

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 年年度报告

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

送出日期：二〇一八年三月三十一日

§ 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 2018 年 3 月 27 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 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 24 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（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现（转型后）.....	9
3.2 基金净值表现（转型前）.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 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.....	20
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
§6 审计报告（转型后）	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§6 审计报告（转型前）	25
6.1 审计报告基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§7 年度财务报表（转型后）	28
7.1 资产负债表（转型后）.....	28
7.2 利润表.....	29
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	30
7.4 报表附注.....	31
§7 年度财务报表（转型前）	54
7.1 资产负债表（转型前）.....	54

7.2 利润表.....	55
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	56
7.4 报表附注.....	57
§8 投资组合报告（转型后）.....	84
8.1 期末基金资产组合情况.....	84
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	84
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	87
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	87
8.5 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.....	88
8.6 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.....	88
8.7 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.....	88
8.8 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.....	88
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	88
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	88
8.11 投资组合报告附注.....	89
§8 投资组合报告（转型前）.....	90
8.1 期末基金资产组合情况.....	90
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	90
8.3 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.....	91
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	93
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	94
8.6 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.....	95
8.7 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.....	95
8.8 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.....	95
8.9 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.....	95
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	95
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	95
8.12 投资组合报告附注.....	95
§9 基金份额持有人信息（转型后）.....	97
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
9.3 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.....	97
§9 基金份额持有人信息（转型前）.....	98
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	98
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	98
9.3 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.....	98
§10 开放式基金份额变动(转型后).....	99
§10 开放式基金份额变动(转型前).....	100
§11 重大事件揭示.....	101
11.1 基金份额持有人大会决议.....	101
11.2 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.....	101
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	101
11.4 基金投资策略的改变.....	101
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	102
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	102

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	102
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	104
11.9 其他重大事件（转型后）	107
11.9 其他重大事件（转型前）	108
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	114
12.1 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.....	114
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	114
§13 备查文件目录.....	115
13.1 备查文件目录.....	115
13.2 存放地点.....	115
13.3 查阅方式.....	115

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴配置优化混合
场内简称	-
基金主代码	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
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	180,720,088.44 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	东吴配置优化混合型证券投资基金
基金简称	东吴配置优化
场内简称	-
基金主代码	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
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	181,072,205.13 份
基金合同存续期	2015 年 8 月 19 日至 2017 年 12 月 24 日

2.2 基金产品说明（转型后）

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。

2.2 基金产品说明（转型前）

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。

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	贺倩
	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	010-66060069
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所	上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 50 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	35,214.75
本期利润	-660,499.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0037
本期加权平均净值利润率	-0.31%
本期基金份额净值增长率	41.08%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	29,511,169.70
期末可供分配基金份额利润	0.1633
期末基金资产净值	213,959,565.18
期末基金份额净值	1.1839
3.1.3 累计期末指标	2017 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-0.35%

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。

4、本基金转型前为东吴配置优化混合型证券投资基金。东吴配置优化混合型证券投资基金于 2015 年 8 月 19 日成立，2017 年 12 月 25 日变更为“东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金”。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日	2016 年	2015 年
本期已实现收益	35,827,664.72	-1,932,194.02	1,225,838.55
本期利润	44,240,640.48	-3,137,335.14	-99,386.91
加权平均基金份额本期利润	0.2410	-0.0875	-0.0028
本期加权平均净值利润率	19.06%	-7.55%	-0.24%
本期基金份额净值增长率	20.99%	-0.43%	17.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 24 日	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	29,533,472.73	31,724,662.11	4,576,283.91

期末可供分配基金份额利润	0.1631	0.1703	0.1745
期末基金资产净值	215,036,841.52	218,047,563.81	30,799,357.75
期末基金份额净值	1.1880	1.1700	1.1750
3.1.3 累计期末指标	2017 年 12 月 24 日	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	19.87%	-0.93%	-0.51%

