货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

本基金通过灵活的资产配置，重点投资于移动互联主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。

本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整期货、股票、债券、现金等大类资产的配置。

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

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	-	5,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	5,000,000.00

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、存出保证金及债券投资等。

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	36,577,943.29	-	-	-	-	-	36,577,943.29
清算备付金	1,092,847.20	-	-	-	-	-	1,092,847.20
存出保证金	527,733.78	-	-	-	-	-	527,733.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	50,523,028.50	50,523,028.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,658,969.68	10,658,969.68
应收利息	-	-	-	-	-	7,778.31	7,778.31
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款						3,388.94	3,388.94
其他资产							
资产总计	38,198,524.27					61,193,165.43	99,391,689.70
负债							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款							
应付赎回款						10,019.29	10,019.29
应付管理人报酬						118,471.76	118,471.76
应付托管费						19,745.29	19,745.29
应付销售服务费							
应付交易费用						681,546.82	681,546.82
应交税金							
应付利息							
应付利润							
其他负债						85,503.76	85,503.76
负债总计						915,286.92	915,286.92
利率敏感度缺口	38,198,524.27					60,277,878.51	98,476,402.78
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	9,545,058.96						9,545,058.96
结算备付金	1,058,162.40						1,058,162.40
存出保证金	324,455.81						324,455.81
交易性金融资产				5,000,000.00		88,139,482.00	93,139,482.00
衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收证券清算款						1,651,691.36	1,651,691.36
应收利息						6,554.63	6,554.63
应收股利							
应收申购款						1,487.40	1,487.40
其他资产							
资产总计	10,927,677.17			5,000,000.00		89,799,215.39	105,726,892.56
负债							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款						945,865.88	945,865.88
应付赎回款							
应付管理人报酬						136,831.40	136,831.40
应付托管费						22,805.24	22,805.24
应付销售服务费							
应付交易费用						851,339.00	851,339.00
应交税费						106.28	106.28
应付利息							
应付利润							

其他负债	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	2,011,947.80	2,011,947.80
利率敏感度缺口	10,927,677.17	-	-5,000,000.00	-87,787,267.59	103,714,944.76

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	-	12,147.16
	利率上升 25 个基点	-	-12,088.10

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的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	50,523,028.50	51.30	88,139,482.00	84.98
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	50,523,028.50	51.30	88,139,482.00	84.98

注：本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，投资于移动互联主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-620,401.34	-1,794,268.54
	2. 业绩基准下跌 5%	-3,102,006.69	-8,971,342.72
3. 业绩基准下跌 10%	-6,204,013.38	-17,942,685.44	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无其他需要说明的重要事项。

§ 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	50,523,028.50	50.83
	其中：股票	50,523,028.50	50.83
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	37,670,790.49	37.90
8	其他各项资产	11,197,870.71	11.27
9	合计	99,391,689.70	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	62,898.90	0.06
C	制造业	29,276,709.24	29.73
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	4,409,400.00	4.48
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	5,066,533.76	5.14
J	金融业	9,941,200.00	10.10
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	1,743,180.00	1.77
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

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	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	50,523,028.50	51.30

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	603589	口子窖	80,000	5,153,600.00	5.23
2	000858	五粮液	40,000	4,718,000.00	4.79
3	600570	恒生电子	55,000	3,748,250.00	3.81
4	600519	贵州茅台	3,000	2,952,000.00	3.00
5	000568	泸州老窖	35,000	2,829,050.00	2.87
6	603369	今世缘	100,000	2,789,000.00	2.83
7	603233	大参林	60,000	2,700,000.00	2.74
8	600030	中信证券	100,000	2,381,000.00	2.42
9	601336	新华保险	40,000	2,201,200.00	2.24
10	002371	北方华创	30,000	2,077,500.00	2.11
11	002304	洋河股份	15,000	1,823,400.00	1.85
12	300759	康龙化成	51,000	1,743,180.00	1.77
13	002727	一心堂	60,000	1,709,400.00	1.74
14	002475	立讯精密	60,000	1,487,400.00	1.51
15	601211	国泰君安	80,000	1,468,000.00	1.49
16	000977	浪潮信息	60,000	1,431,600.00	1.45
17	600837	海通证券	100,000	1,419,000.00	1.44
18	002463	沪电股份	100,000	1,362,000.00	1.38
19	601688	华泰证券	60,000	1,339,200.00	1.36
20	000063	中兴通讯	40,000	1,301,200.00	1.32
21	300033	同花顺	13,000	1,278,680.00	1.30
22	002916	深南电路	12,000	1,223,040.00	1.24
23	601628	中国人寿	40,000	1,132,800.00	1.15
24	300782	卓胜微	644	70,144.48	0.07
25	600968	海油发展	17,718	62,898.90	0.06
26	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.04

