

东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金  
金  
(原东吴配置优化混合型证券投资基金  
)  
2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一八年一月十九日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2018 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 12 月 25 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。（注：东吴配置优化混合型证券投资基金报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 2017 年 12 月 24 日止）。

## §2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东吴配置优化混合
场内简称	-
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 25 日
报告期末基金份额总额	180,720,088.44 份
投资目标	本基金根据不同市场情况变化，对股票、债券及其他投资品种的配置进行优化调整，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金在严格风险控制的基础上，追求稳健收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

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

转型前：

基金简称	东吴配置优化混合
场内简称	-
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 19 日
报告期末基金份额总额	181,072,205.13 份
投资目标	本基金主要投资于具有持续竞争优势的企业，追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金在严格风险控制的基础上，追求稳健收益。
业绩比较基准	60%*沪深 300 指数+40%*中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。
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

注：上表中“报告期末”为 2017 年 12 月 24 日。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 12 月 25 日 — 2017 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	35,214.75
2. 本期利润	-660,499.52
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0037
4. 期末基金资产净值	213,959,565.18
5. 期末基金份额净值	1.1839

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年10月1日—2017年12月24日）
1. 本期已实现收益	17,832,042.21
2. 本期利润	11,120,734.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0612
4. 期末基金资产净值	215,036,841.52
5. 期末基金份额净值	1.1880

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、所列数据截止到 2017 年 12 月 24 日。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

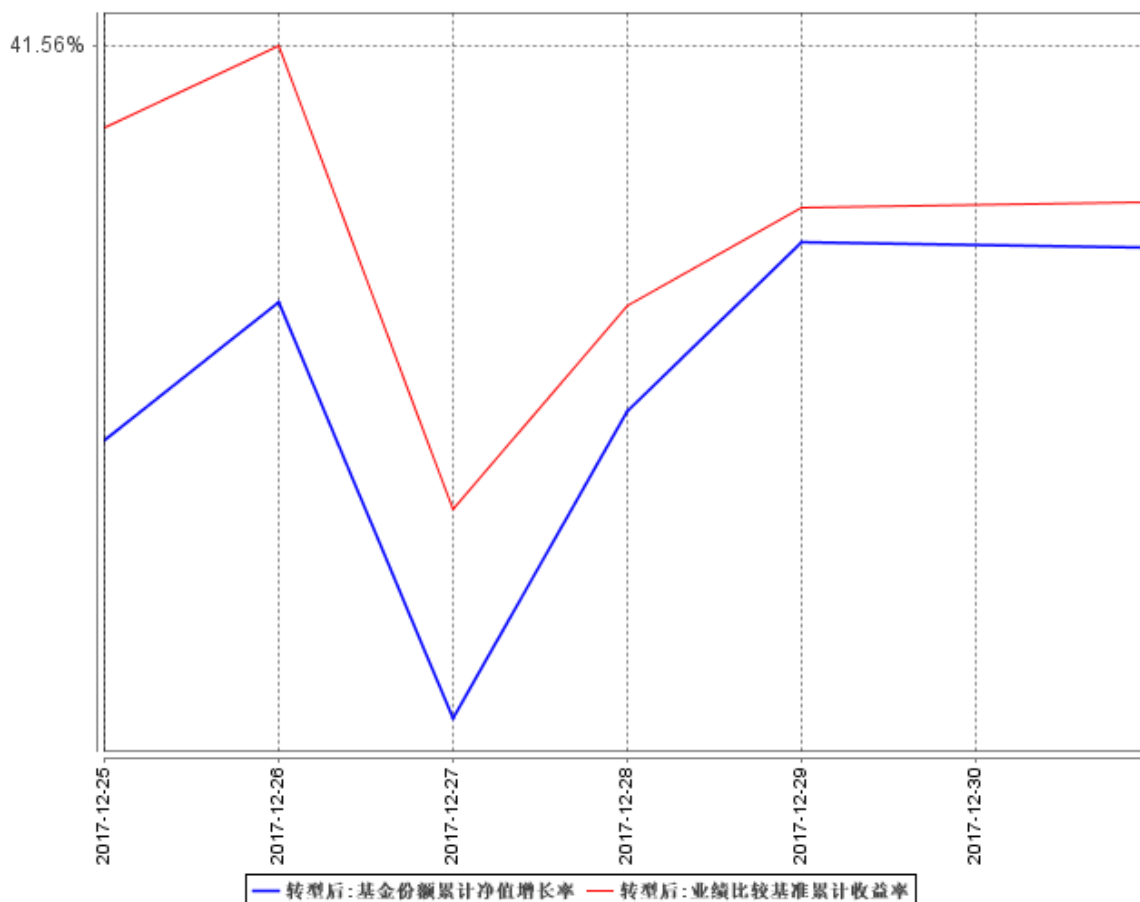
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
自合同生效 以来	-0.35%	0.52%	-0.28%	0.40%	-0.07%	0.12%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率\*50%+中国债券综合全价指数收益率\*50%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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. 业绩比较基准=沪深 300 指数收益率\*50%+中国债券综合全价指数收益率\*50%

