

**东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证
券投资基金
2017 年半年度报告**

2017 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：二〇一七年八月二十五日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴智慧医疗
基金主代码	002919
交易代码	002919
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 11 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	316,761,548.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票，通过量化选股与择时相结合的方法，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。
业绩比较基准	65% × 中证医疗指数收益率 + 35% × 中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，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	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
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区复兴门内大街 28

		号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200135	100031
法定代表人	王炯	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-31,781,025.64
本期利润	-15,891,334.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0456
本期加权平均净值利润率	-4.89%
本期基金份额净值增长率	-4.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-34,559,787.13
期末可供分配基金份额利润	-0.1091
期末基金资产净值	287,927,222.22
期末基金份额净值	0.909
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-9.10%

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

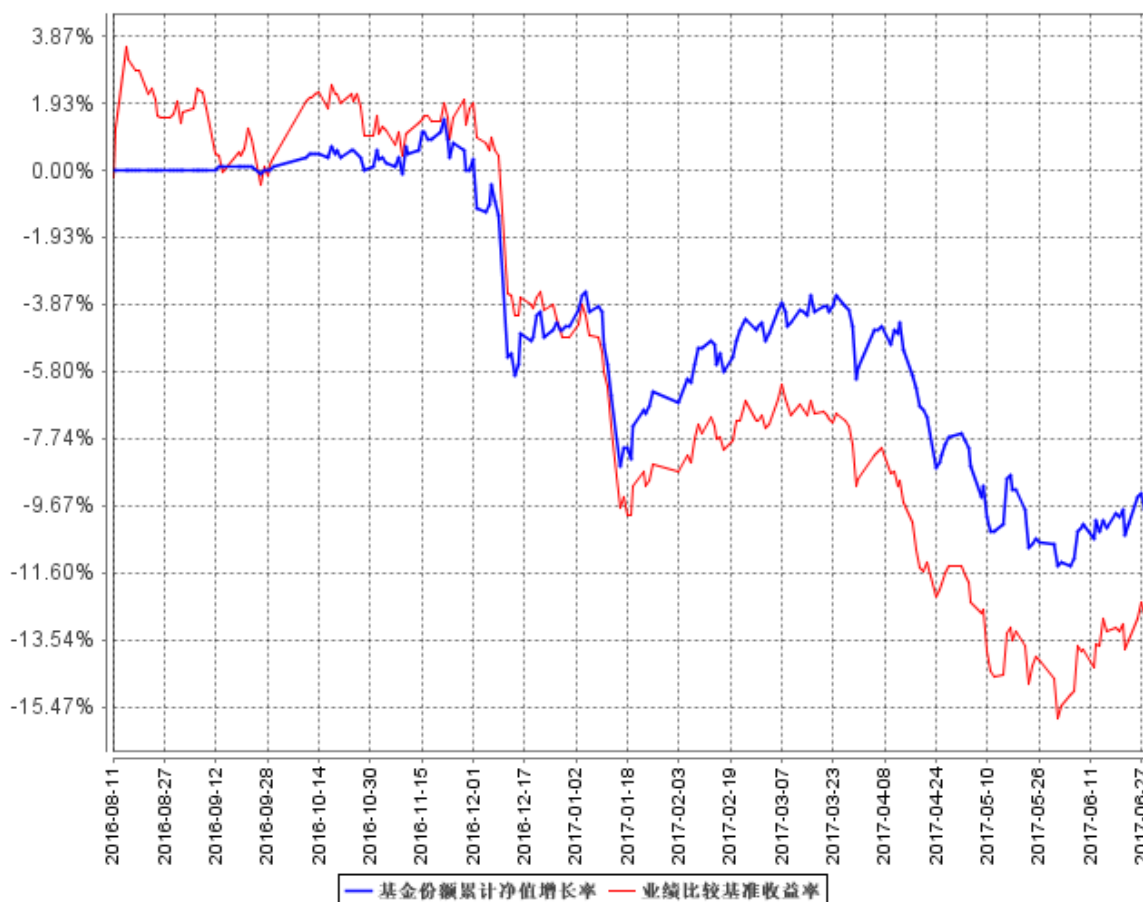
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	1.91%	0.46%	2.86%	0.67%	-0.95%	-0.21%
过去三个月	-3.61%	0.55%	-3.86%	0.64%	0.25%	-0.09%
过去六个月	-4.82%	0.55%	-7.96%	0.61%	3.14%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-9.10%	0.54%	-12.31%	0.63%	3.21%	-0.09%

注：1. 本基金业绩比较基准=65%×中证医疗指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率。

2. 本基金于 2016 年 8 月 11 日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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. 本基金业绩比较基准=65%×中证医疗指数收益率+35%×中债综合全价(总值)指数收益率。

2. 本基金于 2016 年 8 月 11 日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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,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、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

在泛资管大背景下,公司近年来推进公募基金、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 2017 年二季度末,公司整体资产管理规模为 734.06 亿元,其中公募基金 247.63 亿元,专户业务 180.62 亿元,子公司 305.81 亿元;旗下管理着 25 只公募基金,42 只存续专户资产管理计划,88 项存续专项资产管理计划,形成了高中低不同风险层次的多元化产品线。

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的投资风格,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,兼顾收益率和流动性,为大类资产配置提供基础性工具。

尤其是 2015 年以来,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,发行了多只量化公募产品,并在业内率先成立了绝对收益部。

2017 年,公司对投研模块进行了变革,引进了彭敢等公募行业领军人物,投研磨合红利已开始显现,尤其是固定收益投资崭露头角。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示,截至 2017 年二季度末,东吴基金旗下的固定收益类基金以 2.44%的规模加权平均收益,位列 98 家入选基金公司的第六位。

今年以来,公司在固定收益领域获得了多个奖项,比如 2016 年度积极债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金*东吴鼎利债券基金 L0F(东方财富风云榜)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		
周健	本基金基金经理	2016年8月11日	-	10年	硕士，南开大学毕业。曾就职于海通证券；2011年5月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研究策划部研究员，现任基金经理，自2012年05月03日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自2013年6月5日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理、自2016年6月3日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年8月11日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，其中，自2012年10月27日至2015年5月29日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理，2016年2月3日至2017年4月19日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年2月5日至2017年4月19日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。
秦斌	本基金基金经理	2016年10月18日	-	7.5年	硕士，2009年07月至2015年6月就职于东吴证券股份有限公司，历任研究所金融工程分析师、投资总部量化与衍生品交易研究员，2015年7月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理，现任基金经

					理，其中自 2016 年 7 月 7 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、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 18 日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、周健为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日，其他日期为对外公告日；
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

