

# 东吴新经济混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告摘要

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东吴新经济混合
基金主代码	580006
交易代码	580006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,945,456.95 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过投资于引领经济发展未来方向的新兴行业的上市公司，享受新经济发展带来的高成长和高收益。重点投资其中具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，根据自上而下对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，在遵循前述本基金资产配置总体比例限制范围内，确定基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的具体投资比例。根据科学技术和产业的发展趋势对与新经济相关创新技术、典型产业进行识别。随后自下而上地精选代表新经济的典型上市公司和与新经济密切相关的上市公司，针对两类公司的不同特征，充分考虑公司的成长性，运用东吴基金企业竞争优势评价体系进行评价，构建股票池。投资具有成长优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
业绩比较基准	75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	田青

	联系电话	021-50509888-8308	010-67595096
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-10,860,322.48
本期利润	-10,005,535.82
加权平均基金份额本期利润	-0.2886
本期基金份额净值增长率	-16.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4181
期末基金资产净值	48,139,353.05
期末基金份额净值	1.418

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

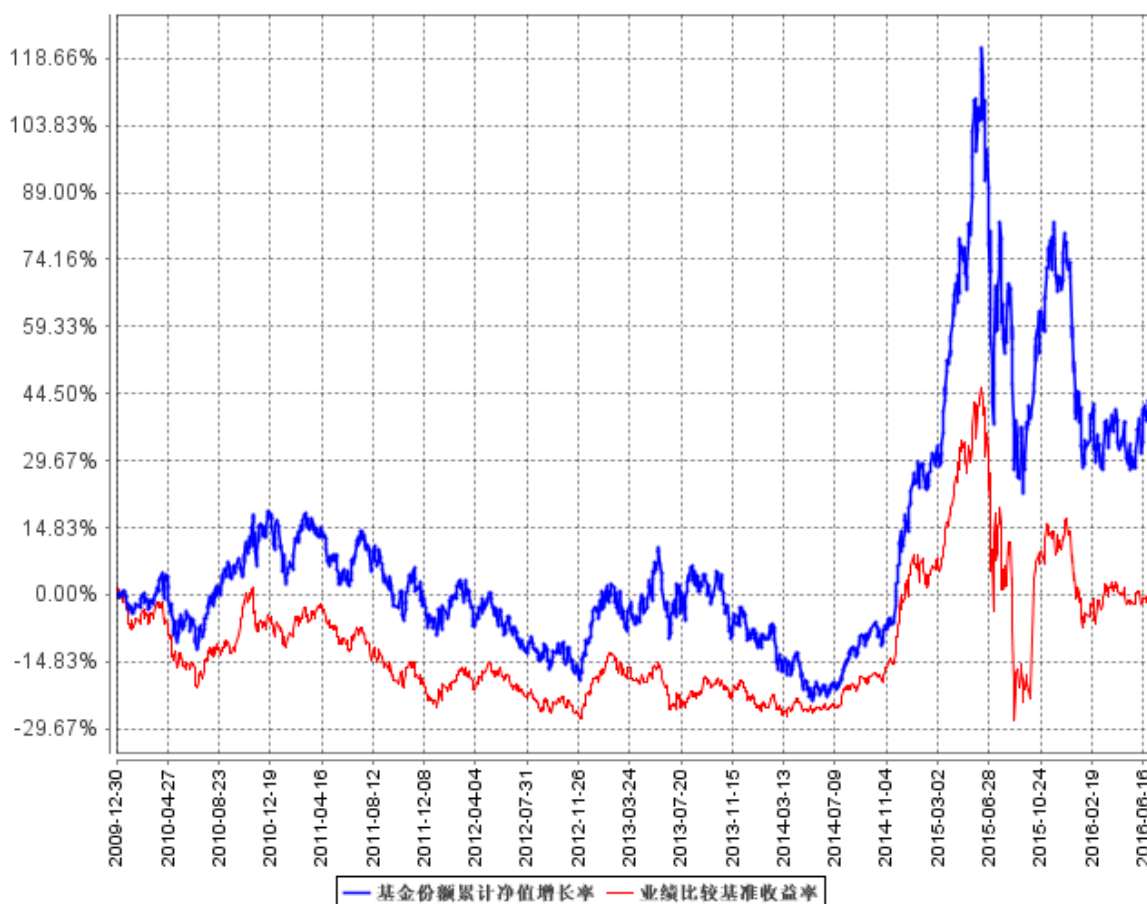
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.51%	1.85%	-0.19%	0.74%	7.70%	1.11%
过去三个月	3.35%	1.62%	-1.40%	0.76%	4.75%	0.86%