3.2 基金净值表现（转型后）

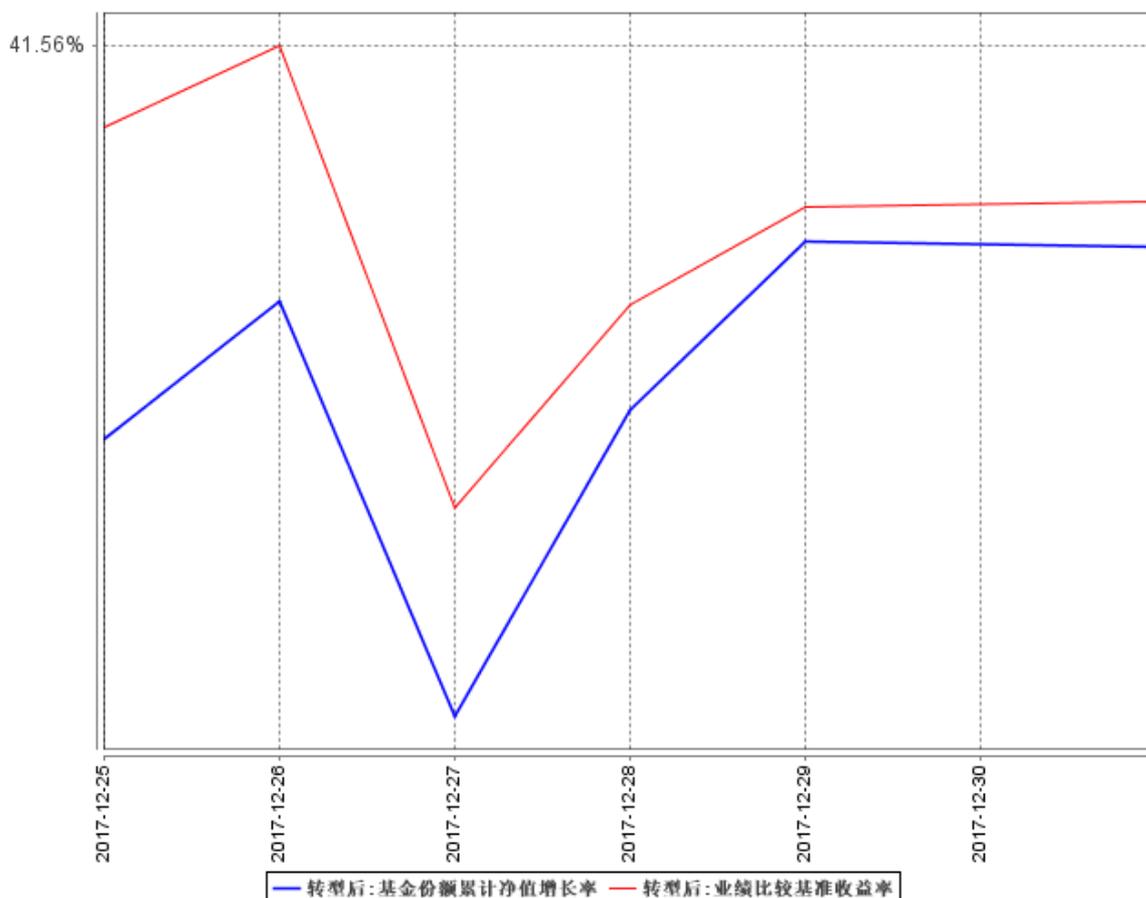
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-	-
自基金合同生效起至今	-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 自基金转型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