上半年，宏观方面的主导变量是“经济强”与“金融紧”，一季度“经济强”，二季度“金融紧”，五月下旬后经济预期再次由弱趋强，金融监管则由强趋缓。A 股上半年整体呈现“N”字走势，一季度市场整体震荡走强，二季度先抑后扬，四月上旬市场在“雄安新区”崛起中喧嚣一把，但整体市场盈利效应匮乏，在竞争性监管和强力去杠杆影响下，市场出现恐慌性的投降式抛售，之后资金抱团自救，以上证 50 和中证 100 为代表的个股逐步企稳反弹，但市场整体赚钱效应羸弱，市场“一九效应”愈发明显，六月以来，市场抱团效应缓解，整体赚钱效应回升，从“一九”逐步过渡到“三七”，有色、钢铁等周期板块甚至走出了反转行情。但板块分化的矛盾仍然非常尖锐。

本基金采用在主题股票池内量化选股进行均衡配置，辅之以量化择时和资金管理，在市场大部分股票迭创新低的背景下二季度出现了阶段回撤，六月逐步企稳回升。市场运行逻辑正处于破坏性重构过程中，随着市场盈利效应逐步回归，A 股有望步入进二退一的良性循环。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.909 元，累计净值 0.909 元；本报告期份额净值增长率-4.82%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观变量先看“经济强”，后看“金融紧”。受益于美日韩新一轮朱格拉周期，制造业结构性复苏，处于缓慢复苏过程中。美日韩新一轮设备投资支出周期外溢效应叠加国内企业设备更新、升级需求，政策导向正本清源，制造业国内的高端装备制造业走向智能化和自动化，中国经济短周期出现一段景气格局，但房地产投资是景气持续的关键，增速高点已过，好在快速其下行拐点尚未显现，基建方面，下半年预算内财政支出可能出现负增长，但全年基建增速仍可能维持在 15%左右。

今年以来，月度经济数据波动加大，中长期看，经济“L”型仍将延续，经济结构出现变化和亮点，经济出现了结构性复苏和制造业的再繁荣。经济的内在韧性决定年内难觅政策宽松拐点。国务院环保督察对部分地区高耗能行业的生产和投资抑制较多，黑色、有色、化学制品出现明显下滑，对周期品价格造成脉冲性冲击。随着下半年尤其是冬季取暖季的错峰生产，环保限产和去产能仍是下阶段影响生产、投资的重要因素。

经济结构的变化体现在 A 股市场中，市场结构性地出现一些行业的阶段持续强势，而其余大部分行业持续萎靡，市场结构性分化演化到非常尖锐的地步。但随着各行业景气的逐步回升，以及监管友好程度的提高，市场风险偏好的逐步回暖，抱团资金逐步往风险收益比更诱惑力的行业

转移，比如计算机、传媒、医药等板块，市场抱团效应缓解，整体赚钱效应从“一九”逐步过渡到“三七”，随着市场盈利效应逐步回归，A股步入进二退一的良性循环。

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、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；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，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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 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本基金的投资运作、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本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，未发现有关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：东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	87,594,464.76	36,640,981.50
结算备付金		1,393,623.28	937,622.46
存出保证金		307,130.85	113,132.09
交易性金融资产	6.4.7.2	179,561,425.91	262,764,319.22
其中：股票投资		179,561,425.91	262,764,319.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	63,000,214.50
应收证券清算款		21,200,556.92	-
应收利息	6.4.7.5	17,525.29	26,424.76
应收股利		-	-
应收申购款		992.56	99.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		290,075,719.57	363,482,793.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		1,413,254.17	320,716.53
应付管理人报酬		358,677.07	476,889.07
应付托管费		59,779.51	79,481.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	182,542.10	97,779.92

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	134,244.50	130,804.64
负债合计		2,148,497.35	1,105,671.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	316,761,548.78	379,636,245.83
未分配利润	6.4.7.10	-28,834,326.56	-17,259,123.59
所有者权益合计		287,927,222.22	362,377,122.24
负债和所有者权益总计		290,075,719.57	363,482,793.93

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.909 元，基金份额总额 316,761,548.78 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-11,670,003.67	-
1.利息收入		487,030.48	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	390,605.01	-
债券利息收入		87.67	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		96,337.80	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-28,135,301.52	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-29,131,225.40	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	29,912.33	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	966,011.55	-
1) 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	15,889,690.86	-
2) 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
3) 5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	88,576.51	-
减：二、费用		4,221,331.11	-

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,422,257.14	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	403,709.51	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,238,266.64	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	157,097.82	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,891,334.78	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,891,334.78	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	379,636,245.83	-17,259,123.59	362,377,122.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,891,334.78	-15,891,334.78
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)	-62,874,697.05	4,316,131.81	-58,558,565.24
其中：1.基金申购款	1,685,898.87	-108,905.43	1,576,993.44
2.基金赎回款	-64,560,595.92	4,425,037.24	-60,135,558.68
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)	316,761,548.78	-28,834,326.56	287,927,222.22
项目	上年度可比期间 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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

基金管理人负责人

吕晖

主管会计工作负责人

沈静

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2016]627号《关于同意东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合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2016年8月11日正式生效,首次设立募集规模为556,759,946.47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。

本基金是混合型基金,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。本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票,通过量化选股与择时相结合的方法,在充分控制

基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。

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》、《东吴智慧医疗量化策略灵活配置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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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

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、营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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；

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，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、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。

4、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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	87,594,464.76
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	87,594,464.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	174,307,832.71	179,561,425.91	5,253,593.20
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	174,307,832.71	179,561,425.91	5,253,593.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,836.43
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	564.48
应收债券利息	-
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	124.38
合计	17,525.29

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	182,542.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	182,542.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,314.58
预提费用	128,929.92
合计	134,244.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	379,636,245.83	379,636,245.83
本期申购	1,685,898.87	1,685,898.87
本期赎回(以“-”号填列)	-64,560,595.92	-64,560,595.92
- 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	316,761,548.78	316,761,548.78

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,804,262.02	-10,454,861.57	-17,259,123.59

本期利润	-31,781,025.64	15,889,690.86	-15,891,334.78
本期基金份额交易产生的变动数	4,025,500.53	290,631.28	4,316,131.81
其中：基金申购款	-98,514.43	-10,391.00	-108,905.43
基金赎回款	4,124,014.96	301,022.28	4,425,037.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,559,787.13	5,725,460.57	-28,834,326.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	380,458.82
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	7,777.12
其他	2,369.07
合计	390,605.01

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	781,430,427.68
减：卖出股票成本总额	810,561,653.08
买卖股票差价收入	-29,131,225.40

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,030,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000,000.00
减：应收利息总额	87.67
买卖债券差价收入	29,912.33

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末未进行权证投资。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	966,011.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	966,011.55

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	15,889,690.86
——股票投资	15,889,690.86
——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	-
合计	15,889,690.86

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	86,241.30
转换费收入	2,335.21
合计	88,576.51

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,238,266.64
银行间市场交易费用	-
合计	1,238,266.64

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	99,177.14
汇划费	9,659.90
其他费用	328.00
帐户维护费	18,180.00
合计	157,097.82

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

无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

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、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。