过去六个月	-16.78%	2.12%	-11.19%	1.38%	-5.59%	0.74%
过去一年	-21.44%	2.62%	-20.92%	1.73%	-0.52%	0.89%
过去三年	47.71%	1.97%	37.31%	1.38%	10.40%	0.59%
自基金合同生效起至今	41.80%	1.66%	0.32%	1.22%	41.48%	0.44%

注：比较基准=75%\*沪深 300 指数+25%\*中证全债指数。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金自 2009 年 12 月 30 日成立。

2. 比较基准=75%\*沪深 300 指数+25%\*中证全债指数。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[2004]32 号开业批文, 并于 2004 年

9月2日正式成立。注册资本1亿元人民币，公司所在地—上海市浦东新区源深路279号，统一社会信用代码913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生（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、资产管理和经中国证监会批准的其他业务。

公司自成立以来，始终坚守“待人忠、办事诚、以德兴业”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，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2016年6月30日，公司旗下管理着23只公募基金，27只专户资产管理计划，137只存续专项资产管理计划（子公司），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。

2016年，公司在成长股投资的传统优势基础上，引入了量化投资策略，在业内率先成立了绝对收益部，更加强化绝对收益理念。

经过多年积累和布局，公司已形成三大投研“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. 绝对收益首倡“用权益投资做绝对收益”的理念，利用量化模型进行择时和选股操作，严控回撤、优化收益；3. 固定收益回归稳健本源，兼顾流动性管理，为大类资产配置提供基础性产品。

近年来，公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩，斩获了诸多奖项，比如2015年度十大风云基金公司（《大众证券报》）、2014年度最佳投资风格\*金蝉奖（东吴新经济股票型基金，《华夏理财》杂志）、2014年度新财富最智慧投资机构（《新财富》杂志）等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐增	本基金基金经理	2015年5月29日	-	6年	硕士，香港中文大学毕业。2009年7月至2010年12月就职于埃森哲咨询公司上海分公司任行业研究员，自2011年1月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中2015年5月12日起担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理、

					2015 年 5 月 29 日起担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理、 2015 年 5 月 29 日起担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期及离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，因赎回等原因，本基金在 2016 年 1 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日持续出现基金资产净值低于 5000 万元的情况，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在拟定相关应对方案，除此之外，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。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

市场在过去的半年里呈现了大幅下挫的格局。上证综指最终下跌 17.22%，创业板指下跌 17.92%。板块分化严重，以新能源汽车和 OLED 为代表的新兴产业个股在 4 月下旬到 6 月上旬表现优异，而以食品饮料和黄金为主的避险概念股则在上半年整体表现优异。

期间东吴新经济基金根据大盘走势在年初进行了减仓，但没有及时参与 3 月份的创业板反弹导致净值回升力度较弱。5 月开始进行调仓并重点布局了新能源汽车和电子板块。在 5 月中下旬到 6 月中上旬取得不错效果，但对于英国脱欧公投结果预期过于乐观，因此在 6 月下旬并未配置避险品种，所以业绩有所回落。

### 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 1.418 元，累计净值 1.418 元；本报告期份额净值增长率-16.78%，同期业绩比较基准收益率为-11.19%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体看，我们认为下半年的机会与风险并存，市场有望先扬后抑。

从风险角度看，人民币贬值持续，流动性宽松预期边际递减，中小创估值高企，大小非减持压力巨大，增量资金入市迟缓。这些压力都将成为下半年市场重要的上涨阻力。

从机会角度看，秋季行情可能是 2016 年全年最有盼头的一波行情，主力资金一定会想方设法抓住机会做好秋季行情，同时从下半年时点来看，三季度相对利空最少，因此秋季行情仍然存在，但力度/指数高度不能过于乐观。

考虑到东吴新经济基金的规模不大，操作较为灵活，目标仓位计划继续保持灵活。行业配置上，景气度较高的新能源汽车和电子仍将持有，并会逐步配置受益全球放水预期的有色、供给侧改革初现成效的钢铁煤炭和低估值蓝筹股。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司副总经理、运营负责人、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组