27	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.03
28	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.03
29	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02

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	000977	浪潮信息	40,638,879.05	39.18
2	600030	中信证券	37,813,123.65	36.46
3	603589	口子窖	35,897,825.20	34.61
4	603019	中科曙光	26,237,539.09	25.30
5	300059	东方财富	25,733,328.94	24.81
6	002304	洋河股份	25,675,297.22	24.76
7	000858	五粮液	25,360,367.01	24.45
8	601628	中国人寿	24,535,235.22	23.66
9	600570	恒生电子	23,787,109.15	22.94
10	600498	烽火通信	23,547,718.61	22.70
11	601336	新华保险	22,314,719.89	21.52
12	002371	北方华创	19,015,421.70	18.33
13	600837	海通证券	18,486,655.28	17.82
14	002281	光迅科技	18,473,395.00	17.81
15	002456	欧菲光	17,586,734.46	16.96
16	600584	长电科技	17,569,612.72	16.94
17	601688	华泰证券	16,222,916.88	15.64
18	600588	用友网络	15,979,998.40	15.41
19	002405	四维图新	14,786,165.00	14.26
20	000725	京东方 A	14,568,596.00	14.05
21	600104	上汽集团	13,633,602.30	13.15
22	002727	一心堂	12,727,369.45	12.27
23	002463	沪电股份	12,515,540.65	12.07
24	601211	国泰君安	11,150,479.00	10.75
25	300759	康龙化成	10,979,320.33	10.59
26	300498	温氏股份	10,742,654.62	10.36
27	300136	信维通信	10,441,148.20	10.07
28	300037	新宙邦	9,499,841.00	9.16

29	000063	中兴通讯	9,028,065.00	8.70
30	300203	聚光科技	8,999,458.61	8.68
31	300073	当升科技	8,971,487.06	8.65
32	300308	中际旭创	8,897,911.33	8.58
33	002531	天顺风能	8,887,099.79	8.57
34	002508	老板电器	8,808,954.63	8.49
35	000333	美的集团	8,441,083.34	8.14
36	300457	赢合科技	7,952,888.25	7.67
37	002475	立讯精密	7,853,290.07	7.57
38	600519	贵州茅台	7,550,580.00	7.28
39	601186	中国铁建	7,446,494.00	7.18
40	603883	老百姓	6,895,310.90	6.65
41	600276	恒瑞医药	6,787,271.27	6.54
42	600703	三安光电	6,719,032.95	6.48
43	002916	深南电路	6,571,855.80	6.34
44	002299	圣农发展	6,364,142.00	6.14
45	300166	东方国信	6,226,927.33	6.00
46	002415	海康威视	6,054,305.00	5.84
47	002202	金风科技	5,922,229.49	5.71
48	601939	建设银行	5,803,000.00	5.60
49	600050	中国联通	5,621,617.00	5.42
50	002624	完美世界	5,007,369.25	4.83
51	002230	科大讯飞	5,007,264.50	4.83
52	002008	大族激光	4,935,849.69	4.76
53	300760	迈瑞医疗	4,726,115.00	4.56
54	601398	工商银行	4,634,000.00	4.47
55	600779	水井坊	4,606,527.52	4.44
56	600760	中航沈飞	4,598,507.60	4.43
57	600958	东方证券	4,472,397.00	4.31
58	600183	生益科技	4,422,299.00	4.26
59	002739	万达电影	4,211,749.04	4.06
60	603369	今世缘	3,845,060.00	3.71
61	601601	中国太保	3,830,037.00	3.69
62	000568	泸州老窖	3,790,810.00	3.66
63	002234	民和股份	3,781,715.00	3.65
64	603259	药明康德	3,727,708.00	3.59