6.4.10 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	1,489,906,206.58	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	1,030,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期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 2017年1月1日至2017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 总量的比例
东吴股份有限 公司	324,767.28	100.00%	182,542.10	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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 总量的比例
-	-	-	-	-

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。

6.4.10.2 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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,422,257.14	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,233,467.51	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	403,709.51	-

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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期间基金管理人未持有本基金份额。

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	87,594,464.76	380,458.82	-	-

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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（2017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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

		日	12 日							
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 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
000571	新大洲 A	2017 年 5 月 15 日	重大资产重组	8.11	2017 年 8 月 14 日	8.41	352,421	2,722,851.23	2,858,134.31	-
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	临时停牌	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	381,000	2,446,891.99	2,846,070.00	-
600165	新日恒力	2017 年 4 月 10 日	重大资产重组	16.84	2017 年 7 月 20 日	15.16	135,800	1,882,650.30	2,286,872.00	-
002162	悦心健康	2016 年 12 月 22 日	临时停牌	6.61	2017 年 7 月 5 日	6.80	336,181	2,247,843.00	2,222,156.41	-
000656	金科股份	2017 年 5 月 31 日	临时停牌	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	250,600	1,357,677.13	1,638,924.00	-
600764	中电广通	2017 年 6 月 29 日	临时停牌	33.25	2017 年 7 月 7 日	33.98	32,600	1,049,792.00	1,083,950.00	-
300151	昌红科技	2017 年 6 月 7 日	重大资产重组	11.53	2017 年 8 月 18 日	10.38	90,334	1,085,442.19	1,041,551.02	-
300298	三诺生物	2017 年 5 月 22 日	重大资产重组	16.27	2017 年 7 月 17 日	16.09	60,600	972,878.44	985,962.00	-
300109	新开源	2017 年 6 月	重大资产	46.46	-	-	15,277	713,327.00	709,769.42	-

		6 日	重组								
600568	中珠医疗	2017 年 4 月 25 日	重大资产重组	19.63	2017 年 7 月 27 日	6.15	35,900	750,870.55	704,717.00	-	
000700	模塑科技	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	8.09	2017 年 8 月 16 日	8.00	82,800	617,640.00	669,852.00	-	
000153	丰原药业	2017 年 1 月 16 日	重大资产重组	12.52	2017 年 7 月 12 日	11.27	38,300	503,121.00	479,516.00	-	
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大资产重组	17.94	-	-	26,720	488,705.67	479,356.80	-	
600602	云赛智联	2017 年 6 月 22 日	临时停牌	7.51	2017 年 7 月 4 日	7.80	62,700	467,794.00	470,877.00	-	
002696	百洋股份	2017 年 6 月 22 日	临时停牌	20.87	2017 年 7 月 3 日	21.74	14,200	269,431.60	296,354.00	-	
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	临时停牌	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	11,300	271,893.68	283,178.00	-	
002049	紫光国芯	2017 年 6 月 15 日	重大资产重组	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	6,500	228,974.99	200,330.00	-	
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	临时停牌	18.50	2017 年 7 月 7 日	18.88	8,200	150,217.00	151,700.00	-	
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大资产重组	14.12	-	-	10,700	149,898.00	151,084.00	-	
300075	数字政通	2017 年 6 月 29 日	临时停牌	20.94	2017 年 7 月 17 日	18.86	6,800	148,763.00	142,392.00	-	
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	临时停牌	5.16	-	-	27,400	150,426.00	141,384.00	-	
600460	士兰微	2017 年 5 月 22 日	重大资产重组	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	22,400	139,196.94	135,968.00	-	
000836	鑫茂科技	2017 年 5 月 24 日	重大资产重组	6.05	-	-	16,600	138,278.00	100,430.00	-	

601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项停牌	22.29	-	-	3,900	83,540.71	86,931.00	-
300209	天泽信息	2017年6月26日	重大资产重组	27.72	-	-	2,600	71,112.85	72,072.00	-
300462	华铭智能	2017年6月9日	重大资产重组	36.83	-	-	1,900	71,556.71	69,977.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	临时停牌	23.26	2017年7月27日	19.49	3,000	84,851.00	69,780.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大资产重组	5.35	2017年7月26日	5.89	11,300	70,625.00	60,455.00	-
600734	实达集团	2017年4月5日	临时停牌	12.75	2017年7月12日	12.00	3,500	49,805.00	44,625.00	-
002312	*ST三泰	2017年3月31日	重大资产重组	6.82	2017年7月24日	7.16	6,300	49,896.00	42,966.00	-
600289	亿阳信通	2017年6月26日	临时停牌	10.94	2017年8月18日	12.03	3,800	50,008.00	41,572.00	-
000032	深桑达A	2017年5月24日	重大资产重组	15.69	-	-	2,000	29,088.98	31,380.00	-
002447	壹桥股份	2017年5月2日	重大资产重组	9.00	-	-	1,300	12,246.00	11,700.00	-

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

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要国内依法发行上市的股票、股指期

货、权证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票，通过量化选股与择时相结合的方法，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。

本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。

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

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。报告期内，本基金持有的金融资产均未发生逾期与减值的情况。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。本基金的银行存款存放于本基金的托管行 - 中国农业银行股份有限公司。本基金认为与中国农业银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。本基金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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回

资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的合规风控部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。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资产净值的 40%。

除卖出回购金融资产款合约约定到期日均为一个月以内计息外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本

基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	87,594,464.76	-	-	-	-	-	87,594,464.76
清算备付金	1,393,623.28	-	-	-	-	-	1,393,623.28
存出保证金	307,130.85	-	-	-	-	-	307,130.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-179,561,425.91	179,561,425.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,200,556.92	21,200,556.92
应收利息	-	-	-	-	-	17,525.29	17,525.29
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	992.56	992.56
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	89,295,218.89	-	-	-	-	-200,780,500.68	290,075,719.57
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,413,254.17	1,413,254.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	358,677.07	358,677.07
应付托管费	-	-	-	-	-	59,779.51	59,779.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	182,542.10	182,542.10
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	134,244.50	134,244.50
负债总计	-	-	-	-	-	2,148,497.35	2,148,497.35
利率敏感度缺口	89,295,218.89	-	-	-	-	-198,632,003.33	287,927,222.22
上年度末 2016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	36,640,981.50	-	-	-	-	-	36,640,981.50

结算备付金	937,622.46	-	-	-	-	937,622.46
存出保证金	-	-	-	-	113,132.09	113,132.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-262,764,319.22	262,764,319.22
买入返售金融资产	63,000,214.50	-	-	-	-	63,000,214.50
应收利息	-	-	-	-	26,424.76	26,424.76
应收申购款	-	-	-	-	99.40	99.40
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	100,578,818.46	-	-	-	-262,903,975.47	363,482,793.93
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	320,716.53	320,716.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	476,889.07	476,889.07
应付托管费	-	-	-	-	79,481.53	79,481.53
应付交易费用	-	-	-	-	97,779.92	97,779.92
其他负债	-	-	-	-	130,804.64	130,804.64
负债总计	-	-	-	-	1,105,671.69	1,105,671.69
利率敏感度缺口	100,578,818.46	-	-	-	-261,798,303.78	362,377,122.24