成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营负责人、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、合规风控业务相关人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **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，本基金在 2016 年 1 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日持续出现基金资产净值低于 5000 万元的情况，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在拟定相关应对方案。

## **§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**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## §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：东吴新经济混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	5,275,532.50	11,614,393.04
结算备付金	843,606.04	732,868.68
存出保证金	92,472.85	216,983.14
交易性金融资产	41,606,526.79	43,739,052.12
其中：股票投资	41,606,526.79	43,739,052.12
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,132,288.36	4,655,782.38
应收利息	1,866.45	2,387.20
应收股利	-	-
应收申购款	14,985.17	985.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	48,967,278.16	60,962,451.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	222,954.89	1,047,055.94
应付管理人报酬	58,050.98	79,086.08

应付托管费	9,675.15	13,181.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	417,100.90	457,870.98
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	120,143.19	233,913.30
负债合计	827,925.11	1,831,107.31
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	33,945,456.95	34,692,699.98
未分配利润	14,193,896.10	24,438,644.49
所有者权益合计	48,139,353.05	59,131,344.47
负债和所有者权益总计	48,967,278.16	60,962,451.78

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.418 元，基金份额总额 33,945,456.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-8,241,261.99	96,447,174.92
1.利息收入	45,102.17	99,214.87
其中：存款利息收入	45,102.17	91,902.43
债券利息收入	-	7,312.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-9,145,670.12	112,853,632.51
其中：股票投资收益	-9,223,677.08	110,620,097.21
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	1,533,317.08
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	78,006.96	700,218.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	854,786.66	-17,066,794.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,519.30	561,121.99

<b>减：二、费用</b>	1,764,273.83	4,189,850.42
1. 管理人报酬	353,836.22	1,381,755.49
2. 托管费	58,972.67	230,292.61
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,223,503.34	2,395,739.51
5. 利息支出	-	480.00
其中：卖出回购金融资产支出	-	480.00
6. 其他费用	127,961.60	181,582.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-10,005,535.82	92,257,324.50
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-10,005,535.82	92,257,324.50

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	34,692,699.98	24,438,644.49	59,131,344.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,005,535.82	-10,005,535.82
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）	-747,243.03	-239,212.57	-986,455.60
其中：1.基金申购款	2,740,920.78	1,017,956.49	3,758,877.27
2.基金赎回款	-3,488,163.81	-1,257,169.06	-4,745,332.87
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）	33,945,456.95	14,193,896.10	48,139,353.05

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	120,537,623.13	27,890,685.49	148,428,308.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	92,257,324.50	92,257,324.50
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)	-75,621,719.12	-83,989,125.57	-159,610,844.69
其中：1.基金申购款	218,892,311.04	119,735,918.31	338,628,229.35
2.基金赎回款	-294,514,030.16	-203,725,043.88	-498,239,074.04
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)	44,915,904.01	36,158,884.42	81,074,788.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
王炯

\_\_\_\_\_  
吕晖

\_\_\_\_\_  
沈静

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

东吴新经济混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1024号《关于核准东吴新经济股票型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于2009年12月30日正式生效，首次设立募集规模为800,855,129.16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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的60%-95%，其中属于新经济范畴的股票类资产投资比例不低于股票类资产的80%，固定收益类资产投资比例为基金资产

的 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于权证以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

本基金业绩比较基准=75%\*沪深 300 指数+25%\*中证全债指数（该基金原业绩比较基准“75%\*沪深 300 指数+25%\*中信标普全债指数”自 2015 年 9 月 28 日变更为“75%\*沪深 300 指数+25%\*中证全债指数”）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴新经济混合型证券投资基金基金合同》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的

通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起营改增后，基金买卖股票、债券的差价收入免收增值税。

2、对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。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

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

本报告期基金关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	194,096,797.29	23.83%	1,144,021,844.30	74.08%

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	-	34,946,363.60	52.12%

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	-	5,400,000.00	100.00%

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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
东吴股份有限 公司	177,046.33	23.70%	71,662.02	17.18%



关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,028,692.11	74.20%	567,631.22	87.56%