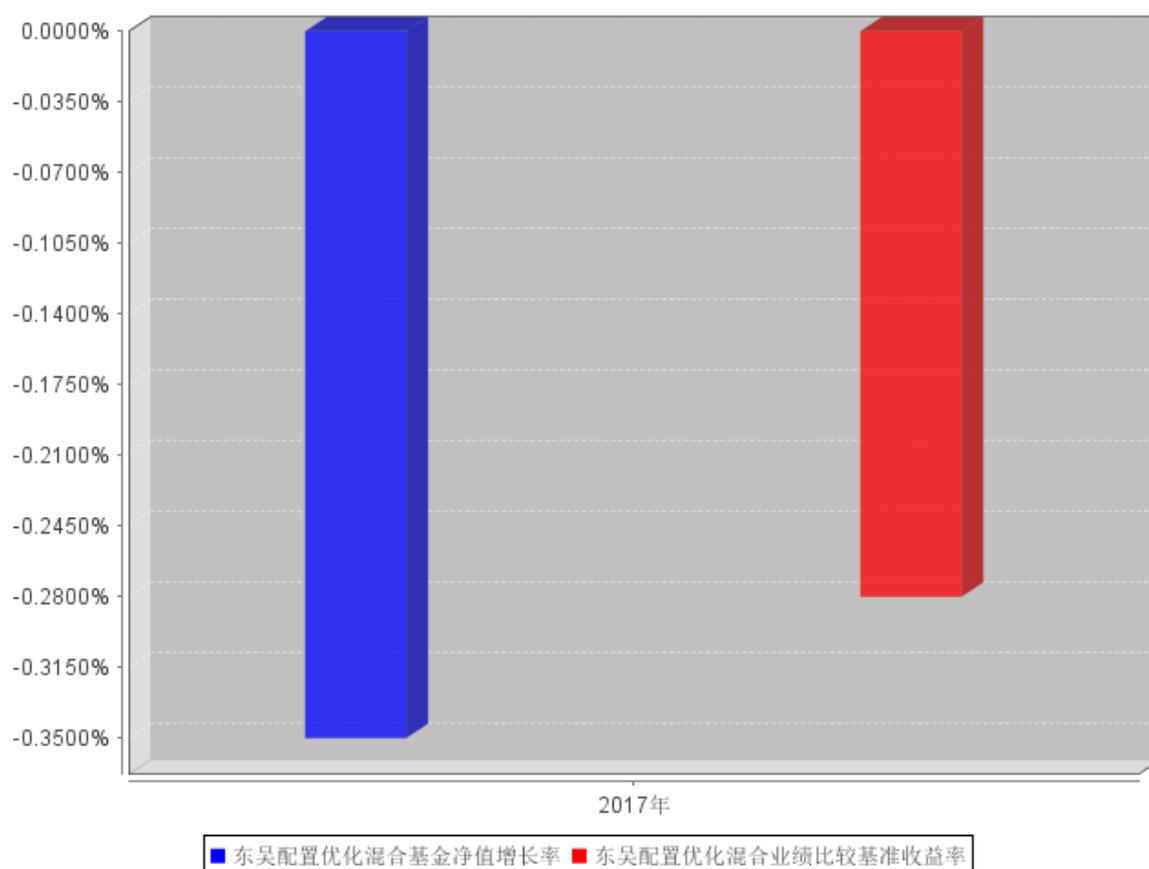


注：1. 业绩比较基金=沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%

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转型而来，转型日期为 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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴配置优化混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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转型而来，
转型日期为 2017 年 12 月 25 日（即基金合同生效日）。合同生效当年按实际存续期计算，不按整
个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型前）