注：表中所示为本基金资产及负债的利率风险敞口，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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

本基金管理人合规风控部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临

的市场价格风险。

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	179,561,425.91	62.36	262,764,319.22	72.51
交易性金融资产 - 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 - 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	179,561,425.91	62.36	262,764,319.22	72.51

本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%–95%；投资于智慧医疗主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩基准下跌 1%	-2,303,417.78	-2,097,438.78
	业绩基准下跌 5%	-11,517,088.89	-10,487,193.92
	业绩基准下跌 10%	-23,034,177.78	-20,974,387.84

注：报告期内，本基金 2017 年 beta 值为 0.80，2016 年为 0.58。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	179,561,425.91	61.90
	其中：股票	179,561,425.91	61.90
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	88,988,088.04	30.68
7	其他各项资产	21,526,205.62	7.42
8	合计	290,075,719.57	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	448,634.00	0.16
B	采矿业	3,523,990.31	1.22
C	制造业	122,226,661.13	42.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	272,559.00	0.09
E	建筑业	542,630.00	0.19
F	批发和零售业	16,636,507.34	5.78
G	交通运输、仓储和邮政业	1,137,161.80	0.39
H	住宿和餐饮业	256,740.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,524,094.60	5.39
J	金融业	6,460,849.36	2.24
K	房地产业	6,258,950.56	2.17
L	租赁和商务服务业	1,098,555.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	126,274.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	117,976.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,894,281.92	0.66
R	文化、体育和娱乐业	2,145,435.18	0.75
S	综合	890,125.71	0.31
	合计	179,561,425.91	62.36

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	000423	东阿阿胶	40,700	2,925,923.00	1.02
2	000571	新大洲 A	352,421	2,858,134.31	0.99
3	600050	中国联通	381,000	2,846,070.00	0.99
4	000963	华东医药	56,974	2,831,607.80	0.98
5	601607	上海医药	86,000	2,483,680.00	0.86
6	000028	国药一致	28,708	2,322,477.20	0.81
7	600165	新日恒力	135,800	2,286,872.00	0.79
8	002162	悦心健康	336,181	2,222,156.41	0.77
9	000999	华润三九	69,653	2,211,482.75	0.77
10	002223	鱼跃医疗	91,605	2,169,206.40	0.75
11	000663	永安林业	156,200	2,093,080.00	0.73
12	600085	同仁堂	57,100	1,996,216.00	0.69
13	000813	德展健康	208,302	1,797,646.26	0.62
14	000513	丽珠集团	25,000	1,702,500.00	0.59
15	000656	金科股份	250,600	1,638,924.00	0.57
16	600056	中国医药	61,900	1,606,305.00	0.56
17	002449	国星光电	94,900	1,570,595.00	0.55
18	000782	美达股份	164,600	1,550,532.00	0.54
19	300146	汤臣倍健	110,919	1,524,027.06	0.53
20	000661	长春高新	11,710	1,511,878.10	0.53
21	002030	达安基因	69,050	1,504,599.50	0.52
22	002424	贵州百灵	72,834	1,373,649.24	0.48
23	600076	康欣新材	144,799	1,298,847.03	0.45
24	600867	通化东宝	70,368	1,283,512.32	0.45
25	000938	紫光股份	20,600	1,259,072.00	0.44
26	300003	乐普医疗	56,210	1,242,803.10	0.43
27	002044	美年健康	72,236	1,228,012.00	0.43

28	600276	恒瑞医药	24,231	1,225,846.29	0.43
29	002195	二三四五	171,180	1,223,937.00	0.43
30	000538	云南白药	12,935	1,213,949.75	0.42
31	002294	信立泰	33,686	1,201,242.76	0.42
32	600222	太龙药业	191,800	1,192,996.00	0.41
33	002106	莱宝高科	114,900	1,163,937.00	0.40
34	600223	鲁商置业	248,016	1,155,754.56	0.40
35	000819	岳阳兴长	66,943	1,134,014.42	0.39
36	300158	振东制药	68,341	1,108,491.02	0.38
37	002433	太安堂	119,200	1,102,600.00	0.38
38	600750	江中药业	31,400	1,091,150.00	0.38
39	000413	东旭光电	97,100	1,089,462.00	0.38
40	600764	中电广通	32,600	1,083,950.00	0.38
41	000541	佛山照明	118,282	1,077,549.02	0.37
42	600436	片仔癀	17,150	1,046,836.00	0.36
43	300151	昌红科技	90,334	1,041,551.02	0.36
44	300233	金城医药	48,663	1,021,436.37	0.35
45	000750	国海证券	184,400	1,014,200.00	0.35
46	000806	银河生物	74,400	1,004,400.00	0.35
47	600993	马应龙	45,500	990,990.00	0.34
48	002253	川大智胜	41,100	986,400.00	0.34
49	300298	三诺生物	60,600	985,962.00	0.34
50	002382	蓝帆医疗	77,100	942,933.00	0.33
51	002583	海能达	58,000	933,220.00	0.32
52	002614	奥佳华	51,247	931,670.46	0.32
53	000623	吉林敖东	39,390	901,637.10	0.31
54	300463	迈克生物	35,200	897,600.00	0.31
55	600171	上海贝岭	87,900	893,943.00	0.31
56	600062	华润双鹤	31,700	869,531.00	0.30
57	600572	康恩贝	125,300	867,076.00	0.30
58	600807	天业股份	91,700	864,731.00	0.30
59	600998	九州通	39,827	858,670.12	0.30
60	300401	花园生物	23,100	855,855.00	0.30
61	002376	新北洋	60,700	832,804.00	0.29
62	600161	天坛生物	21,320	827,429.20	0.29
63	300439	美康生物	37,800	812,700.00	0.28
64	002138	顺络电子	43,700	811,946.00	0.28
65	601398	工商银行	152,344	799,806.00	0.28
66	300232	洲明科技	49,600	793,600.00	0.28