2. 东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金由东吴配置优化混合型证券投资基金变更而来，变更日期为 2017 年 12 月 25 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末仍处于建仓期。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

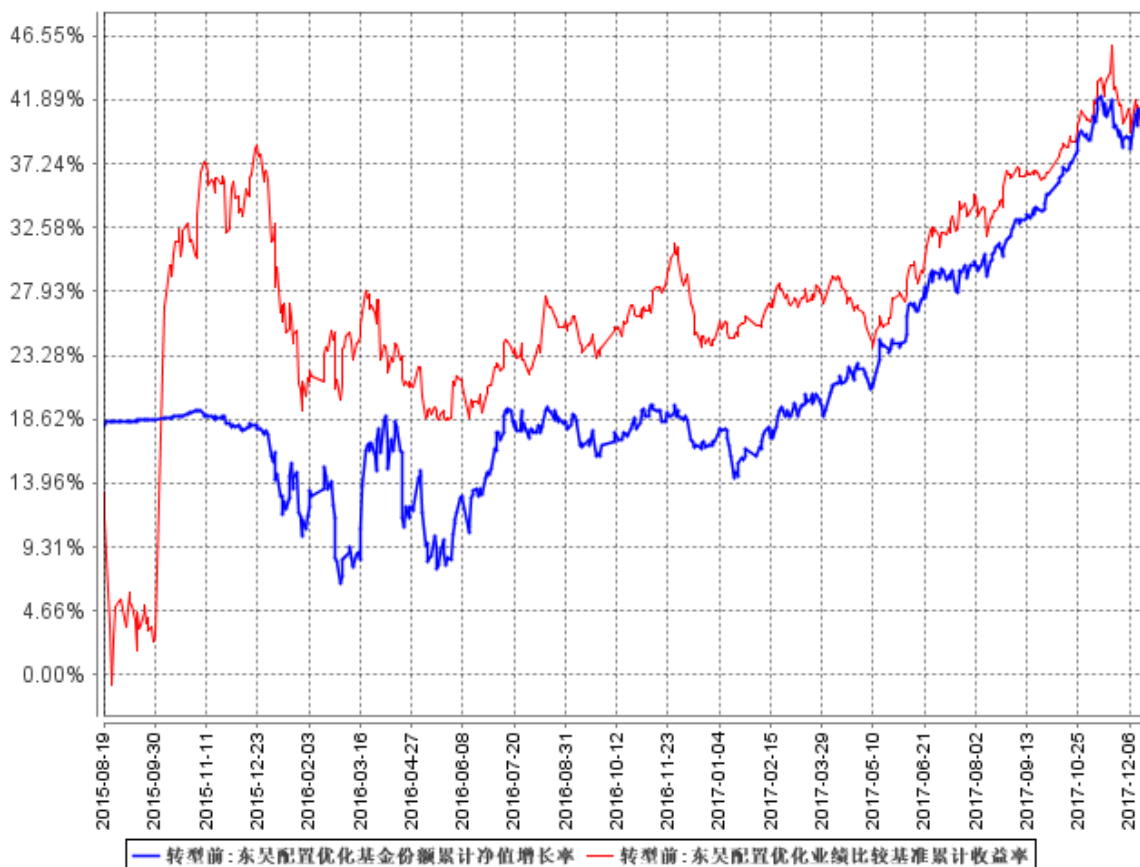
### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	4.86%	0.47%	2.94%	0.48%	1.92%	-0.01%

注：业绩比较基准=60%\*沪深 300 指数+40%\*中国债券综合全价指数

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东吴配置优化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：业绩比较基准=60%\*沪深 300 指数+40%\*中国债券综合全价指数

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨庆定	固定收益总监、固定收益部总经理、本基金基金经理	2015年8月19日	-	11年	博士，上海交通大学管理专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公