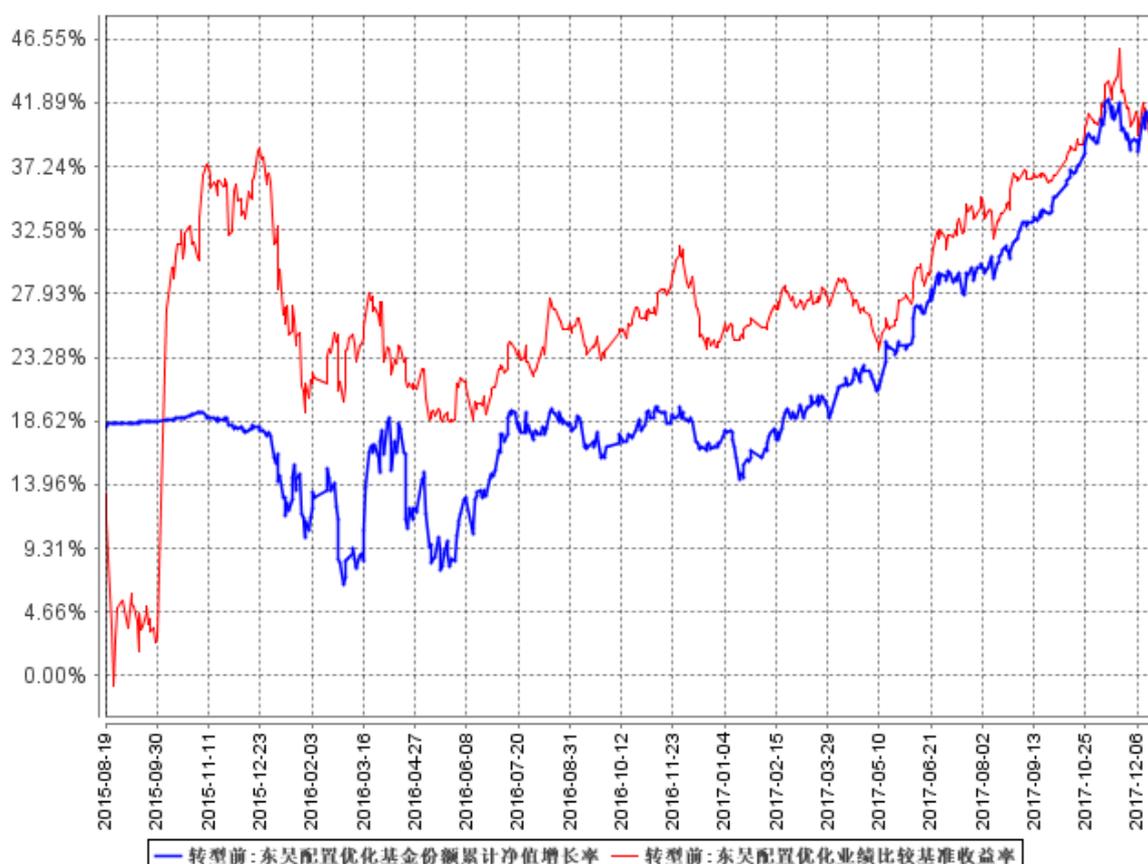
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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		-
过去三个月	4.86%	0.47%	2.94%	0.48%	1.92%	-0.01%
过去六个月	9.48%	0.41%	5.82%	0.42%	3.66%	-0.01%
过去一年	20.99%	0.41%	12.13%	0.38%	8.86%	0.03%
自基金合同生效起至今	19.87%	0.61%	2.46%	0.81%	17.41%	-0.20%

