

# 东吴移动互联网灵活配置混合型证券投资基金

## 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东吴移动互联	
场内简称	-	
基金主代码	001323	
交易代码	001323	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	273,904,381.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C
下属分级基金的交易代码：	001323	002170
报告期末下属分级基金的份额总额	273,903,382.57 份	999.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于移动互联主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	中证移动互联网指数 × 50% + 中债综合指数 × 50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	方琦
	联系电话	021-50509888-8308	0755-22168168
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95511 转 3
传真		021-50509888-8211	0755-82080387
注册地址		上海浦东源深路 279 号	广东省深圳市罗湖区深南东路

		5047 号
办公地址	上海浦东源深路 279 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码	200135	518001
法定代表人	王炯	谢永林

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	21,644,022.14	74.84
本期利润	36,152,042.39	115.39
加权平均基金份额本期利润	0.1210	0.1155
本期加权平均净值利润率	11.56%	11.06%
本期基金份额净值增长率	11.93%	11.87%
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	17,764,255.83	82.52
期末可供分配基金份额利润	0.0649	0.0826
期末基金资产净值	300,836,791.72	1,091.50
期末基金份额净值	1.098	1.093
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	9.80%	8.97%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

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

东吴移动互联混合 A

阶段	份额净值增长率	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	4.37%	0.67%	4.17%	0.49%	0.20%	0.18%
过去三个月	2.43%	0.58%	-0.52%	0.49%	2.95%	0.09%
过去六个月	11.93%	0.61%	-1.24%	0.45%	13.17%	0.16%

过去一年	8.71%	0.62%	-6.35%	0.49%	15.06%	0.13%
自基金合同生效起至今	9.80%	0.46%	-26.82%	1.25%	36.62%	-0.79%