注：1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

2、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）证管费和证券结算风险基金等）；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，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金比率是公允，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。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	353,836.22	1,381,755.49
其中：支付销售机构的客户维护费	111,943.28	321,916.31

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,972.67	230,292.61

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度可比期间基金管理人未持有本基金份额。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国建设银行股份有限公司	5,275,532.50	38,466.15	19,231,384.31	81,374.64

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2015年12月21日	重大资产重组	18.20	2016年7月4日	21.99	88,370	1,470,526.51	1,608,334.00	-

002297	博云新材	2016年6月20日	重大资产重组	13.09	-	-	111,295	1,401,080.51	1,456,851.55	-
002631	德尔未来	2016年6月29日	重大资产重组	26.60	-	-	28,000	690,648.00	744,800.00	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大资产重组	27.47	-	-	25,500	667,207.00	700,485.00	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

## §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	41,606,526.79	84.97
	其中：股票	41,606,526.79	84.97
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,119,138.54	12.50

7	其他各项资产	1,241,612.83	2.54
8	合计	48,967,278.16	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,374,379.37	69.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	990,990.00	2.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,657,569.00	7.60
J	金融业	998,617.68	2.07
K	房地产业	1,608,334.00	3.34
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	976,636.74	2.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,606,526.79	86.43

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600745	中茵股份	168,227	4,515,212.68	9.38
2	300322	硕贝德	138,047	2,968,010.50	6.17
3	600869	智慧能源	221,945	2,286,033.50	4.75
4	600552	凯盛科技	104,006	2,105,081.44	4.37
5	002454	松芝股份	105,500	1,917,990.00	3.98
6	300068	南都电源	78,993	1,726,786.98	3.59
7	000002	万科A	88,370	1,608,334.00	3.34
8	002131	利欧股份	85,600	1,462,904.00	3.04
9	002297	博云新材	111,295	1,456,851.55	3.03
10	300219	鸿利光电	91,900	1,431,802.00	2.97

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

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600666	奥瑞德	15,999,074.44	27.06
2	300322	硕贝德	9,827,924.48	16.62
3	002217	合力泰	9,826,702.15	16.62
4	002488	金固股份	9,670,667.00	16.35
5	600745	中茵股份	8,475,514.44	14.33
6	002655	共达电声	5,878,195.87	9.94
7	002284	亚太股份	4,881,462.30	8.26
8	002502	骅威文化	4,741,430.02	8.02
9	600499	科达洁能	4,661,508.98	7.88
10	601988	中国银行	4,643,705.00	7.85
11	300073	当升科技	4,203,428.21	7.11
12	601028	玉龙股份	4,075,202.87	6.89
13	300031	宝通科技	4,001,666.60	6.77
14	300261	雅本化学	3,898,654.84	6.59
15	600552	凯盛科技	3,801,189.52	6.43

16	002405	四维图新	3,777,472.30	6.39
17	300219	鸿利智汇	3,461,595.63	5.85
18	002378	章源钨业	3,428,798.00	5.80
19	600348	阳泉煤业	3,389,145.00	5.73
20	300168	万达信息	3,370,442.00	5.70
21	300113	顺网科技	3,340,984.94	5.65
22	002590	万安科技	3,312,706.50	5.60
23	000807	云铝股份	3,284,093.00	5.55
24	002458	益生股份	3,275,680.10	5.54
25	300068	南都电源	3,161,059.10	5.35
26	600547	山东黄金	3,148,899.94	5.33
27	600651	飞乐音响	3,131,337.13	5.30
28	600030	中信证券	3,027,427.00	5.12
29	601688	华泰证券	3,027,264.00	5.12
30	002131	利欧股份	2,862,456.88	4.84
31	000911	南宁糖业	2,845,663.58	4.81
32	300027	华谊兄弟	2,840,560.62	4.80
33	300077	国民技术	2,831,840.00	4.79
34	300369	绿盟科技	2,797,148.00	4.73
35	300128	锦富新材	2,738,550.23	4.63
36	601699	潞安环能	2,710,335.00	4.58
37	002464	金利科技	2,689,246.60	4.55
38	300136	信维通信	2,555,322.17	4.32
39	600172	黄河旋风	2,525,545.00	4.27
40	300389	艾比森	2,433,210.82	4.11
41	300084	海默科技	2,335,485.24	3.95
42	300144	宋城演艺	2,323,982.00	3.93
43	300381	溢多利	2,285,417.50	3.86
44	300032	金龙机电	2,279,831.50	3.86
45	600699	均胜电子	2,254,789.00	3.81
46	600869	智慧能源	2,253,589.23	3.81
47	601628	中国人寿	2,202,457.40	3.72
48	000567	海德股份	2,135,825.40	3.61
49	002138	顺络电子	2,133,710.00	3.61
50	002097	山河智能	2,118,843.00	3.58
51	002381	双箭股份	2,117,161.00	3.58