67	600055	万东医疗	62,431	786,630.60	0.27
68	002462	嘉事堂	20,000	785,800.00	0.27
69	600216	浙江医药	78,700	779,917.00	0.27
70	000078	海王生物	128,900	777,267.00	0.27
71	000597	东北制药	69,000	771,420.00	0.27
72	300199	翰宇药业	48,100	737,854.00	0.26
73	000050	深天马 A	35,800	736,406.00	0.26
74	300282	汇冠股份	34,500	727,950.00	0.25
75	300109	新开源	15,277	709,769.42	0.25
76	600568	中珠医疗	35,900	704,717.00	0.24
77	300147	香雪制药	68,500	703,495.00	0.24
78	300229	拓尔思	56,500	698,905.00	0.24
79	601939	建设银行	113,400	697,410.00	0.24
80	002635	安洁科技	19,200	695,424.00	0.24
81	300181	佐力药业	100,000	694,000.00	0.24
82	300288	朗玛信息	24,700	687,895.00	0.24
83	300497	富祥股份	12,950	683,630.50	0.24
84	300102	乾照光电	79,300	677,222.00	0.24
85	000989	九芝堂	35,600	674,976.00	0.23
86	000700	模塑科技	82,800	669,852.00	0.23
87	002500	山西证券	67,672	648,297.76	0.23
88	002005	德豪润达	131,283	626,219.91	0.22
89	600614	鹏起科技	56,500	621,500.00	0.22
90	600203	福日电子	72,706	610,003.34	0.21
91	002262	恩华药业	40,256	609,073.28	0.21
92	002142	宁波银行	31,300	604,090.00	0.21
93	000536	华映科技	103,800	603,078.00	0.21
94	300086	康芝药业	57,800	602,276.00	0.21
95	600565	迪马股份	107,100	590,121.00	0.20
96	002655	共达电声	69,000	586,500.00	0.20
97	600240	华业资本	64,100	580,746.00	0.20
98	000540	中天金融	81,400	565,730.00	0.20
99	603368	柳州医药	9,880	565,630.00	0.20
100	600781	辅仁药业	25,900	551,411.00	0.19
101	600351	亚宝药业	69,400	542,708.00	0.19
102	300061	康耐特	29,065	535,377.30	0.19
103	002721	金一文化	35,000	522,550.00	0.18
104	300007	汉威电子	27,000	520,020.00	0.18
105	600797	浙大网新	41,500	514,185.00	0.18

106	000411	英特集团	23,300	509,804.00	0.18
107	300131	英唐智控	60,300	507,726.00	0.18
108	002275	桂林三金	28,500	504,735.00	0.18
109	002644	佛慈制药	54,100	503,130.00	0.17
110	002381	双箭股份	57,500	502,550.00	0.17
111	600201	生物股份	14,100	501,537.00	0.17
112	300188	美亚柏科	29,000	501,410.00	0.17
113	300311	任子行	32,500	498,875.00	0.17
114	002139	拓邦股份	46,200	497,574.00	0.17
115	002415	海康威视	15,400	497,420.00	0.17
116	600360	华微电子	68,500	497,310.00	0.17
117	600410	华胜天成	56,100	497,046.00	0.17
118	300269	联建光电	24,700	494,741.00	0.17
119	002456	欧菲光	27,100	492,407.00	0.17
120	300314	戴维医疗	31,000	490,420.00	0.17
121	300212	易华录	19,300	486,939.00	0.17
122	603508	思维列控	9,200	486,496.00	0.17
123	300077	国民技术	35,500	485,995.00	0.17
124	000153	丰原药业	38,300	479,516.00	0.17
125	600666	奥瑞德	26,720	479,356.80	0.17
126	600195	中牧股份	24,300	471,177.00	0.16
127	600602	云赛智联	62,700	470,877.00	0.16
128	000990	诚志股份	29,400	469,812.00	0.16
129	603578	三星新材	10,200	465,834.00	0.16
130	002512	达华智能	28,400	458,660.00	0.16
131	000555	神州信息	27,000	450,900.00	0.16
132	600881	亚泰集团	88,700	450,596.00	0.16
133	600783	鲁信创投	26,400	449,592.00	0.16
134	600071	凤凰光学	19,200	435,264.00	0.15
135	002055	得润电子	18,900	429,597.00	0.15
136	002393	力生制药	11,900	426,853.00	0.15
137	000988	华工科技	29,000	423,110.00	0.15
138	600332	白云山	14,475	420,354.00	0.15
139	600535	天士力	9,852	409,252.08	0.14
140	603883	老百姓	8,400	408,660.00	0.14
141	000705	浙江震元	39,400	405,820.00	0.14
142	300389	艾比森	27,839	404,779.06	0.14
143	600260	凯乐科技	15,900	402,906.00	0.14
144	002410	广联达	21,400	402,320.00	0.14

145	600664	哈药股份	67,000	389,270.00	0.14
146	002414	高德红外	21,181	387,612.30	0.13
147	600800	天津磁卡	50,200	387,042.00	0.13
148	000997	新大陆	16,900	383,461.00	0.13
149	300357	我武生物	9,300	383,160.00	0.13
150	002550	千红制药	64,000	380,160.00	0.13
151	000688	建新矿业	46,100	368,800.00	0.13
152	600682	南京新百	9,900	365,310.00	0.13
153	300171	东富龙	30,701	358,894.69	0.12
154	002241	歌尔股份	18,600	358,608.00	0.12
155	600068	葛洲坝	31,900	358,556.00	0.12
156	000666	经纬纺机	15,700	357,018.00	0.12
157	300110	华仁药业	37,500	335,250.00	0.12
158	300368	汇金股份	23,000	330,740.00	0.11
159	600061	国投安信	20,300	315,665.00	0.11
160	600030	中信证券	18,000	306,360.00	0.11
161	300119	瑞普生物	21,400	304,736.00	0.11
162	600110	诺德股份	21,600	304,344.00	0.11
163	600079	人福医药	15,400	302,148.00	0.10
164	600037	歌华有线	20,600	299,936.00	0.10
165	300331	苏大维格	13,800	298,770.00	0.10
166	601098	中南传媒	16,000	298,240.00	0.10
167	002696	百洋股份	14,200	296,354.00	0.10
168	600115	东方航空	43,400	295,120.00	0.10
169	002279	久其软件	23,470	294,548.50	0.10
170	300326	凯利泰	31,200	292,968.00	0.10
171	000518	四环生物	37,865	289,667.25	0.10
172	300219	鸿利智汇	21,700	287,742.00	0.10
173	300336	新文化	18,600	287,556.00	0.10
174	002179	中航光电	9,216	287,447.04	0.10
175	300468	四方精创	6,400	285,376.00	0.10
176	603936	博敏电子	10,800	284,580.00	0.10
177	300083	劲胜精密	30,700	283,668.00	0.10
178	002642	荣之联	11,300	283,178.00	0.10
179	600511	国药股份	7,800	282,672.00	0.10
180	300204	舒泰神	18,034	281,150.06	0.10
181	600571	信雅达	20,200	280,780.00	0.10
182	300294	博雅生物	6,800	280,432.00	0.10
183	300353	东土科技	21,600	278,208.00	0.10

