

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国农业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	东吴进取策略混合
基金主代码	580005
交易代码	580005
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 5 月 6 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	66,851,580.97 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，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。
业绩比较基准	65%*沪深 300 指数+35%*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，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	林葛
	联系电话	021-50509888-8308	010-66060069
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	95599
传真	021-50509888-8211	010-68121816

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	-4,265,185.87
本期利润	-2,792,766.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0419
本期基金份额净值增长率	-2.78%
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	0.5106
期末基金资产净值	100,984,398.31
期末基金份额净值	1.5106

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

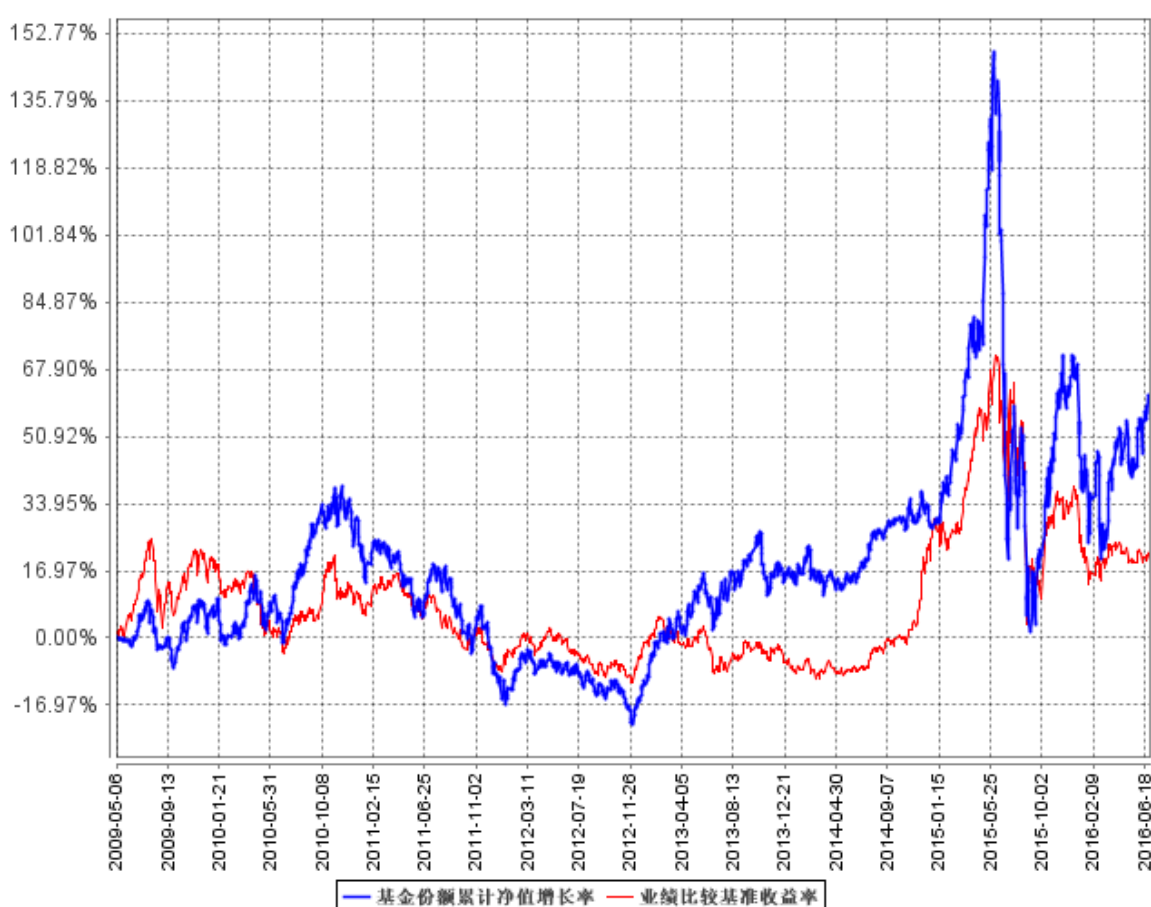
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.80%	1.79%	-0.07%	0.64%	8.87%	1.15%