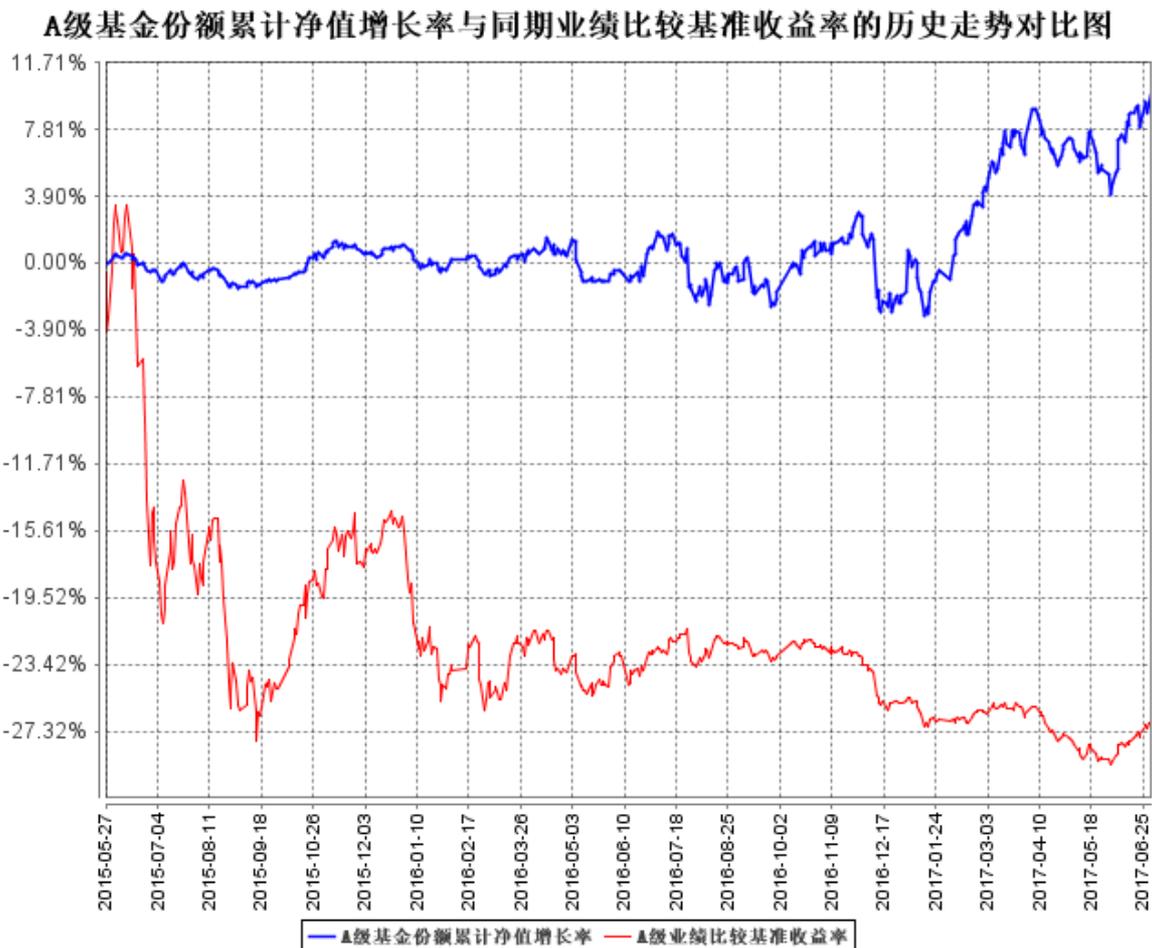
## 东吴移动互联混合 C

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	4.39%	0.66%	4.17%	0.49%	0.22%	0.17%
过去三个月	2.44%	0.57%	-0.52%	0.49%	2.96%	0.08%
过去六个月	11.87%	0.61%	-1.24%	0.45%	13.11%	0.16%
过去一年	8.33%	0.62%	-6.35%	0.49%	14.68%	0.13%
自基金合同生效起至今	8.97%	0.51%	-17.03%	0.86%	26.00%	-0.35%

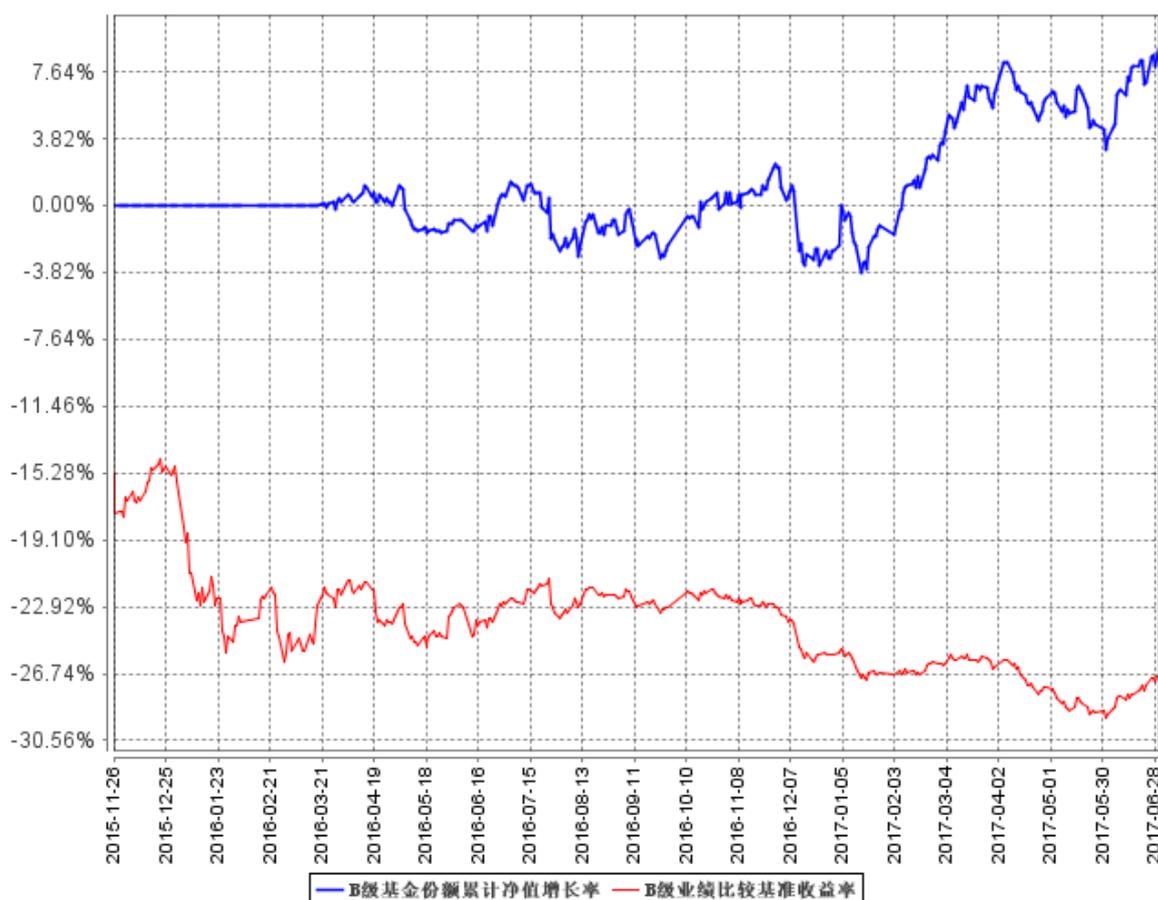
注：1、比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%