184	002782	可立克	13,200	276,540.00	0.10
185	002198	嘉应制药	19,800	269,874.00	0.09
186	002587	奥拓电子	35,550	268,047.00	0.09
187	002389	南洋科技	12,700	267,462.00	0.09
188	600422	昆药集团	23,300	264,222.00	0.09
189	300015	爱尔眼科	11,340	263,768.40	0.09
190	300272	开能环保	26,039	262,212.73	0.09
191	002605	姚记扑克	18,800	262,072.00	0.09
192	000021	深科技	30,403	260,857.74	0.09
193	601007	金陵饭店	22,000	256,740.00	0.09
194	600466	蓝光发展	29,700	256,311.00	0.09
195	600757	长江传媒	34,300	256,221.00	0.09
196	600229	城市传媒	26,900	252,053.00	0.09
197	002100	天康生物	31,233	250,800.99	0.09
198	300162	雷曼股份	23,000	242,190.00	0.08
199	300049	福瑞股份	14,120	238,204.40	0.08
200	600060	海信电器	15,553	235,939.01	0.08
201	600566	济川药业	6,200	235,786.00	0.08
202	002230	科大讯飞	5,900	235,410.00	0.08
203	600557	康缘药业	14,160	235,197.60	0.08
204	002745	木林森	6,188	231,369.32	0.08
205	300479	神思电子	10,800	230,796.00	0.08
206	002649	博彦科技	20,900	230,527.00	0.08
207	600518	康美药业	10,600	230,444.00	0.08
208	603222	济民制药	15,900	230,391.00	0.08
209	002777	久远银海	3,300	229,680.00	0.08
210	300005	探路者	29,100	229,308.00	0.08
211	600703	三安光电	11,500	226,550.00	0.08
212	600790	轻纺城	32,200	219,282.00	0.08
213	002727	一心堂	11,904	219,033.60	0.08
214	601567	三星医疗	20,900	217,778.00	0.08
215	002421	达实智能	35,400	216,648.00	0.08
216	300241	瑞丰光电	16,918	216,212.04	0.08
217	600521	华海药业	10,200	214,608.00	0.07
218	600633	浙数文化	11,000	212,520.00	0.07
219	600183	生益科技	17,200	212,248.00	0.07
220	600271	航天信息	10,156	209,619.84	0.07
221	600835	上海机电	9,900	209,286.00	0.07
222	000719	大地传媒	19,800	206,514.00	0.07

223	002688	金河生物	23,200	206,248.00	0.07
224	600420	现代制药	13,100	205,539.00	0.07
225	601166	兴业银行	12,100	204,006.00	0.07
226	000665	湖北广电	16,700	202,905.00	0.07
227	002104	恒宝股份	21,600	202,824.00	0.07
228	000725	京东方 A	48,600	202,176.00	0.07
229	300415	伊之密	14,000	202,160.00	0.07
230	601099	太平洋	50,200	201,804.00	0.07
231	300207	欣旺达	17,100	201,609.00	0.07
232	000917	电广传媒	17,800	201,140.00	0.07
233	300302	同有科技	11,165	201,081.65	0.07
234	300170	汉得信息	19,500	201,045.00	0.07
235	000802	北京文化	13,800	200,928.00	0.07
236	002049	紫光国芯	6,500	200,330.00	0.07
237	603611	诺力股份	7,600	200,260.00	0.07
238	300347	泰格医药	8,200	198,440.00	0.07
239	002079	苏州固锝	26,800	197,516.00	0.07
240	300071	华谊嘉信	24,200	196,020.00	0.07
241	300213	佳讯飞鸿	21,800	195,982.00	0.07
242	002024	苏宁云商	17,400	195,750.00	0.07
243	002690	美亚光电	10,181	195,271.58	0.07
244	300220	金运激光	10,457	194,604.77	0.07
245	000516	国际医学	34,900	194,393.00	0.07
246	002038	双鹭药业	6,556	191,107.40	0.07
247	002027	分众传媒	13,700	188,512.00	0.07
248	300379	东方通	9,600	188,160.00	0.07
249	600865	百大集团	16,000	187,840.00	0.07
250	603566	普莱柯	7,600	184,376.00	0.06
251	300433	蓝思科技	6,300	183,267.00	0.06
252	000166	申万宏源	32,500	182,000.00	0.06
253	300458	全志科技	6,820	179,638.80	0.06
254	300247	乐金健康	26,900	179,154.00	0.06
255	002365	永安药业	5,900	178,534.00	0.06
256	300410	正业科技	4,916	177,467.60	0.06
257	600104	上汽集团	5,700	176,985.00	0.06
258	300438	鹏辉能源	7,000	176,400.00	0.06
259	600620	天宸股份	13,900	173,055.00	0.06
260	002412	汉森制药	10,900	172,983.00	0.06
261	300202	聚龙股份	10,452	172,667.04	0.06

262	603718	海利生物	12,400	171,368.00	0.06
263	601231	环旭电子	10,869	170,751.99	0.06
264	000728	国元证券	13,700	167,414.00	0.06
265	600269	赣粤高速	31,800	165,678.00	0.06
266	002120	韵达股份	3,200	165,120.00	0.06
267	600426	华鲁恒升	14,030	164,712.20	0.06
268	600887	伊利股份	7,600	164,084.00	0.06
269	002152	广电运通	19,700	163,707.00	0.06
270	600690	青岛海尔	10,800	162,540.00	0.06
271	600808	马钢股份	45,900	162,486.00	0.06
272	600739	辽宁成大	9,000	162,270.00	0.06
273	601211	国泰君安	7,900	162,029.00	0.06
274	600859	王府井	10,000	161,500.00	0.06
275	600642	申能股份	25,200	158,760.00	0.06
276	601318	中国平安	3,200	158,752.00	0.06
277	600763	通策医疗	6,300	158,067.00	0.05
278	000001	平安银行	16,700	156,813.00	0.05
279	600837	海通证券	10,400	154,440.00	0.05
280	002383	合众思壮	9,800	153,566.00	0.05
281	600713	南京医药	21,700	152,551.00	0.05
282	300085	银之杰	8,200	151,700.00	0.05
283	600100	同方股份	10,700	151,084.00	0.05
284	000739	普洛药业	20,400	149,736.00	0.05
285	000501	鄂武商 A	8,080	149,156.80	0.05
286	600487	亨通光电	5,300	148,665.00	0.05
287	600455	博通股份	3,559	148,374.71	0.05
288	002065	东华软件	6,720	146,428.80	0.05
289	600355	精伦电子	16,600	145,084.00	0.05
290	600176	中国巨石	13,100	143,838.00	0.05
291	300075	数字政通	6,800	142,392.00	0.05
292	600153	建发股份	11,000	142,230.00	0.05
293	600809	山西汾酒	4,100	142,229.00	0.05
294	600782	新钢股份	38,800	141,620.00	0.05
295	601872	招商轮船	27,400	141,384.00	0.05
296	601788	光大证券	9,400	140,342.00	0.05
297	603567	珍宝岛	8,264	139,083.12	0.05
298	002105	信隆健康	17,000	137,530.00	0.05
299	600600	青岛啤酒	3,900	136,890.00	0.05
300	600460	士兰微	22,400	135,968.00	0.05