65	002035	华帝股份	3,723,535.14	3.59
66	002458	益生股份	3,719,923.80	3.59
67	300183	东软载波	3,649,494.00	3.52
68	600884	杉杉股份	3,559,354.08	3.43
69	601952	苏垦农发	3,522,550.00	3.40
70	600967	内蒙一机	3,288,784.48	3.17
71	603305	旭升股份	3,268,654.00	3.15
72	002174	游族网络	3,207,428.52	3.09
73	002049	紫光国微	3,120,489.00	3.01
74	002815	崇达技术	3,111,061.00	3.00
75	002466	天齐锂业	2,973,914.00	2.87
76	300750	宁德时代	2,948,683.17	2.84
77	002364	中恒电气	2,925,471.00	2.82
78	300347	泰格医药	2,636,086.69	2.54
79	000681	视觉中国	2,569,135.00	2.48
80	002074	国轩高科	2,543,101.10	2.45
81	600036	招商银行	2,539,000.00	2.45
82	601229	上海银行	2,524,900.60	2.43
83	601328	交通银行	2,521,000.00	2.43
84	300017	网宿科技	2,495,851.17	2.41
85	601288	农业银行	2,493,800.00	2.40
86	603233	大参林	2,457,454.12	2.37
87	603799	华友钴业	2,406,020.20	2.32
88	601166	兴业银行	2,397,500.00	2.31
89	000636	风华高科	2,160,373.00	2.08
90	600406	国电南瑞	2,153,830.00	2.08
91	000661	长春高新	2,125,937.00	2.05

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	000977	浪潮信息	41,267,865.03	39.79
2	603589	口子窖	36,716,698.72	35.40

3	600030	中信证券	36,028,309.00	34.74
4	300059	东方财富	29,106,485.43	28.06
5	600498	烽火通信	26,106,755.90	25.17
6	603019	中科曙光	25,959,032.03	25.03
7	002304	洋河股份	25,514,806.32	24.60
8	000858	五粮液	25,357,790.91	24.45
9	600570	恒生电子	24,667,767.15	23.78
10	601336	新华保险	24,552,484.80	23.67
11	601628	中国人寿	23,376,959.69	22.54
12	002371	北方华创	20,025,511.05	19.31
13	002281	光迅科技	18,303,323.67	17.65
14	600584	长电科技	18,193,477.76	17.54
15	002456	欧菲光	17,999,602.52	17.35
16	600837	海通证券	17,061,569.04	16.45
17	600588	用友网络	16,419,729.60	15.83
18	002405	四维图新	15,290,038.65	14.74
19	601688	华泰证券	14,756,573.16	14.23
20	002463	沪电股份	14,404,336.00	13.89
21	000725	京东方 A	14,286,000.00	13.77
22	300136	信维通信	14,281,894.39	13.77
23	600104	上汽集团	13,308,629.63	12.83
24	300308	中际旭创	13,198,790.62	12.73
25	300203	聚光科技	12,732,413.86	12.28
26	002727	一心堂	11,929,376.86	11.50
27	002531	天顺风能	11,746,534.24	11.33
28	300498	温氏股份	10,804,651.50	10.42
29	601211	国泰君安	9,682,354.99	9.34
30	300166	东方国信	9,631,827.10	9.29
31	300037	新宙邦	9,568,171.00	9.23
32	601186	中国铁建	9,500,897.62	9.16
33	002739	万达电影	9,415,985.37	9.08
34	300759	康龙化成	9,398,035.35	9.06
35	300457	赢合科技	9,323,145.95	8.99
36	300073	当升科技	8,685,266.88	8.37
37	002508	老板电器	8,547,636.58	8.24
38	000333	美的集团	8,529,728.87	8.22
39	002230	科大讯飞	8,146,960.02	7.86
40	000063	中兴通讯	7,915,269.25	7.63