2、本基金于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

### 3.2.2 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



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、比较基准=中证移动互联网指数 × 50% + 中债综合指数 × 50%

2、本基金于 2015 年 5 月 27 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，但报告期末距建仓结束不满一年。

3、本基金于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

## § 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		
戴斌	权益投资部副总经理、本基金基金经理	2015 年 5 月 27 日	2017 年 5 月 6 日	10 年	博士，中国人民大学金融学毕业。自 2007 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司一直从事证券投资研究工作，曾任研究部宏观经济、金融工程研究员，产品策划部产品设计研究员，基金经理助理，现任权益投资部副总经理，其中自 2013 年 12 月 24 日起担任东吴新产业混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 12 日起担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 7 月 1 日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金基金经理，自 2015 年 8 月 19 日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理，其中 2015 年 5 月 27 日至 2017 年 5 月 6 日担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
刘元海	绝对收益部总经理、本基金基金经理	2016 年 4 月 27 日	-	12 年	博士，同济大学毕业。2004 年 2 月至 2015 年 6 月就职于东吴基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理等职务，2016 年 2 月再次加入我司，现任绝对收益部总经理，其中自 2016 年 4 月 27 日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 9 日起担任东吴优信稳健债券投资基金基金

					经理。
--	--	--	--	--	-----

注：1、戴斌为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；

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

今年 1 季度 A 股市场出现一波春季躁动行情，给予市场赚钱机会，但最后三大指数（上证指

数、中小板指数、创业板指数)与 4 月上旬见顶回落,上证指数从高点 3300 点最低跌到 5 月 11 日的 3016 点,跌幅近 10%。这波市场下跌主要因素有:1、金融监管速度和力度超出市场预期;2、宏观经济见顶回落。6 月份,市场在一致悲观预期下和政策维稳环境中慢慢筑底并且底部不断抬高。

1 月初,本基金保持较高仓位并以涨价行业配置为主,如白酒、覆铜板产业链等,同时配置估值相对较低的真成长股,如苹果产业链中的白马股。1 季度,本基金把握住春季躁动行情投资机会,获得较好收益。同时在 3 月底至 4 月上旬本基金逐步降低仓位,因此净值躲过了 4 月中下旬市场下跌的负面影响。5 月中下旬开始逐步提高仓位,加仓方向是传媒、新能源汽车、环保、保险等。上半年本基金基本把握住市场节奏,基金净值也创出新高,实现投资者财富保值增值目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴移动互联混合 A 基金份额净值为 1.098 元,累计净值为 1.098 元;本报告期基金份额净值增长率为 11.93%,同期业绩比较基准收益率为-1.24%;截至本报告期末东吴移动互联混合 C 基金份额净值为 1.093 元,累计净值为 1.093 元,本报告期基金份额净值增长率为 11.87%,同期业绩比较基准收益率为-1.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从历史经验看,指数要突破区间震荡格局必须是中国股市制度或者经济制度出现重大改革(风险偏好提升)或者中国经济进入新一轮景气周期(企业盈利改善)或者货币政策进入宽松周期(无风险利率下降)。但至少从下半年看,以上这些因素向好趋势还看不到,反而目前货币政策中性偏紧,金融在去杠杆和挤泡沫,经济回升力度有限,这些不利因素将限制 A 股市场上行高度。我们对 A 股市场也不悲观,今年是十九大换届政治年,一切以稳为先,出现股灾概率较小。我们整体判断,下半年 A 股市场仍然处于区间震荡。

从市场风格看,下半年市场风格可能偏向成长股。目前一些优质白马蓝筹股 2017 年动态 pe 已经修复到 30 倍左右甚至更高。我们判断,对于一些成长性在 20%左右大白马蓝筹而言,当估值修复到 30 倍左右时,未来这些公司股价上涨可能更多是赚业绩增长的钱,估值提升也许已经见顶。