301	600288	大恒科技	12,800	135,680.00	0.05
302	300139	晓程科技	12,900	135,321.00	0.05
303	300032	金龙机电	9,600	133,920.00	0.05
304	600019	宝钢股份	19,800	132,858.00	0.05
305	000004	国农科技	5,140	131,841.00	0.05
306	002626	金达威	9,000	128,250.00	0.04
307	300363	博腾股份	8,350	126,586.00	0.04
308	300496	中科创达	4,400	124,520.00	0.04
309	300366	创意信息	7,406	124,124.56	0.04
310	600231	凌钢股份	37,400	123,420.00	0.04
311	600252	中恒集团	30,400	122,816.00	0.04
312	002369	卓翼科技	13,852	119,681.28	0.04
313	002371	北方华创	5,000	119,600.00	0.04
314	600999	招商证券	6,800	117,096.00	0.04
315	600897	厦门空港	4,600	116,748.00	0.04
316	002544	杰赛科技	5,000	114,000.00	0.04
317	600829	人民同泰	9,122	112,565.48	0.04
318	300384	三联虹普	3,000	111,270.00	0.04
319	002351	漫步者	9,700	107,379.00	0.04
320	000638	万方发展	8,600	106,124.00	0.04
321	600200	江苏吴中	8,000	105,600.00	0.04
322	002086	东方海洋	8,400	105,420.00	0.04
323	002166	莱茵生物	9,400	104,622.00	0.04
324	600479	千金药业	7,200	104,184.00	0.04
325	300166	东方国信	7,695	103,343.85	0.04
326	002332	仙琚制药	12,000	103,200.00	0.04
327	600029	南方航空	11,800	102,660.00	0.04
328	000002	万科 A	4,100	102,377.00	0.04
329	300016	北陆药业	6,700	102,108.00	0.04
330	600512	腾达建设	20,700	102,051.00	0.04
331	603989	艾华集团	2,600	102,024.00	0.04
332	000836	鑫茂科技	16,600	100,430.00	0.03
333	300020	银江股份	7,200	99,648.00	0.03
334	300018	中元股份	11,200	98,448.00	0.03
335	300250	初灵信息	5,600	98,336.00	0.03
336	300296	利亚德	5,200	97,760.00	0.03
337	002551	尚荣医疗	6,040	97,425.20	0.03
338	600188	兖州煤业	7,900	96,696.00	0.03
339	002191	劲嘉股份	10,300	96,408.00	0.03

340	300245	天玑科技	6,900	96,255.00	0.03
341	300516	久之洋	1,500	95,235.00	0.03
342	601339	百隆东方	16,000	95,200.00	0.03
343	300009	安科生物	5,800	95,178.00	0.03
344	603005	晶方科技	3,400	95,166.00	0.03
345	002317	众生药业	7,600	94,392.00	0.03
346	600363	联创光电	6,700	93,867.00	0.03
347	000559	万向钱潮	8,780	93,243.60	0.03
348	002603	以岭药业	5,328	93,026.88	0.03
349	002273	水晶光电	4,500	92,835.00	0.03
350	600385	山东金泰	6,673	92,354.32	0.03
351	002016	世荣兆业	9,600	90,816.00	0.03
352	300295	三六五网	4,800	89,808.00	0.03
353	603000	人民网	6,800	89,556.00	0.03
354	002555	三七互娱	3,500	89,495.00	0.03
355	600227	赤天化	13,500	88,695.00	0.03
356	300251	光线传媒	10,800	88,452.00	0.03
357	601088	中国神华	3,900	86,931.00	0.03
358	000430	张家界	8,100	85,860.00	0.03
359	600109	国金证券	7,000	82,040.00	0.03
360	300024	机器人	4,200	81,900.00	0.03
361	002102	冠福股份	19,100	79,838.00	0.03
362	601009	南京银行	6,900	77,349.00	0.03
363	600273	嘉化能源	8,200	76,916.00	0.03
364	300066	三川智慧	13,700	75,898.00	0.03
365	601688	华泰证券	4,200	75,180.00	0.03
366	600066	宇通客车	3,400	74,698.00	0.03
367	600702	沱牌舍得	2,800	74,508.00	0.03
368	600026	中远海能	11,200	74,256.00	0.03
369	600017	日照港	16,500	74,250.00	0.03
370	600987	航民股份	5,700	73,872.00	0.03
371	600215	长春经开	6,600	72,204.00	0.03
372	300209	天泽信息	2,600	72,072.00	0.03
373	600735	新华锦	6,300	71,190.00	0.02
374	600648	外高桥	3,800	70,376.00	0.02
375	600841	上柴股份	4,600	70,196.00	0.02
376	300462	华铭智能	1,900	69,977.00	0.02
377	300252	金信诺	3,000	69,780.00	0.02
378	600639	浦东金桥	3,800	68,856.00	0.02

379	300039	上海凯宝	9,460	68,774.20	0.02
380	600658	电子城	5,200	67,860.00	0.02
381	603366	日出东方	8,800	67,320.00	0.02
382	600663	陆家嘴	2,800	66,192.00	0.02
383	300217	东方电热	17,800	64,792.00	0.02
384	601601	中国太保	1,900	64,353.00	0.02
385	002153	石基信息	2,794	63,507.62	0.02
386	600759	洲际油气	10,400	63,024.00	0.02
387	601919	中远海控	11,300	60,455.00	0.02
388	000006	深振业 A	6,800	59,908.00	0.02
389	002004	华邦健康	7,600	59,508.00	0.02
390	002222	福晶科技	3,900	55,653.00	0.02
391	002214	大立科技	6,379	55,242.14	0.02
392	002436	兴森科技	8,600	54,180.00	0.02
393	300290	荣科科技	4,900	51,842.00	0.02
394	600028	中国石化	8,500	50,405.00	0.02
395	300050	世纪鼎利	5,000	50,350.00	0.02
396	000090	天健集团	4,500	49,950.00	0.02
397	002380	科远股份	2,700	49,815.00	0.02
398	600373	中文传媒	2,118	49,794.18	0.02
399	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
400	601999	出版传媒	5,200	47,424.00	0.02
401	002439	启明星辰	2,500	46,500.00	0.02
402	002045	国光电器	2,900	46,081.00	0.02
403	300244	迪安诊断	1,462	45,994.52	0.02
404	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
405	600386	北巴传媒	3,400	45,220.00	0.02
406	600734	实达集团	3,500	44,625.00	0.02
407	300255	常山药业	5,100	44,370.00	0.02
408	300136	信维通信	1,100	44,022.00	0.02
409	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
410	002312	*ST 三泰	6,300	42,966.00	0.01
411	002071	长城影视	4,300	42,828.00	0.01
412	600289	亿阳信通	3,800	41,572.00	0.01
413	600015	华夏银行	3,980	36,695.60	0.01
414	600023	浙能电力	6,700	36,582.00	0.01
415	002180	纳思达	1,501	36,264.16	0.01
416	600983	惠而浦	3,325	35,976.50	0.01
417	600018	上港集团	5,600	35,504.00	0.01