				<p>司高级投资经理； 2007 年 7 月至 2010 年 6 月期间任 东吴基金管理有限公司 研究员、基金经理 助理；2013 年 4 月 再次加入东吴基金管 理有限公司，现担任 公司固定收益总监、 固定收益部总经理， 其中自 2015 年 6 月 8 日起担任东吴鼎利 债券型证券投资基金 (LOF) (原东吴鼎 利分级债券型证券投 资基金) 基金经理、 自 2014 年 5 月 9 日 起担任东吴中证可转 换债券指数分级证券 投资基金基金经理、 自 2014 年 6 月 28 日 起担任东吴优信稳健 债券型证券投资基金 基金经理、自 2015 年 8 月 19 日任 东吴配置优化灵活配 置混合型证券投资基金 (原东吴配置优化 混合型证券投资基金) ，自 2016 年 5 月 19 日起担任东吴鼎 元双债债券型证券投 资基金基金经理。</p>
赵梅玲	本基金基金 经理	2016 年 5 月 10 日	-	<p>9 年</p> <p>硕士，2007 年 7 月 至 2012 年 6 月就职 于安信证券股份有限 公司，任行业分析师， 2012 年 7 月加入东 吴基金管理有限公司， 一直从事投资研究工 作，曾任研究员、基 金经理助理，现任东 吴配置优化灵活配置 混合型证券投资基金 (原东吴配置优化混</p>

					合型证券投资基金) 基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------

注：1、2015 年 8 月 19 日为合同生效日，其余任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨庆定	固定收益总监、固定收益部总经理、本基金基金经理	2017 年 12 月 25 日	-	11 年	博士，上海交通大学管理专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理；2007 年 7 月至 2010 年 6 月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理；2013 年 4 月再次加入东吴基金管理有限公司，现担任公司固定收益总监、固定收益部总经理，其中自 2015 年 6 月 8 日起担任东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）（原东吴鼎利分级债券型证券投资基金）基金经理、自 2014 年 5 月 9 日起担任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金经理、自 2014 年 6 月 28 日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 8 月 19 日任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（原东吴配置优化



					混合型证券投资基金)，自 2016 年 5 月 19 日起担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理。
赵梅玲	本基金基金经理	2017 年 12 月 25 日	-	9 年	硕士，2007 年 7 月至 2012 年 6 月就职于安信证券股份有限公司，任行业分析师，2012 年 7 月加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，现任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（原东吴配置优化混合型证券投资基金）基金经理。

注：1、此处的任职日期为基金合同生效日；

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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 4 季度，市场进入业绩真空期，但高企的利率水平导致 A 股市场经历剧烈的估值调整，今年涨幅靠前的白酒、家电、消费电子、通信等板块调整明显，而且由于市场二八分化现象，

尽管上证指数从高点仅回落 200 点，但热门板块龙头公司均有 10%-20%的调整。

本基金在报告期内基于对市场变化的判断调整仓位，积极控制风险，增加地产、钢铁、石化等低估值周期龙头的持仓，适当降低消费电子、家电持仓比例，整体维持中性仓位不变，一定程度平抑了资产组合的波动性。

资产配置方面，我们维持中性仓位，分散行业配置。相对看好盈利持续改善的国有银行和保险公司，以及与经济增长关系相关性较弱的必须消费品，等待利率出现拐点时，代表新经济增长方向的 TMT 和高端智能制造等行业将迎来新的配置时点。

需要警惕的风险是：（1）地缘政治带来油价超预期上涨引发通胀；（2）美国税改对我国制造业升级带来的挑战。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.1839 元，累计净值 1.4079 元；本报告期内本基金转型前份额净值增长率 4.86%，同期业绩比较基准收益率为 2.94%，转型后份额净值增长率-0.35%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	137,155,805.09	63.76
	其中：股票	137,155,805.09	63.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,726,084.10	18.00
	其中：债券	38,726,084.10	18.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,000,000.00	9.30
	其中：买断式回购的买入返售金融	-	-

	资产		
7	银行存款和结算备付金合计	7,322,606.71	3.40
8	其他资产	11,920,161.72	5.54
9	合计	215,124,657.62	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,484,552.00	1.16
B	采矿业	5,534,147.00	2.59
C	制造业	60,401,877.35	28.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,845,349.20	4.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,682,033.96	5.93
G	交通运输、仓储和邮政业	13,330,687.96	6.23
H	住宿和餐饮业	2,716,557.70	1.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,307,692.30	3.42
J	金融业	9,923,374.40	4.64
K	房地产业	2,679,720.00	1.25
L	租赁和商务服务业	2,587,904.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.02
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	7,629,586.02	3.57
S	综合	-	-
	合计	137,155,805.09	64.10

### 5.2.2 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	26,400	4,058,208.00	1.90
2	601899	紫金矿业	635,700	2,917,863.00	1.36
3	600176	中国巨石	177,900	2,897,991.00	1.35
4	000022	深赤湾A	118,500	2,860,590.00	1.34
5	601766	中国中车	229,962	2,784,839.82	1.30

6	600754	锦江股份	84,130	2,716,557.70	1.27
7	000028	国药一致	44,961	2,708,900.25	1.27
8	601333	广深铁路	482,900	2,689,753.00	1.26
9	001979	招商蛇口	137,000	2,679,720.00	1.25
10	600019	宝钢股份	307,800	2,659,392.00	1.24