过去三个月	11.39%	1.63%	-1.17%	0.66%	12.56%	0.97%
过去六个月	-2.78%	2.51%	-9.49%	1.20%	6.71%	1.31%
过去一年	-3.14%	3.10%	-17.42%	1.50%	14.28%	1.60%
过去三年	54.44%	2.18%	34.83%	1.20%	19.61%	0.98%
自基金合同生效起至今	61.58%	1.68%	21.62%	1.08%	39.96%	0.60%

注：比较基准=65%*沪深 300 指数+35%*中证全债指数。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、东吴进取策略基金于 2009 年 5 月 6 日成立。
2、比较基准=65%*沪深 300 指数+35%*中证全债指数。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[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		
王立立	权益投资部副总经理兼研究策划部副总经理、本基金基金经理	2015年2月6日	-	6年	硕士，复旦大学世界经济专业。2010年7月至2010年12月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理，2011年1月至2012年7月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员，自2012年7月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理，现任权益

					<p>投资部副总经理兼研究策划部副总经理，其中自 2013 年 12 月 24 日起担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理、自 2014 年 6 月 14 日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 2 月 6 日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理、自 2015 年 5 月 29 日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 12 月 30 日起担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、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

年初以来，市场整体弱势，一月股灾再度出现，市场大幅下跌，二到六月份市场维持温和的区间震荡，期间结构性机会明显，分化严重。截至 7 月 8 日，上证指数下跌 15.57%，中小板指数下跌 16.75%，创业板指数下跌 17.50%。

回顾年初下跌的原因，主要有以下几点：第一、投资者在经历了 2015 年的股灾之后，惊魂未定，市场信心依然脆弱；第二、充裕的流动性催生了 15 年中小市值公司的估值泡沫，狗跑得太快主人已经跟不上了，市场本身需要一个价值回归的过程；第三、年初外围市场无比动荡，客观上营造了全球金融市场的恐慌气氛。原油等大宗商品、美股欧股都经历了大跌，美联储货币政策收紧的节奏不明确，人民币汇率动荡，对于蒙代尔不可能三角的窘境的担忧不断升级。第四、熔断机制也加速了下跌过程。

尽管上半年指数大幅下跌，行情惨淡，但市场分化严重，个别基本面强劲的板块走势强劲，创出历史新高的个股也不在少数。新能源汽车、白酒、农业养殖、贵金属板块凭借着自身强大的基本面支撑，成为了黑夜中最亮的那几颗星。结构性行情的特点从基金净值也可以看得出来，在一月的大跌以后，重个股和板块选择的主动管理型基金净值是出现了大幅回升的。所以整体来讲，上半年虽然开局不利，指数惨淡，但市场以点带面，依然具有很强的赚钱效应。只不过赚钱效应集中在个别板块，需要投资者耐心挑选，这个特征跟 12、13 年比较像。

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 1.5106 元，累计净值 1.5806 元；本报告期份额净值增长率-2.78%，同期业绩比较基准收益率为-9.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球来看，目前英国脱欧事件后续的不确定性仍在，英国连续出现房地产基金暂停赎回的消息，欧洲银行业危机发酵带来的海外金融市场波动和流动性冲击仍然是全球市场潜在的风险点。近期人民币汇率锚定一篮子货币顺势波动，释放了贬值压力；英国脱欧引起的全球市场动荡使美联储加息的预期减弱，市场对欧洲央行的宽松预期增强也是稳定金融市场有利的因素。

国内来看，我国 6 月 CPI 同比上涨 1.9%，近期洪涝灾害预计对 CPI 影响不大，现阶段不对货币政策构成压力；PPI 同比跌幅继续收窄，但是环比下降，目前来看继续回升的动力不足。稳增长调结构仍然是现阶段的政策基调，近期一线城市地产销量有所下滑，但地产投资由于惯性仍然将继续发挥托底经济的作用。在人民币汇率定价机制的改变的情形下，市场对汇率走势的预期更多的由我国宏观基本面的走势决定。当前在脱虚向实、调整经济结构的宏观背景下，市场对流动性进一步宽松的预期也有所降低，货币环境整体稳健。

往后看，英国脱欧事件带来的不确定性仍然是市场潜在的风险，欧洲银行业的危机仍然值得关注；另一方面，市场对美联储加息预期进一步下降，海外市场宽松预期增强，人民币贬值压力不大也是目前市场有利的因素，但须警惕美联储加息预期的拐点。