反观一些优质二线成长股,如果它们今年动态 pe 在 25 倍左右,未来两年能够保持 30%左右甚至更高增长,现在买入持有这些真成长公司到明年,我们或许能够赚到估值提升加业绩增长的钱。整体看,现在时点买入优质二线成长股,风险收益比可能更高。也即,下半年市场风格会从 2 季度“一九”逐步扩散到“二八”甚至“三七”等。

从投资方向看，短期内，毕竟现在市场仍然比较谨慎，业绩增长确定性是首位，因此要关注中报业绩快速增长甚至超预期增长的行业和公司。行业上，下半年相对看好传媒、新能源汽车、环保、保险、建筑、医药商业等。同时对于具有中国制造优势和受益消费升级的白马蓝筹股，只要价格合适，可以适当配置，以赚取业绩增长的钱，获取绝对收益。

本基金投资目标是，希望通过新股申购以及把握中级别以上行情和精选个股，为投资者财富追求长期稳定的投资回报。

#### 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

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由东吴基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	95,130,047.32	62,444,389.09
结算备付金		1,183,987.38	1,561,877.08
存出保证金		644,315.19	808,432.95
交易性金融资产	6.4.7.2	181,893,737.81	268,900,642.90
其中：股票投资		181,893,737.81	249,057,642.90
基金投资		-	-
债券投资		-	19,843,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	30,070,135.04	-
应收证券清算款		-	3,286,995.66
应收利息	6.4.7.5	25,867.76	332,483.34
应收股利		-	-
应收申购款		362,102.36	988.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		309,310,192.86	337,335,809.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,078,609.42	873,445.55
应付赎回款		5,304,220.96	410,535.96
应付管理人报酬		379,583.38	443,023.08
应付托管费		63,263.91	73,837.22
应付销售服务费		0.30	0.31
应付交易费用	6.4.7.7	557,356.22	861,377.48

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	89,275.45	180,771.67
负债合计		8,472,309.64	2,842,991.27
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	273,904,381.57	341,134,743.35
未分配利润	6.4.7.10	26,933,501.65	-6,641,925.46
所有者权益合计		300,837,883.22	334,492,817.89
负债和所有者权益总计		309,310,192.86	337,335,809.16

注：本基金为分级基金，报告截止日 2017 年 6 月 30 日，份额总额为 273,904,381.57 份，其中东吴移动互联混合 A 基金份额净值 1.098 元，基金份额总额 273,903,382.57 份；东吴移动互联混合 C 基金份额净值 1.093 元，基金份额总额 999.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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
<b>一、收入</b>		41,481,463.95	4,552,979.49
1.利息收入		703,576.79	6,188,829.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	532,111.56	4,042,438.63
债券利息收入		126,974.54	7,069.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		44,490.69	2,139,321.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,202,404.43	-15,404,389.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,471,514.22	-15,957,397.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-46,251.90	89,215.06
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	777,142.11	463,793.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	14,508,060.80	13,390,043.50

4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	67,421.93	378,496.04
<b>减：二、费用</b>		5,329,306.17	8,304,751.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,328,092.60	5,652,563.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	388,015.44	942,093.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1.81	1.04
4. 交易费用	6.4.7.19	2,505,636.17	1,597,613.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	107,560.15	112,479.84
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		36,152,157.78	-3,751,772.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		36,152,157.78	-3,751,772.06

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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)	341,134,743.35	-6,641,925.46	334,492,817.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	36,152,157.78	36,152,157.78
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)	-67,230,361.78	-2,576,730.67	-69,807,092.45
其中：1. 基金申购款	51,054,104.69	3,666,485.40	54,720,590.09
2. 基金赎回款	-118,284,466.47	-6,243,216.07	-124,527,682.54

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)	273,904,381.57	26,933,501.65	300,837,883.22
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)	929,889,791.86	10,400,680.44	940,290,472.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,751,772.06	-3,751,772.06
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)	-329,907,382.90	-644,709.23	-330,552,092.13
其中：1.基金申购款	1,105,364.17	0.66	1,105,364.83
2.基金赎回款	-331,012,747.07	-644,709.89	-331,657,456.96
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)	599,982,408.96	6,004,199.15	605,986,608.11