52	300059	东方财富	2,087,471.25	3.53
53	300033	同花顺	2,064,036.00	3.49
54	300347	泰格医药	2,062,782.00	3.49
55	300296	利亚德	2,057,823.05	3.48
56	300011	鼎汉技术	2,014,937.29	3.41
57	002454	松芝股份	1,940,117.00	3.28
58	002311	海大集团	1,919,444.64	3.25
59	002235	安妮股份	1,914,326.00	3.24
60	600777	新潮能源	1,887,834.00	3.19
61	002297	博云新材	1,877,003.50	3.17
62	002583	海能达	1,867,595.20	3.16
63	601398	工商银行	1,847,809.00	3.12
64	002589	瑞康医药	1,835,418.25	3.10
65	600029	南方航空	1,819,270.00	3.08
66	002108	沧州明珠	1,818,519.13	3.08
67	002358	森源电气	1,737,240.41	2.94
68	000563	陕国投A	1,719,161.00	2.91
69	002050	三花股份	1,665,798.00	2.82
70	000596	古井贡酒	1,648,531.99	2.79
71	002313	日海通讯	1,646,285.93	2.78
72	300203	聚光科技	1,639,547.58	2.77
73	002048	宁波华翔	1,637,203.00	2.77
74	601919	中国远洋	1,615,320.00	2.73
75	600343	航天动力	1,609,453.00	2.72
76	002662	京威股份	1,603,686.51	2.71
77	002273	水晶光电	1,597,380.00	2.70
78	300157	恒泰艾普	1,588,166.40	2.69
79	300051	三五互联	1,585,837.00	2.68
80	600236	桂冠电力	1,575,422.12	2.66
81	601898	中煤能源	1,514,704.99	2.56
82	002009	天奇股份	1,507,168.18	2.55
83	002286	保龄宝	1,492,915.00	2.52
84	601169	北京银行	1,479,152.00	2.50
85	000599	青岛双星	1,469,448.00	2.49
86	002188	巴士在线	1,430,846.70	2.42
87	002157	正邦科技	1,428,901.00	2.42

88	600386	北巴传媒	1,419,904.60	2.40
89	300230	永利股份	1,413,202.30	2.39
90	300078	思创医惠	1,413,040.00	2.39
91	600338	西藏珠峰	1,407,146.00	2.38
92	002500	山西证券	1,406,879.20	2.38
93	300133	华策影视	1,400,110.00	2.37
94	002537	海立美达	1,392,232.93	2.35
95	300097	智云股份	1,379,597.75	2.33
96	300251	光线传媒	1,379,250.00	2.33
97	002247	帝龙新材	1,364,465.00	2.31
98	002230	科大讯飞	1,354,458.00	2.29
99	603788	宁波高发	1,344,832.00	2.27
100	603601	再升科技	1,336,218.00	2.26
101	002236	大华股份	1,294,992.81	2.19
102	600581	*ST 八钢	1,291,736.00	2.18
103	300299	富春通信	1,255,731.00	2.12
104	600787	中储股份	1,227,688.77	2.08
105	002699	美盛文化	1,227,350.00	2.08
106	601199	江南水务	1,218,100.60	2.06
107	300198	纳川股份	1,217,857.00	2.06
108	300093	金刚玻璃	1,197,385.00	2.02
109	300241	瑞丰光电	1,187,939.14	2.01
110	600688	上海石化	1,184,914.60	2.00
111	600031	三一重工	1,183,381.00	2.00

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	600666	奥瑞德	17,845,980.18	30.18
2	002217	合力泰	11,089,251.98	18.75
3	002488	金固股份	10,392,409.01	17.58
4	600499	科达洁能	7,874,351.02	13.32
5	300322	硕贝德	7,522,889.25	12.72