外围来看，尽管英国脱欧带来了诸多不确定性，但基本面的不确定性使得美联储加息可能进一步降低，欧洲维持宽松难以避免，上周五，标普 500 指数涨 1.53%，接近历史新高，这一点值得关注，英国脱欧似乎并没有对美国股市造成不利影响。

再看国内 A 股市场，最近也是走得非常坚挺的。6 月份 A 股市场经历了 MSCI 落空、英国脱欧两大基本面利空的洗礼，也承受住了半年度的流动性考验，不跌反涨。自去年高点 5178 点以来，市场已经调整了整整 13 个月，上证指数下跌 43%，调整的时间和空间都已经足够充分。

我们致力于投资有基本面支撑的细分行业趋势，在目前可操作的市场里，我们认为机会主要存在于以下几个方向：

新能源汽车相关产业链：业绩爆发年份，挖掘产业链最景气的环节，反复投资。

汽车电子、智能汽车及无人驾驶大方向：最重要、最普及的智能终端，被互联网思维改造是大势所趋。行业内标的市值不大，估值低，转型多，投资机会显著。

手机硬件的创新：玻璃化与无线充电。

传媒景气子行业：行业景气，业绩有保证，调整充分估值低，精选市值估值有支撑，业绩增长有保证的中小型标的。

大宗商品贵金属：全球不确定性大，流动性依然充裕，精选行业调整充分，能涨价弹性好的

品种。

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、运营总监、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；运营总监、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

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业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《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金合同》、《东吴基金管理有限公司托管协议》的约定，对东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金管理人—东吴基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金
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
资产:		
银行存款	12,986,887.70	8,223,781.18
结算备付金	160,119.33	283,368.96
存出保证金	91,475.80	125,426.03
交易性金融资产	87,655,498.68	92,910,018.52
其中: 股票投资	80,468,476.18	79,961,207.38
基金投资	-	-
债券投资	7,187,022.50	12,948,811.14
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	1,429,309.07	2,944,291.06
应收利息	11,281.89	5,709.50
应收股利	-	-
应收申购款	72,735.81	186,505.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	102,407,308.28	104,679,101.05
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
负 债:		
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	794,804.54	202,000.27
应付管理人报酬	121,735.67	134,918.86
应付托管费	20,289.25	22,486.47
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	104,354.98	131,708.82
应交税费	200,000.00	200,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,725.53	240,495.75
负债合计	1,422,909.97	931,610.17
所有者权益:		
实收基金	66,851,580.97	66,771,803.16
未分配利润	34,132,817.34	36,975,687.72
所有者权益合计	100,984,398.31	103,747,490.88

负债和所有者权益总计	102,407,308.28	104,679,101.05
------------	----------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5106 元，基金份额总额 66,851,580.97 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

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
一、收入	-1,464,000.30	81,064,307.34
1.利息收入	55,870.58	237,552.74
其中：存款利息收入	45,525.62	205,076.31
债券利息收入	10,344.96	5,899.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	26,577.16
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,017,155.56	77,909,911.50
其中：股票投资收益	-2,224,315.86	77,507,262.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,015,804.43	229,673.63
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	222,964.73	172,974.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,472,419.37	2,865,076.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	24,865.31	51,766.57
减：二、费用	1,328,766.20	5,320,042.13
1.管理人报酬	665,597.65	1,580,816.09
2.托管费	110,932.86	263,469.36
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	353,232.23	3,269,435.10
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	199,003.46	206,321.58

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,792,766.50	75,744,265.21
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,792,766.50	75,744,265.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

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）	66,771,803.16	36,975,687.72	103,747,490.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,792,766.50	-2,792,766.50
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）	79,777.81	-50,103.88	29,673.93
其中：1.基金申购款	18,139,822.95	6,420,254.62	24,560,077.57
2.基金赎回款	-18,060,045.14	-6,470,358.50	-24,530,403.64
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）	66,851,580.97	34,132,817.34	100,984,398.31
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）	200,659,765.11	40,041,755.05	240,701,520.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	75,744,265.21	75,744,265.21

期利润)			
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)	-125,949,041.28	-73,987,274.30	-199,936,315.58
其中：1.基金申购款	12,721,822.95	9,495,840.78	22,217,663.73
2.基金赎回款	-138,670,864.23	-83,483,115.08	-222,153,979.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	74,710,723.83	41,798,745.96	116,509,469.79