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

东吴移动互联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

委员会证监许可[2015]795 号文《关于准予东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准向社会公开发行募集，募集期为 2015 年 5 月 18 日至 2015 年 5 月 22 日。经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，首次募集的净认购金额为人民币 2,402,939,059.71 元，利息为 140,142.37 人民币元，首次募集有效认购户数为 16,528 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本息合计募集基金份额总额为 2,403,079,202.08 份。经向中国证监会备案，本基金合同于 2015 年 5 月 27 日正式生效。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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，投资于移动互联主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《东吴移动互联灵活配置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 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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

### 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	95,130,047.32
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	95,130,047.32

### 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	172,547,497.45	181,893,737.81	9,346,240.36
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	172,547,497.45	181,893,737.81	9,346,240.36
----	----------------	----------------	--------------

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_银行间	30,070,135.04	-
合计	30,070,135.04	-

#### 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	22,536.07
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	479.52
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	2,591.26
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	260.91
合计	25,867.76

### 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	556,847.38
银行间市场应付交易费用	508.84
合计	557,356.22

## 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	15.30
预提信息披露费	49,588.57
预提审计费	39,671.58
合计	89,275.45

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴移动互联混合 A		
项目	本期 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	341,133,744.35	341,133,744.35
本期申购	51,054,104.69	51,054,104.69
本期赎回(以“-”号填列)	-118,284,466.47	-118,284,466.47
- 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	273,903,382.57	273,903,382.57

金额单位：人民币元

东吴移动互联混合 C	
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	999.00	999.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	999.00	999.00

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东吴移动互联混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,171,525.03	-2,470,377.54	-6,641,902.57
本期利润	21,644,022.14	14,508,020.25	36,152,042.39
本期基金份额交易产生的变动数	291,758.72	-2,868,489.39	-2,576,730.67
其中：基金申购款	3,411,382.65	255,102.75	3,666,485.40
基金赎回款	-3,119,623.93	-3,123,592.14	-6,243,216.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,764,255.83	9,169,153.32	26,933,409.15

单位：人民币元

东吴移动互联混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7.68	-30.57	-22.89
本期利润	74.84	40.55	115.39
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82.52	9.98	92.50

#### 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	512,532.56
定期存款利息收入	1,691.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,656.85
其他	6,230.48
合计	532,111.56

#### 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	867,172,041.24
减：卖出股票成本总额	841,700,527.02
买卖股票差价收入	25,471,514.22

#### 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	20,210,718.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,813,803.67
减：应收利息总额	443,167.06
买卖债券差价收入	-46,251.90

##### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017年1月1日至2017年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-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	777,142.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	777,142.11

#### 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	14,508,060.80
——股票投资	14,537,257.13
——债券投资	-29,196.33
——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	14,508,060.80

#### 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	67,276.75
转换费收入 001323	145.18
合计	67,421.93

#### 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	2,505,461.17
银行间市场交易费用	175.00
合计	2,505,636.17

#### 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	39,671.58
信息披露费	49,588.57
其他费用	300.00
帐户维护费	18,000.00
合计	107,560.15

### 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
中国平安银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	675,184,319.61	41.58%	918,281,020.47	80.14%

#### 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	4,898,825.21	50.37%	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	-	-	6,269,600,000.00	64.57%

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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
东吴证券股份有限公司	618,008.67	41.36%	-	-
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
东吴证券股份有限公司	845,028.88	80.08%	747,740.19	78.05%

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。

#### 6.4.10.2 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	2,328,092.60	5,652,563.62
其中：支付销售机构的客户维护费	862,251.11	2,235,774.34

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 × 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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	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	388,015.44	942,093.93

注：支付基金托管人平安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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	1.81	1.81
合计	-	1.81	1.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	1.04	1.04
合计	1.04	1.04	-

注：本基金自 2015 年 11 月 26 日实施 A、C 分类，其中 A 类不收取销售服务费，C 类收取销售服务费。C 类销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.2% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X0.2%/当年天数。

#### 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

注：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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		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
中国平安银行股份有限公司	95,130,047.32	512,532.56	292,756,327.23	818,996.49

#### 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

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	-
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	-

#### 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
300145	中金环境	2017年6月28日	重大资产重组停牌	16.92	-	-	458,000	6,971,973.08	7,749,360.00	-