41	300760	迈瑞医疗	7,724,160.00	7.45
42	000568	泸州老窖	7,088,797.25	6.83
43	603883	老百姓	6,871,608.00	6.63
44	600276	恒瑞医药	6,788,303.10	6.55
45	600703	三安光电	6,756,586.40	6.51
46	002475	立讯精密	6,666,864.07	6.43
47	002415	海康威视	6,304,389.00	6.08
48	300347	泰格医药	6,036,352.00	5.82
49	002299	圣农发展	6,016,595.94	5.80
50	002202	金风科技	5,999,979.17	5.79
51	002223	鱼跃医疗	5,908,513.13	5.70
52	601939	建设银行	5,813,000.00	5.60
53	002916	深南电路	5,658,411.40	5.46
54	600050	中国联通	5,630,500.00	5.43
55	600519	贵州茅台	5,372,984.40	5.18
56	600183	生益科技	5,226,857.05	5.04
57	002008	大族激光	5,212,940.18	5.03
58	002624	完美世界	4,857,106.00	4.68
59	601398	工商银行	4,664,000.00	4.50
60	600779	水井坊	4,658,153.00	4.49
61	600760	中航沈飞	4,613,957.74	4.45
62	600958	东方证券	4,527,345.82	4.37
63	002234	民和股份	3,794,254.00	3.66
64	603959	百利科技	3,781,642.47	3.65
65	601601	中国太保	3,762,959.00	3.63
66	603259	药明康德	3,759,782.00	3.63
67	002035	华帝股份	3,657,542.86	3.53
68	300183	东软载波	3,531,905.00	3.41
69	600884	杉杉股份	3,508,878.44	3.38
70	002458	益生股份	3,504,913.50	3.38
71	600967	内蒙一机	3,446,090.00	3.32
72	601952	苏垦农发	3,426,672.68	3.30
73	000681	视觉中国	3,411,267.91	3.29
74	603305	旭升股份	3,361,638.50	3.24
75	002049	紫光国微	3,295,813.00	3.18
76	002174	游族网络	3,204,822.00	3.09
77	002815	崇达技术	3,107,983.00	3.00
78	002466	天齐锂业	2,945,555.60	2.84

79	300251	光线传媒	2,894,807.00	2.79
80	002364	中恒电气	2,822,581.70	2.72
81	300750	宁德时代	2,816,461.00	2.72
82	002343	慈文传媒	2,813,136.32	2.71
83	300377	赢时胜	2,808,455.00	2.71
84	600048	保利地产	2,735,513.00	2.64
85	002074	国轩高科	2,610,388.40	2.52
86	601328	交通银行	2,562,000.00	2.47
87	600036	招商银行	2,551,074.73	2.46
88	601288	农业银行	2,522,800.00	2.43
89	601229	上海银行	2,499,166.00	2.41
90	300017	网宿科技	2,490,101.00	2.40
91	601166	兴业银行	2,424,417.00	2.34
92	603799	华友钴业	2,421,192.00	2.33
93	000636	风华高科	2,265,505.15	2.18
94	603939	益丰药房	2,246,024.00	2.17
95	600406	国电南瑞	2,224,848.00	2.15

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	890,696,748.35
卖出股票收入（成交）总额	946,317,307.84

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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	527,733.78
2	应收证券清算款	10,658,969.68
3	应收股利	-
4	应收利息	7,778.31
5	应收申购款	3,388.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,197,870.71

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

份额级别	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
东吴移动互联混合 A	1,878	58,998.29	0.00	0.00%	110,798,796.50	100.00%
东吴移动互联混合 C	1	999.00	0.00	0.00%	999.00	100.00%
合计	1,879	58,967.43	0.00	0.00%	110,799,795.50	100.00%

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	东吴移动互联混合 A	16,163.48	0.0146%
	东吴移动互联混合 C	999.00	100.0000%
	合计	17,162.48	0.0155%

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

项目	东吴移动互联混 合 A	东吴移动互联混 合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 27 日）基金份 额总额	2,403,079,202.08	-
本报告期期初基金份额总额	134,346,617.55	999.00
本报告期期间基金总申购份额	1,101,327.81	-
减：本报告期期间基金总赎回份额	24,649,148.86	-
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	110,798,796.50	999.00

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、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	
方正证券	2	396,788,532.91	21.62%	363,961.60	21.54%	-

华信证券	1	297,201,597.34	16.19%	270,840.48	16.03%	-
天风证券	2	296,293,504.44	16.14%	275,114.42	16.28%	-
东方财富	2	216,882,119.16	11.82%	198,281.00	11.74%	-
东吴证券	2	192,659,608.57	10.50%	177,833.83	10.53%	-
华创证券	1	170,658,163.30	9.30%	158,933.62	9.41%	-
国信证券	1	147,924,557.43	8.06%	137,762.49	8.15%	-
光大证券	1	117,198,627.90	6.38%	106,803.11	6.32%	-
国融证券	2	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期增加 2 个国融证券交易单元。

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

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
方正证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	5,003,616.44	100.00%	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-

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、	2019 年 1 月 2 日

		深交所（巨潮资讯网）	
2	东吴移动互联灵活配置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、公司网站	2019 年 1 月 10 日
3	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
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	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 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
9	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报、公司网站	2019 年 4 月 20 日
10	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
11	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
12	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移动互联灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴移动互联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、报告期内东吴移动互联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

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

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