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

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]140 号文核准向社会公开发行募集,基金合同于 2009 年 5 月 6 日正式生效。首次设立募集规模为 1,048,618,365.29 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资组合中股票类投资比例为基金资产的 30%-80%,固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%,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。本基金的业绩比较基准=65%*沪深 300 指数+35%*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》、《东吴进取策略混合型证券投资基金基金合

同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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

无。

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

无。

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
中国农业银行股份有限公司	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	14, 373, 969. 65	6. 12%	156, 281, 462. 52	7. 27%

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	4,414,634.50	15.19%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 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
东吴证券股份有限公 司	13,386.36	0.89%	-	-
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	142,278.77	7.43%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券
 结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：
 为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 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	665,597.65	1,580,816.09
其中：支付销售机构的 客户维护费	147,410.82	347,887.27

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年

费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	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	110,932.86	263,469.36

注：支付基金托管人中国农业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

本基金无销售服务费。

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

注：本基金本报告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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		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
中国农业银行股份有限公司	12,986,887.70	42,323.49	10,849,935.29	182,173.30

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
300300	汉鼎 宇佑	2016 年 5 月 10 日	重大 资产 重组	34.35	-	-	199,800	5,531,169.72	6,863,130.00	-
002297	博云 新材	2016 年 6 月 20 日	重大 资产 重组	13.09	-	-	407,400	5,442,332.66	5,332,866.00	-
300282	汇冠 股份	2016 年 4 月 22 日	重大 资产 重组	39.68	2016 年 7 月 26 日	36.78	78,600	2,615,232.00	3,118,848.00	-
600734	实达 集团	2016 年 4 月 20 日	重大 资产 重组	13.88	-	-	184,200	2,651,746.00	2,556,696.00	-
600576	万家 文化	2016 年 4 月 11 日	重大 资产 重组	21.77	-	-	110,800	2,592,492.40	2,412,116.00	-
300351	永贵 电器	2016 年 6 月 29 日	临时 停牌	33.93	2016 年 7 月 4 日	33.30	45,000	1,326,814.00	1,526,850.00	-
300061	康耐 特	2016 年 6 月 24 日	重大 事项	28.84	2016 年 7 月 21 日	31.56	36,500	913,225.00	1,052,660.00	-
002452	长高 集团	2016 年 6 月 14 日	重大 事项	12.02	2016 年 7 月 12 日	10.82	79,200	977,738.00	951,984.00	-

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	80,468,476.18	78.58
	其中：股票	80,468,476.18	78.58
2	固定收益投资	7,187,022.50	7.02
	其中：债券	7,187,022.50	7.02
	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	13,147,007.03	12.84
7	其他各项资产	1,604,802.57	1.57
8	合计	102,407,308.28	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,020,326.00	1.01
B	采矿业	-	-

C	制造业	61,875,621.66	61.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,001,671.52	1.98
F	批发和零售业	4,968,812.00	4.92
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	9,478,210.00	9.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,123,835.00	1.11
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	80,468,476.18	79.68

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序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	300300	汉鼎宇佑	199,800	6,863,130.00	6.80
2	300128	锦富新材	326,891	5,906,920.37	5.85
3	601799	星宇股份	127,564	5,844,982.48	5.79
4	002297	博云新材	407,400	5,332,866.00	5.28
5	300261	雅本化学	432,393	5,262,222.81	5.21

6	300073	当升科技	77,100	5,161,074.00	5.11
7	002418	康盛股份	479,100	5,059,296.00	5.01
8	002247	帝龙新材	313,000	4,654,310.00	4.61
9	002695	煌上煌	62,900	3,167,644.00	3.14
10	300282	汇冠股份	78,600	3,118,848.00	3.09

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	300300	汉鼎宇佑	5,531,169.72	5.33
2	600666	奥瑞德	5,302,246.00	5.11
3	300128	锦富新材	4,955,203.00	4.78
4	002418	康盛股份	4,625,416.00	4.46
5	002247	帝龙新材	4,104,621.82	3.96
6	002245	澳洋顺昌	4,009,057.00	3.86
7	300073	当升科技	3,871,431.00	3.73
8	002297	博云新材	3,436,945.74	3.31
9	300061	康耐特	3,324,581.80	3.20
10	002695	煌上煌	3,232,419.09	3.12
11	300160	秀强股份	3,001,347.00	2.89
12	002467	二六三	2,916,114.00	2.81
13	002464	金利科技	2,709,907.00	2.61
14	600734	实达集团	2,651,746.00	2.56
15	002126	银轮股份	2,648,327.92	2.55
16	300203	聚光科技	2,639,661.92	2.54
17	300282	汇冠股份	2,615,232.00	2.52
18	002530	丰东股份	2,603,343.00	2.51
19	002137	麦达数字	2,595,547.06	2.50
20	600576	万家文化	2,592,492.40	2.50
21	300211	亿通科技	2,509,915.00	2.42
22	300285	国瓷材料	2,499,686.00	2.41
23	300150	世纪瑞尔	2,413,930.00	2.33
24	603611	诺力股份	2,287,599.00	2.20