#### 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

本基金为混合型型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

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

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

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指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 - 平安银行股份有限公司。本基金认为与平安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风险管理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 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
<b>资产</b>							
银行存款	95,130,047.32	-	-	-	-	-	95,130,047.32
清算备付金	1,183,987.38	-	-	-	-	-	1,183,987.38
存出保证金	644,315.19	-	-	-	-	-	644,315.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-181,893,737.81	181,893,737.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	30,070,135.04	-	-	-	-	-	30,070,135.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	25,867.76	25,867.76
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	362,102.36	362,102.36
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	127,028,484.93	-	-	-	-	-182,281,707.93	309,310,192.86
<b>负债</b>							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,078,609.42	2,078,609.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,304,220.96	5,304,220.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	379,583.38	379,583.38
应付托管费	-	-	-	-	-	63,263.91	63,263.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.30	0.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	557,356.22	557,356.22
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	89,275.45	89,275.45
负债总计	-	-	-	-	-	8,472,309.64	8,472,309.64
利率敏感度缺口	127,028,484.93	-	-	-	-	-173,809,398.29	300,837,883.22
<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>							
<b>资产</b>							
银行存款	62,444,389.09	-	-	-	-	-	62,444,389.09
清算备付金	1,561,877.08	-	-	-	-	-	1,561,877.08
存出保证金	808,432.95	-	-	-	-	-	808,432.95
交易性金融资产	-	-10,039,000.00	-	-9,804,000.00	-	-249,057,642.90	268,900,642.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-	3,286,995.66	3,286,995.66
应收利息	-	-	-	-	332,483.34	332,483.34
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	988.14	988.14
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	64,814,699.12	10,039,000.00	-9,804,000.00	-	-252,678,110.04	337,335,809.16
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	873,445.55	873,445.55
应付赎回款	-	-	-	-	410,535.96	410,535.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	443,023.08	443,023.08
应付托管费	-	-	-	-	73,837.22	73,837.22
应付销售服务费	-	-	-	-	0.31	0.31
应付交易费用	-	-	-	-	861,377.48	861,377.48
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	180,771.67	180,771.67
负债总计	-	-	-	-	2,842,991.27	2,842,991.27
利率敏感度缺口	64,814,699.12	10,039,000.00	-9,804,000.00	-	-249,835,118.77	334,492,817.89

#### 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	-	108,409.60
	利率上升 25 个基点	-	-106,991.04

#### 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。本基金管理人风险管理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	181,893,737.81	60.46	249,057,642.90	74.46
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	181,893,737.81	60.46	249,057,642.90	74.46

本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，投资于移动互联主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 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）
	1. 业绩基准下跌 1%	-3,249,049.14	-945,945.69
2. 业绩基准下跌 5%	-16,245,245.69	-4,729,728.44	

	3. 业绩基准下跌 10%	-32,490,491.39	-9,459,456.89
--	---------------	----------------	---------------

注：报告期内，本基金 2017 年 beta 值为 1.08，2016 年为 0.28。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无其他需要说明的重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	181,893,737.81	58.81
	其中：股票	181,893,737.81	58.81
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	30,070,135.04	9.72
	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	96,314,034.70	31.14
7	其他各项资产	1,032,285.31	0.33
8	合计	309,310,192.86	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	77,018,971.67	25.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,222,420.30	4.40
F	批发和零售业	7,954,257.75	2.64
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	32,004,505.09	10.64
J	金融业	14,031,200.00	4.66
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,002,500.00	2.33
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	30,659,883.00	10.19
S	综合	-	-
	合计	181,893,737.81	60.46

### 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	600183	生益科技	1,600,000	19,744,000.00	6.56
2	000892	欢瑞世纪	1,185,100	11,886,553.00	3.95
3	600110	诺德股份	700,920	9,875,962.80	3.28
4	002343	慈文传媒	258,000	9,767,880.00	3.25
5	300336	新文化	582,500	9,005,450.00	2.99
6	601336	新华保险	168,000	8,635,200.00	2.87
7	002174	游族网络	268,000	8,511,680.00	2.83
8	603368	柳州医药	138,939	7,954,257.75	2.64
9	600884	杉杉股份	478,400	7,879,248.00	2.62
10	300145	中金环境	458,000	7,749,360.00	2.58
11	600491	龙元建设	700,000	7,511,000.00	2.50
12	300203	聚光科技	260,000	7,311,200.00	2.43
13	002555	三七互娱	280,300	7,167,271.00	2.38
14	002340	格林美	1,180,000	7,139,000.00	2.37
15	002624	完美世界	200,000	6,860,000.00	2.28
16	000997	新大陆	280,000	6,353,200.00	2.11
17	300237	美晨科技	330,905	5,711,420.30	1.90
18	601628	中国人寿	200,000	5,396,000.00	1.79
19	603799	华友钴业	88,000	5,348,640.00	1.78