6	002284	亚太股份	6,041,857.39	10.22
7	002655	共达电声	5,589,705.15	9.45
8	600745	中茵股份	5,493,488.67	9.29
9	601028	玉龙股份	4,894,216.72	8.28
10	300073	当升科技	4,757,985.55	8.05
11	601988	中国银行	4,716,190.07	7.98
12	002502	骅威文化	4,524,811.71	7.65
13	600030	中信证券	4,004,771.82	6.77
14	300261	雅本化学	3,877,050.82	6.56
15	300168	万达信息	3,681,207.82	6.23
16	002313	日海通讯	3,540,558.89	5.99
17	002458	益生股份	3,507,488.53	5.93
18	002590	万安科技	3,475,981.52	5.88
19	000807	云铝股份	3,437,907.67	5.81
20	600547	山东黄金	3,391,932.41	5.74
21	300031	宝通科技	3,358,204.08	5.68
22	002381	双箭股份	3,330,053.16	5.63
23	002378	章源钨业	3,277,174.12	5.54
24	300113	顺网科技	3,197,557.83	5.41
25	600348	阳泉煤业	3,170,973.08	5.36
26	601628	中国人寿	3,039,245.47	5.14
27	601688	华泰证券	3,000,572.35	5.07
28	601699	潞安环能	2,760,286.91	4.67
29	300027	华谊兄弟	2,747,960.78	4.65
30	300136	信维通信	2,622,107.81	4.43
31	000911	南宁糖业	2,620,756.85	4.43
32	600172	黄河旋风	2,601,077.40	4.40
33	002405	四维图新	2,596,948.67	4.39
34	002464	金利科技	2,533,234.85	4.28
35	600699	均胜电子	2,513,562.95	4.25
36	300077	国民技术	2,503,698.57	4.23
37	300389	艾比森	2,481,059.87	4.20
38	300084	海默科技	2,465,535.07	4.17
39	300128	锦富新材	2,463,509.17	4.17
40	300144	宋城演艺	2,436,841.28	4.12
41	002245	澳洋顺昌	2,304,024.75	3.90
42	300032	金龙机电	2,290,915.11	3.87
43	300296	利亚德	2,247,173.06	3.80

44	002138	顺络电子	2,203,760.09	3.73
45	300369	绿盟科技	2,202,731.72	3.73
46	000563	陕国投 A	2,177,406.75	3.68
47	600651	飞乐音响	2,129,829.84	3.60
48	300011	鼎汉技术	2,125,371.48	3.59
49	300219	鸿利智汇	2,112,460.02	3.57
50	600777	新潮能源	2,109,238.38	3.57
51	300059	东方财富	2,093,188.58	3.54
52	000567	海德股份	2,047,508.23	3.46
53	300145	中金环境	2,030,704.61	3.43
54	002097	山河智能	2,023,158.85	3.42
55	300347	泰格医药	2,013,768.17	3.41
56	002311	海大集团	1,995,712.17	3.38
57	002108	沧州明珠	1,983,514.00	3.35
58	002235	安妮股份	1,955,201.92	3.31
59	300033	同花顺	1,935,887.74	3.27
60	601398	工商银行	1,898,755.85	3.21
61	002583	海能达	1,841,752.37	3.11
62	002589	瑞康医药	1,806,372.20	3.05
63	300381	溢多利	1,777,029.71	3.01
64	300160	秀强股份	1,767,325.05	2.99
65	002662	京威股份	1,759,322.60	2.98
66	002050	三花股份	1,755,702.61	2.97
67	002358	森源电气	1,722,070.46	2.91
68	600029	南方航空	1,679,062.76	2.84
69	000596	古井贡酒	1,659,845.76	2.81
70	002048	宁波华翔	1,631,326.00	2.76
71	600386	北巴传媒	1,630,636.12	2.76
72	600552	凯盛科技	1,593,988.09	2.70
73	300068	南都电源	1,590,796.30	2.69
74	300251	光线传媒	1,586,259.46	2.68
75	600236	桂冠电力	1,580,367.11	2.67
76	601919	中国远洋	1,562,035.96	2.64
77	601169	北京银行	1,561,652.32	2.64
78	300203	聚光科技	1,557,730.66	2.63
79	300133	华策影视	1,554,998.60	2.63
80	300256	星星科技	1,554,458.84	2.63
81	300054	鼎龙股份	1,531,734.12	2.59