注：业绩比较基金=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

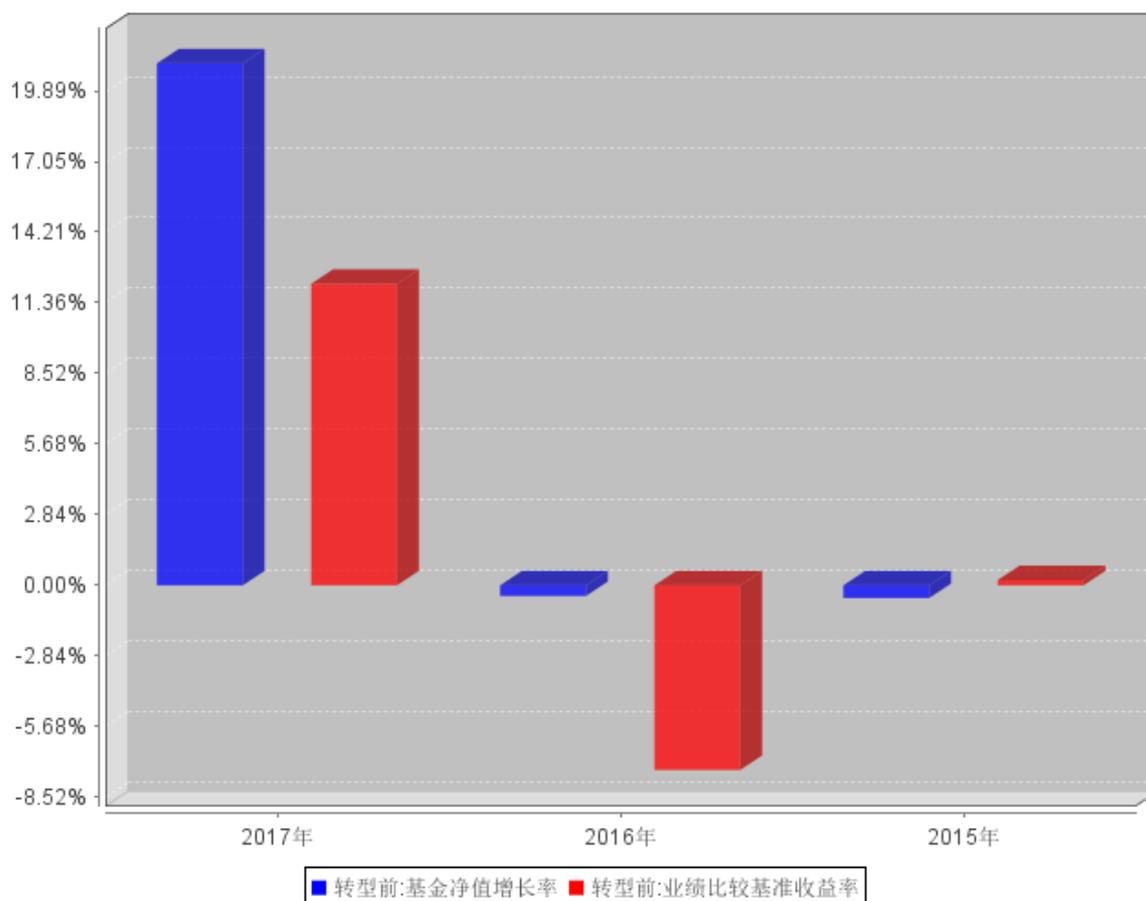
东吴配置优化基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：业绩比较基金=60%*沪深 300 指数+40%*中国债券综合全价指数

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：东吴配置优化混合型证券投资基金由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2015 年 8 月 19 日（即基金合同生效日）。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	2.2400	40,569,828.33	66,734.18	40,636,562.51	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	2.2400	40,569,828.33	66,734.18	40,636,562.51	

转型后

本基金自成立以来未进行过利润分配。

§ 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海澜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、特定客户资产管理和经中国证监会批准的其他业务。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,尤其在“战略性人才梯队建设、市场化体制机制改革”的经营策略指导下,公司各项业务快速发展,进一步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 12 月 31 日,公司管理的资产规模合计 752.89 亿元,其中,公募基金管理规模 266.41 亿元,专户资产管理规模 256.09 亿元,子公司专项资产管理规模 230.39 亿元;管理各类产品 156 只,其中,公募基金 27 只,专户产品 60 只,子公司资产计划 69 只,涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求。

2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,进一步引入了量化投资策略,并在业内率先成立了绝对收益部,谋求穿越牛熊的正回报。2017 年公司绝对收益策略基金,通过灵活调整,在上半年市场震荡中,规避了市场大幅回调的风险,业绩排名持续位列同类基金前列。2017 年,公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示,截至 2017 年年底,公司旗下的固定收益类基金以 8.29%的净值增长率,位列最近两年 83 家入选基金公司的第二位。