20	000823	超声电子	350,000	5,047,000.00	1.68
21	300070	碧水源	250,000	4,662,500.00	1.55
22	300476	胜宏科技	160,000	3,780,800.00	1.26
23	601599	鹿港文化	500,000	3,130,000.00	1.04
24	300033	同花顺	49,907	3,104,714.47	1.03
25	603588	高能环境	150,000	2,340,000.00	0.78
26	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
27	300671	富满电子	942	7,639.62	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	002739	万达电影	37,468,122.66	11.20
2	600977	中国电影	27,713,626.95	8.29
3	600068	葛洲坝	26,268,400.54	7.85
4	002340	格林美	24,213,371.76	7.24
5	300203	聚光科技	23,134,271.32	6.92
6	000630	铜陵有色	21,554,000.00	6.44
7	600491	龙元建设	21,205,205.70	6.34
8	601336	新华保险	19,247,635.12	5.75
9	601186	中国铁建	17,919,627.00	5.36
10	600110	诺德股份	17,755,182.83	5.31
11	300237	美晨科技	17,268,858.60	5.16
12	300383	光环新网	15,553,500.59	4.65
13	300145	中金环境	15,550,475.17	4.65
14	002310	东方园林	14,916,533.69	4.46
15	002174	游族网络	14,840,497.89	4.44
16	002636	金安国纪	14,063,775.65	4.20
17	601800	中国交建	13,569,626.28	4.06
18	002439	启明星辰	13,442,604.62	4.02
19	600183	生益科技	12,542,481.02	3.75
20	601766	中国中车	12,309,072.00	3.68
21	002555	三七互娱	12,240,010.39	3.66

22	000892	欢瑞世纪	12,140,712.36	3.63
23	002624	完美世界	11,784,417.23	3.52
24	603328	依顿电子	11,420,621.54	3.41
25	600261	阳光照明	11,272,948.04	3.37
26	000997	新大陆	11,127,961.23	3.33
27	600028	中国石化	10,468,000.00	3.13
28	002343	慈文传媒	10,307,934.90	3.08
29	000823	超声电子	9,900,914.45	2.96
30	603799	华友钴业	9,787,120.20	2.93
31	002195	二三四五	9,625,008.19	2.88
32	300476	胜宏科技	9,024,769.00	2.70
33	601628	中国人寿	8,969,365.20	2.68
34	601668	中国建筑	8,922,572.00	2.67
35	300070	碧水源	8,869,405.00	2.65
36	300033	同花顺	8,542,325.62	2.55
37	300336	新文化	8,466,731.37	2.53
38	600884	杉杉股份	8,297,250.31	2.48
39	600562	国睿科技	8,239,825.35	2.46
40	603588	高能环境	8,181,066.44	2.45
41	601599	鹿港文化	8,161,533.99	2.44
42	600122	宏图高科	7,855,968.98	2.35
43	002573	清新环境	7,747,106.48	2.32
44	603368	柳州医药	7,316,600.30	2.19
45	601390	中国中铁	7,164,000.00	2.14
46	000423	东阿阿胶	6,940,295.00	2.07
47	002236	大华股份	6,881,397.28	2.06
48	300078	思创医惠	6,745,585.28	2.02

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	002739	万达电影	37,088,247.95	11.09