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,685,224.10	1.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,377,120.00	4.85
	其中：政策性金融债	10,377,120.00	4.85
4	企业债券	25,663,740.00	11.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,726,084.10	18.10

#### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112157	12 科陆 01	200,000	19,896,000.00	9.30
2	108601	国开 1703	104,000	10,377,120.00	4.85
3	122366	14 武钢债	50,000	4,971,500.00	2.32
4	019557	17 国债 03	25,760	2,572,393.60	1.20
5	136291	16 力帆 02	8,000	796,240.00	0.37

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,362.88
2	应收证券清算款	10,710,097.02
3	应收股利	-
4	应收利息	1,191,909.97
5	应收申购款	791.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,920,161.72

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603986	兆易创新	4,058,208.00	1.90	重大资产重组
2	000022	深赤湾 A	2,860,590.00	1.34	重大资产重组

#### 5.11.6 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，分项之和于合计项之间可能存在尾差。

### 转型前：

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	138,082,923.39	63.72
	其中：股票	138,082,923.39	63.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,705,372.20	22.48
	其中：债券	48,705,372.20	22.48
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,000,000.00	9.23
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,314,929.92	3.84
8	其他资产	1,582,585.18	0.73
9	合计	216,685,810.69	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,510,634.00	1.17
B	采矿业	5,218,116.00	2.43
C	制造业	61,245,473.74	28.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,037,458.00	4.67

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,731,512.49	5.92
G	交通运输、仓储和邮政业	13,225,260.96	6.15
H	住宿和餐饮业	2,642,523.30	1.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,485,142.05	3.48
J	金融业	10,216,711.20	4.75
K	房地产业	2,659,170.00	1.24
L	租赁和商务服务业	2,541,954.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,568,967.65	3.52
S	综合	-	-
	合计	138,082,923.39	64.21

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	26,400	4,130,544.00	1.92
2	600176	中国巨石	177,900	2,874,864.00	1.34
3	000022	深赤湾 A	118,500	2,860,590.00	1.33
4	600196	复星医药	58,900	2,750,630.00	1.28
5	601766	中国中车	229,962	2,695,154.64	1.25
6	000028	国药一致	44,961	2,670,233.79	1.24
7	601318	中国平安	35,984	2,663,535.68	1.24
8	001979	招商蛇口	137,000	2,659,170.00	1.24
9	601899	紫金矿业	635,700	2,644,512.00	1.23
10	600754	锦江股份	84,130	2,642,523.30	1.23

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,684,372.20	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,356,320.00	4.82
	其中：政策性金融债	10,356,320.00	4.82

4	企业债券	35,664,680.00	16.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,705,372.20	22.65

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112157	12 科陆 01	200,000	19,900,000.00	9.25
2	108601	国开 1703	104,000	10,356,320.00	4.82
3	136059	15 纳通 01	100,000	9,998,000.00	4.65
4	122366	14 武钢债	50,000	4,969,000.00	2.31
5	019557	17 国债 03	25,760	2,571,620.80	1.20

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 5.10.2 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。



### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,362.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,564,147.43
5	应收申购款	499.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	575.62
8	其他	-
9	合计	1,582,585.18

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603986	兆易创新	4,130,544.00	1.92	重大资产重组
2	000022	深赤湾 A	2,860,590.00	1.33	重大资产重组

### 5.11.6 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，分项之和于合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 12 月 25 日 ）基金份额总额	181,072,205.13
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,106.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	355,223.58
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	180,720,088.44

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；

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。

3、报告周期为 2017 年 12 月 25 日到 2017 年 12 月 31 日。

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	182,239,859.27
报告期期间基金总申购份额	99,253.73
减：报告期期间基金总赎回份额	1,266,907.87
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	181,072,205.13

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；

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。

3、报告周期为 2017 年 10 月 1 日到 2017 年 12 月 24 日。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171001-20171231	168,349,326.60	0.00	0.00	168,349,326.60	93.15%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
如开放期内上述持有人集中大额赎回，极端情况下本基金可能存在一定的流动性风险以及净值波动等情况。							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2017 年 12 月 21 日东吴配置优化混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括东吴配置优化混合型证券投资基金调整基金投资范围、投资策略、业绩比较基准、估值方法以及修订基金合同等，并同意将“东吴配置优化混合型证券投资基金”更名为“东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金”。自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起（即 2017 年 12 月 25 日），《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴保本混合型证券投资基金设立的文件（2015 年 8 月 19 日起东吴保本混合型证券投资基金转型为“东吴配置优化混合型证券投资基金”）；

2、中国证监会批准东吴配置优化混合型证券投资基金设立的文件（2017 年 12 月 25 日起东吴配置优化混合型证券投资基金转型为“东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金”）；

- 3、《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内东吴配置优化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。

## 9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

## 9.3 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  
2018年1月19日