25	000567	海德股份	2,282,426.40	2.20
26	600777	新潮能源	2,185,286.92	2.11

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	002488	金固股份	7,616,540.24	7.34
2	600666	奥瑞德	6,111,979.00	5.89
3	300073	当升科技	5,172,750.17	4.99
4	002245	澳洋顺昌	4,494,877.22	4.33
5	002235	安妮股份	4,122,644.99	3.97
6	300054	鼎龙股份	4,012,792.90	3.87
7	002530	丰东股份	3,676,574.00	3.54
8	002217	合力泰	3,236,820.50	3.12
9	600777	新潮能源	3,002,473.06	2.89
10	000567	海德股份	2,931,111.97	2.83
11	300285	国瓷材料	2,892,788.90	2.79
12	300028	金亚科技	2,817,578.40	2.72
13	002261	拓维信息	2,801,902.00	2.70
14	002405	四维图新	2,709,795.27	2.61
15	002276	万马股份	2,631,699.00	2.54
16	300005	探路者	2,569,593.90	2.48
17	300211	亿通科技	2,523,236.00	2.43
18	300160	秀强股份	2,493,572.00	2.40
19	002502	骅威文化	2,424,505.56	2.34
20	300203	聚光科技	2,407,341.28	2.32
21	002467	二六三	2,305,464.35	2.22
22	002137	麦达数字	2,275,073.20	2.19
23	300061	康耐特	2,240,768.00	2.16
24	603611	诺力股份	2,183,230.00	2.10
25	002126	银轮股份	2,135,664.46	2.06
26	300150	世纪瑞尔	2,089,513.92	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	118,036,758.20
卖出股票收入（成交）总额	116,885,899.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,187,022.50	7.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,187,022.50	7.12

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	38,079	4,101,108.30	4.06
2	110031	航信转债	27,980	3,085,914.20	3.06

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

本基金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

本基金本报告期末持有股指期货。

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	91,475.80
2	应收证券清算款	1,429,309.07
3	应收股利	-
4	应收利息	11,281.89
5	应收申购款	72,735.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,604,802.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123001	蓝标转债	4,101,108.30	4.06
2	110031	航信转债	3,085,914.20	3.06

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	300300	汉鼎宇佑	6,863,130.00	6.80	重大资产重组
2	002297	博云新材	5,332,866.00	5.28	重大资产重组
3	300282	汇冠股份	3,118,848.00	3.09	临时停牌

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
8,072	8,281.91	295,050.51	0.44%	66,556,530.46	99.56%

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	4,134.02	0.0062%

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5月6日）基金份额总额	1,048,618,365.29
本报告期期初基金份额总额	66,771,803.16
本报告期基金总申购份额	18,139,822.95
减：本报告期基金总赎回份额	18,060,045.14
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	66,851,580.97

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

- 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

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	
招商证券	1	114,587,749.92	48.78%	104,423.68	48.60%	-
东北证券	1	39,007,099.15	16.60%	35,547.33	16.54%	-
东方证券	1	29,792,506.99	12.68%	27,149.83	12.64%	-
申银万国	1	24,434,827.80	10.40%	22,756.33	10.59%	-
东吴证券	2	14,373,969.65	6.12%	13,386.36	6.23%	-
安信证券	2	12,726,504.47	5.42%	11,597.53	5.40%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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

本报告期本基金无交易单元变更情况。

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
招商证券	6,780,358.40	23.34%	-	-	-	-
东北证券	4,443,015.25	15.29%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	8,890,311.00	30.60%	-	-	-	-
东吴证券	4,414,634.50	15.19%	-	-	-	-
安信证券	4,526,369.23	15.58%	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日