2	600068	葛洲坝	27,758,875.00	8.30
3	000630	铜陵有色	27,008,730.58	8.07
4	600977	中国电影	26,465,430.07	7.91
5	600183	生益科技	24,004,027.17	7.18
6	002636	金安国纪	23,416,112.65	7.00
7	300203	聚光科技	22,995,939.13	6.87
8	002368	太极股份	20,024,206.89	5.99
9	002439	启明星辰	19,881,329.58	5.94
10	601186	中国铁建	18,048,993.21	5.40
11	300183	东软载波	17,751,370.80	5.31
12	000823	超声电子	17,065,128.93	5.10
13	300033	同花顺	16,909,417.17	5.06
14	002340	格林美	16,575,176.00	4.96
15	002310	东方园林	16,444,064.00	4.92
16	300383	光环新网	16,026,986.14	4.79
17	600110	诺德股份	15,589,933.70	4.66
18	000858	五粮液	15,259,695.86	4.56
19	000568	泸州老窖	14,497,040.32	4.33
20	002475	立讯精密	14,309,155.88	4.28
21	600519	贵州茅台	14,270,327.49	4.27
22	600643	爱建集团	13,681,700.48	4.09
23	601800	中国交建	13,586,412.00	4.06
24	600109	国金证券	13,327,746.00	3.98
25	600491	龙元建设	12,743,957.12	3.81
26	300237	美晨科技	12,675,873.71	3.79
27	601766	中国中车	12,321,290.53	3.68
28	603328	依顿电子	11,720,235.15	3.50
29	600261	阳光照明	11,300,670.85	3.38
30	002241	歌尔股份	10,781,708.98	3.22
31	601336	新华保险	10,756,335.39	3.22
32	600028	中国石化	10,494,000.00	3.14
33	600999	招商证券	10,209,335.00	3.05
34	300145	中金环境	9,675,915.43	2.89
35	300078	思创医惠	9,394,140.25	2.81
36	600820	隧道股份	9,247,487.02	2.76
37	601668	中国建筑	9,072,000.00	2.71
38	600562	国睿科技	8,593,209.09	2.57
39	002195	二三四五	8,495,908.72	2.54

40	000028	国药一致	8,267,996.42	2.47
41	002573	清新环境	8,172,279.41	2.44
42	300207	欣旺达	7,797,282.36	2.33
43	600122	宏图高科	7,777,279.00	2.33
44	002236	大华股份	7,708,261.03	2.30
45	601688	华泰证券	7,463,897.48	2.23
46	000423	东阿阿胶	7,291,721.77	2.18
47	000538	云南白药	7,140,978.24	2.13
48	601390	中国中铁	7,134,975.40	2.13
49	002174	游族网络	6,711,908.08	2.01

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	759,999,364.80
卖出股票收入（成交）总额	867,172,041.24

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	644,315.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,867.76
5	应收申购款	362,102.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,032,285.31

## 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	300145	中金环境	7,749,360.00	2.58	重大资产重组停牌

## 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东吴移动互联网混合 A	3,159	86,705.72	46,666,199.96	17.04%	227,237,182.61	82.96%
东吴移动互联网混合 C	1	999.00	0.00	0.00%	999.00	100.00%
合计	3,160	86,678.60	46,666,199.96	17.04%	227,238,181.61	82.96%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴移动互联网混合 A	3,832.63	0.0000%
	东吴移动互联网混合 C	999.00	100.0000%
	合计	4,831.63	0.0000%

### 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、基金投资和研发部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴移动互联混 合 A	东吴移动互联混 合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 27 日）基金份 额总额	2,403,079,202.08	-
本报告期期初基金份额总额	341,133,744.35	999.00
本报告期基金总申购份额	51,054,104.69	-
减：本报告期基金总赎回份额	118,284,466.47	-
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	273,903,382.57	999.00

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无相关诉讼。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东吴证券	2	675,184,319.61	41.58%	618,008.67	41.36%	-
天风证券	2	525,917,010.99	32.38%	489,788.46	32.78%	-
光大证券	1	380,213,874.77	23.41%	346,489.86	23.19%	-
国信证券	1	42,697,857.36	2.63%	39,764.11	2.66%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

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

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期增加 1 个华创证券交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	4,898,825.21	50.37%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	4,827,520.66	49.63%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

## 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	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	上海证券报、公司网站	2017 年 1 月 10 日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、公司网站	2017 年 1 月 18 日
4	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2017 年 1 月 21 日
5	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
6	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告以及摘要	上海证券报、公司网站	2017 年 3 月 27 日
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1	上海证券报、公司网站	2017 年 4 月 24 日

	季度报告		
13	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国农业银行股份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	上海证券报、公司网站	2017 年 4 月 28 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司申购及定投费率优惠的公告	上海证券报、公司网站	2017 年 4 月 28 日
15	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站	2017 年 5 月 6 日
16	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
17	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行股份有限公司基金定投及电子银行渠道申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 6 月 10 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人处、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