418	300498	温氏股份	1,500	35,160.00	0.01
419	600418	江淮汽车	3,300	34,815.00	0.01
420	600350	山东高速	5,600	34,720.00	0.01
421	601901	方正证券	3,400	33,762.00	0.01
422	600011	华能国际	4,400	32,296.00	0.01
423	300172	中电环保	3,100	32,116.00	0.01
424	601633	长城汽车	2,400	31,896.00	0.01
425	000032	深桑达 A	2,000	31,380.00	0.01
426	601018	宁波港	5,400	30,510.00	0.01
427	600283	钱江水利	2,600	30,082.00	0.01
428	002285	世联行	3,600	28,872.00	0.01
429	002543	万和电气	1,100	27,027.00	0.01
430	600016	民生银行	3,100	25,482.00	0.01
431	300289	利德曼	1,500	24,960.00	0.01
432	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
433	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
434	002238	天威视讯	1,900	22,610.00	0.01
435	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
436	002422	科伦药业	1,300	21,476.00	0.01
437	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
438	300657	弘信电子	428	20,158.80	0.01
439	002134	*ST 普林	2,200	19,910.00	0.01
440	600978	宜华生活	1,900	19,095.00	0.01
441	601328	交通银行	3,000	18,480.00	0.01
442	601238	广汽集团	700	18,242.00	0.01
443	600478	科力远	2,050	17,650.50	0.01
444	002206	海利得	2,300	17,089.00	0.01
445	601998	中信银行	2,700	16,983.00	0.01
446	002288	超华科技	2,400	16,728.00	0.01
447	002286	保龄宝	1,309	16,323.23	0.01
448	600048	保利地产	1,600	15,952.00	0.01
449	002242	九阳股份	800	15,736.00	0.01
450	601186	中国铁建	1,300	15,639.00	0.01
451	601668	中国建筑	1,600	15,488.00	0.01
452	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
453	600517	置信电气	2,000	15,140.00	0.01
454	601226	华电重工	2,200	15,004.00	0.01
455	601985	中国核电	1,900	14,839.00	0.01
456	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01

457	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
458	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
459	600895	张江高科	800	13,504.00	0.00
460	000502	绿景控股	1,100	13,288.00	0.00
461	002447	壹桥股份	1,300	11,700.00	0.00
462	600185	格力地产	1,600	10,864.00	0.00
463	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
464	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
465	600555	海航创新	1,900	8,930.00	0.00
466	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
467	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
468	600720	祁连山	700	5,481.00	0.00
469	600033	福建高速	700	2,667.00	0.00
470	600106	重庆路桥	440	2,274.80	0.00
471	000756	新华制药	100	1,518.00	0.00
472	000625	长安汽车	100	1,442.00	0.00
473	000928	中钢国际	100	946.00	0.00
474	000089	深圳机场	100	935.00	0.00
475	000636	风华高科	100	851.00	0.00
476	600716	凤凰股份	100	514.00	0.00

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	002223	鱼跃医疗	5,351,506.40	1.48
2	002614	奥佳华	4,977,694.16	1.37
3	000963	华东医药	4,717,673.40	1.30
4	601398	工商银行	4,704,068.24	1.30
5	600867	通化东宝	4,666,174.00	1.29
6	601939	建设银行	4,569,161.00	1.26
7	002294	信立泰	4,400,166.90	1.21
8	600436	片仔癀	4,110,235.06	1.13
9	002233	塔牌集团	4,053,819.00	1.12
10	002142	宁波银行	3,937,872.80	1.09
11	600238	海南椰岛	3,692,346.95	1.02
12	300247	乐金健康	3,632,019.00	1.00

13	300142	沃森生物	3,631,878.05	1.00
14	300146	汤臣倍健	3,627,137.01	1.00
15	002044	美年健康	3,546,382.37	0.98
16	600572	康恩贝	3,539,158.00	0.98
17	002382	蓝帆医疗	3,528,177.62	0.97
18	000661	长春高新	3,452,369.40	0.95
19	600998	九州通	3,398,332.24	0.94
20	000513	丽珠集团	3,268,784.00	0.90

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	002233	塔牌集团	8,395,550.15	2.32
2	000566	海南海药	6,717,074.82	1.85
3	002294	信立泰	6,358,236.00	1.75
4	600436	片仔癀	6,280,334.20	1.73
5	600566	济川药业	5,996,285.00	1.65
6	002223	鱼跃医疗	5,965,456.65	1.65
7	300142	沃森生物	5,779,994.06	1.60
8	300003	乐普医疗	5,697,809.32	1.57
9	600867	通化东宝	5,692,684.33	1.57
10	002262	恩华药业	5,666,688.60	1.56
11	002390	信邦制药	5,628,488.00	1.55
12	601003	柳钢股份	5,505,778.00	1.52
13	002044	美年健康	5,385,810.92	1.49
14	600572	康恩贝	5,306,323.82	1.46
15	002603	以岭药业	5,294,504.40	1.46
16	002589	瑞康医药	5,138,339.40	1.42
17	002019	亿帆医药	5,088,632.25	1.40
18	002467	二六三	5,083,735.44	1.40
19	002038	双鹭药业	5,081,989.16	1.40
20	600998	九州通	4,991,051.33	1.38

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	711,469,068.91
卖出股票收入（成交）总额	781,430,427.68

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序的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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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	307,130.85
2	应收证券清算款	21,200,556.92
3	应收股利	-
4	应收利息	17,525.29
5	应收申购款	992.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,526,205.62

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	000571	新大洲 A	2,858,134.31	0.99	重大资产重组
2	600050	中国联通	2,846,070.00	0.99	临时停牌
3	600165	新日恒力	2,286,872.00	0.79	重大资产重组
4	002162	悦心健康	2,222,156.41	0.77	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
5,782	54,784.08	2,299,563.15	0.73%	314,461,985.63	99.27%

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（2016年8月11日）基金份额总额	556,759,946.47
本报告期期初基金份额总额	379,636,245.83
本报告期基金总申购份额	1,685,898.87
减：本报告期基金总赎回份额	64,560,595.92
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	316,761,548.78

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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无相关诉讼。

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）。

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		21,489,906,206.58	100.00%	324,767.28	100.00%	-

五矿证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	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

本基金本报告期退租 1 个交易单元：高华证券。

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	1,030,000.00	100.00%	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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 2016 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 1 月 3 日
2	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
3	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）	2017 年 2 月 23 日
4	东吴智慧医疗量化策略灵活配置	中国证券报、证券时报、	2017 年 3 月 27 日

	混合型证券投资基金 2016 年年度报告以及摘要	公司网站	
5	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 29 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 4 月 12 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加奕丰金融服务（深圳）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、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 4 月 12 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 4 月 14 日
9	东吴基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问（北京）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、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 4 月 14 日
10	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）	2017 年 4 月 24 日
11	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 24 日
12	东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份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、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 6 月 7 日
13	东吴基金管理有限公司关于开通旗下东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金在中国农业银行股份有限公司基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 6 月 7 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智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴智慧医疗量化策略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、报告期内东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日