近年来,公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩,斩获了诸多奖项,比如 2016 年度最受欢迎债券类基金*东吴鼎利债券基金 LOF(东方财富风云榜)、2015 年度十大风云基金公司(《大众证券报》)、2014 年度最佳投资风格*金蝉奖(东吴新经济股票型基金,《华夏理财》杂志)、2014 年度新财富最智慧投资机构(《新财富》杂志)等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
杨庆定	固定收益总监、固定收益总部总经理、本基金基金经理	2015年8月19日	-	12年	博士，上海交通大学管理学专业毕业。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、固定收益总部总经理，其中自2013年6月25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	2016年5月10日		10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，自2016年5月10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）基金经理。

戴斌	权益投资 总部副总 经理、本 基金经理	2015 年 8 月 19 日	2017 年 7 月 29 日	11 年	博士，中国人民大学金融学 专业毕业。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，现任权益投资总部 副总经理、基金经理，其中 自 2013 年 12 月 24 日起担任 东吴新产业精选混合型证券 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。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，2015 年 8 月 19 日至 2017 年 7 月 29 日担任东吴配 置优化混合型证券投资基金 基金经理，2015 年 7 月 1 日 至 2017 年 12 月 18 日担任东 吴新趋势价值线灵活配置混 合型证券投资基金基金经 理。
----	------------------------------	--------------------	-----------------	------	---

注：1、此处的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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
杨庆定	固定收益 总监、固 定收益总 部 总 经 理、本基 金基金经 理	2015 年 8 月 19 日	-	12 年	博士，上海交通大学管理学 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、固定收益总部总经理，其中自 2013 年 6 月 25 日起担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	2016 年 5 月 10 日		10 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，自 2016 年 5 月 10 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) 基金经理。
戴斌	权益投资总部副总经理、本基金基金经理	2015 年 8 月 19 日	2017 年 7 月 29 日	11 年	博士，中国人民大学金融学专业毕业。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，现任权益投资总部副总经理、基金经理，其中自 2013 年 12 月 24 日起担任东吴新产业精选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。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，2015 年 8 月 19 日至 2017 年 7 月 29 日担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 1 日至 2017 年 12 月 18 日担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的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。

4.2 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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2017 年 GDP 增速预计在 6.8%，CPI 稳定在 2%以下，出口明显恢复，消费整体稳定，投资增速放缓，宏观经济是近几年少有的平稳发展的一年，为经济结构调整创造了良好的宏观环境。政府运用积极的财政政策和稳健中性的货币政策，通过供给侧改革，淘汰落后和无效产能，实现资源有效配置，产业结构优化和行业集中度提升的速度加快，企业盈利显著恢复，推动市场配置向价值回归，行业龙头估值溢价。

本基金在报告期内基于对市场变化的判断维持中性仓位，重点配置食品饮料、家电、银行等低估值消费品及避险资产，有效降低了组合波动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.1839 元，累计净值为 1.4079 元；本报告期（2017 年 12 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日）份额净值增长率为 -0.35%，同期业绩比较基准收益率为 -0.28%。

截至 2017 年 12 月 24 日，东吴配置优化混合型证券投资基金份额净值为 1.1880 元，累计净值为 1.4120 元；本报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日）份额净值增长率为 20.99%，同期业绩比较基准收益率为 12.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，从企业盈利来看，2016 年中期以来企业盈利持续恢复，且龙头企业、国有企业盈利改善更为显著，成为支撑经济结构调整的中流砥柱，目前看来，如果大宗商品价格稳定，出口和下游消费升级将带动中下游企业盈利的回升，2018 年整体企业盈利增长仍将持续。

从估值角度看，2018 年的变量较大。近期召开的中央政治局会议明确提出了防风险是 2018 年的首要任务，去杠杆降负债等政策措施的执行可能带来的风险暴露会降低市场风险偏好，同时在防风险背景下，我们也不能期待宽松的货币政策环境，这些都将压制股票市场估值。

我们认为 2018 年估值的摆动将对市场起决定作用。在目前的高利率环境下，我们相对看好盈利持续改善的国有银行，以及与经济增长关系相关性较弱的必需消费品。

当然，防风险和调结构的过程中必然孕育着新的成长机会，我们建议等待风险暴露后利率出现拐点时，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方向。