82	002273	水晶光电	1,529,463.86	2.59
83	300146	汤臣倍健	1,511,681.36	2.56
84	002449	国星光电	1,505,345.35	2.55
85	300157	恒泰艾普	1,497,714.81	2.53
86	300230	永利股份	1,486,663.45	2.51
87	300051	三五互联	1,467,023.00	2.48
88	002537	海立美达	1,467,010.21	2.48
89	601898	中煤能源	1,462,287.50	2.47
90	002157	正邦科技	1,441,131.10	2.44
91	600343	航天动力	1,429,080.61	2.42
92	603601	再升科技	1,413,789.76	2.39
93	002188	巴士在线	1,384,824.00	2.34
94	002286	保龄宝	1,382,387.42	2.34
95	300097	智云股份	1,381,879.98	2.34
96	600338	西藏珠峰	1,378,852.07	2.33
97	002247	帝龙新材	1,376,761.04	2.33
98	002202	金风科技	1,376,701.00	2.33
99	002230	科大讯飞	1,344,002.97	2.27
100	300078	思创医惠	1,342,559.00	2.27
101	002236	大华股份	1,258,961.12	2.13
102	002618	丹邦科技	1,256,199.80	2.12
103	300299	富春通信	1,249,843.49	2.11
104	300241	瑞丰光电	1,248,722.48	2.11
105	300183	东软载波	1,247,133.42	2.11
106	002111	威海广泰	1,217,213.50	2.06
107	002324	普利特	1,216,585.00	2.06
108	600707	彩虹股份	1,211,522.35	2.05
109	002131	利欧股份	1,208,624.09	2.04
110	002169	智光电气	1,205,638.63	2.04
111	600031	三一重工	1,203,251.00	2.03
112	002009	天奇股份	1,197,127.37	2.02
113	600662	强生控股	1,194,103.00	2.02
114	000599	青岛双星	1,193,598.71	2.02

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	410,325,056.88
卖出股票收入（成交）总额	404,088,691.79

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金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未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	92,472.85
2	应收证券清算款	1,132,288.36
3	应收股利	-
4	应收利息	1,866.45
5	应收申购款	14,985.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,241,612.83

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	1,608,334.00	3.34	重大资产重组
2	002297	博云新材	1,456,851.55	3.03	重大资产重组

### 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
4,140	8,199.39	197,740.46	0.58%	33,747,716.49	99.42%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月30日）基金份额总额	800,855,129.16
本报告期期初基金份额总额	34,692,699.98
本报告期基金总申购份额	2,740,920.78
减：本报告期基金总赎回份额	3,488,163.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	33,945,456.95

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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2016 年 1 月 16 日，吴永敏先生因退休不再担任公司董事长，由范力先生担任公司董事长。

2、2016 年 1 月 16 日，任少华先生因工作调动辞去公司总经理职务，由王炯先生担任公司总经理，同时王炯先生辞去其所担任的公司副总经理职务。

3、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无相关诉讼。

## 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

本基金本报告期内聘用天衡会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金会计师事务所。

## 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

本基金本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

## 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	194,096,797.29	23.83%	177,046.33	23.70%	-
中银国际	1	182,235,424.61	22.38%	166,071.73	22.23%	-
兴业证券	1	127,248,196.38	15.62%	118,506.67	15.86%	-
国信证券	1	114,009,502.57	14.00%	106,177.69	14.21%	-

招商证券	1	85,747,977.42	10.53%	78,142.23	10.46%	-
恒泰证券	2	70,227,461.19	8.62%	63,998.20	8.57%	-
海通证券	2	40,848,389.21	5.02%	37,225.05	4.98%	-
平安证券	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和程序

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 1 个交易单元为招商证券；新增两个交易单元为海通证券；新增 1 个交易单元为天风证券。

### 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	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-



## §11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金合同约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%。因此本基金于 2016 年 8 月 18 日发布分红公告，向截至 2016 年 8 月 22 日止在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人发放红利，每 10 份基金份额派发红利 3.90 元。

东吴基金管理有限公司  
2016 年 8 月 25 日