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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 紧跟业务要求，完善风险控制手段。本基金管理人结合基金风险管理要求，事前做好系统风控设置，事中加强监控及跟踪提示，事后积极研究、探索风控手段的优化方案，规范流程，提升效率，构建多维度的风险管理层次，不断提升公司风险管理水平。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 梳理信批流程，促进信息披露规范化。本基金管理人持续关注最新出台的法律法规，根据产品的不同信息披露要求切实做好信息披露要点汇总、节点提示及对外披露等工作，加强流程化、日志化管理，保障了信息披露工作的及时性以及准确性。

(4) 提升合规氛围，推动合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强了内部合规培训力度，深化基金从业人员风合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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的情形。

§ 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 12 月 31 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年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60469066_B28 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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)全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年 12 月 25 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 12 月 25 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,管理层负责评估东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况</p>

	<p>可能导致东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	徐艳 张亚旋
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2018 年 3 月 28 日

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60469066_B13 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴配置优化混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的东吴配置优化混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）的资产负债表（即《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》失效前日，以下简称“基金合同失效前日”）、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴配置优化混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴配置优化混合型证券投资基金 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴配置优化混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>东吴配置优化混合型证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在</p>

	<p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估东吴配置优化混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督东吴配置优化混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对东吴配置优化混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截</p>

	<p>至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东吴配置优化混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	徐艳 张亚旋
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2018 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	4,046,914.52
结算备付金		3,275,692.19
存出保证金		17,362.88
交易性金融资产	7.4.7.2	175,881,889.19
其中：股票投资		137,155,805.09
基金投资		-
债券投资		38,726,084.10
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	20,000,000.00
应收证券清算款		10,710,097.02
应收利息	7.4.7.5	1,191,909.97
应收股利		-
应收申购款		791.85
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		215,124,657.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		271,473.94
应付托管费		45,245.66
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	144,460.64
应交税费		603,912.20

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		1,165,092.44
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	180,720,088.44
未分配利润	7.4.7.10	33,239,476.74
所有者权益合计		213,959,565.18
负债和所有者权益总计		215,124,657.62

注 1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值为 1.1839 元, 基金份额总额为 180,720,088.44 份。

2. 本基金合同于 2017 年 12 月 25 日生效, 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 12 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-543,332.37
1. 利息收入		85,710.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,657.17
债券利息收入		37,064.26
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		46,989.07
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		66,665.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	256,281.50
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-189,616.44
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-695,714.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	6.34

减：二、费用		117,167.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	61,490.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	10,248.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	725.58
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	44,703.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-660,499.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-660,499.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益（基金净值）	181,072,205.13	33,964,636.39	215,036,841.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-660,499.52	-660,499.52
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）	-352,116.69	-64,660.13	-416,776.82
其中：1. 基金申购款	3,106.89	553.52	3,660.41
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-355,223.58	-65,213.65	-420,437.23
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）	180,720,088.44	33,239,476.74	213,959,565.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王炯

吕晖

吴婷

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”，东吴保本混合型证券投资基金于 2015 年 8 月 19 日起转型为东吴配置优化混合型证券投资基金，又于 2017 年 12 月 25 日起转型为东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]506 号《关于同意东吴保本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管理人向社会公众公开发行募集，基金合同于 2012 年 8 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 775,673,452.62 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机构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。

2015 年 8 月 13 日，东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满后，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”。自《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》生效之日起，《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。

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”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起，《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。

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率 × 50%+中国债券综合全价指数 × 50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 12 月 25 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 12 月 25 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(8)股指期货/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认,并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账;

(9)权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(10)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(11)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(12)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方

法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 8 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)基金收益分配方式分为两种，现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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. 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	4,046,914.52

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,046,914.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	130,086,899.78	137,155,805.09	7,068,905.31
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	39,375,799.60	38,726,084.10
	银行间市场	-	-
	合计	39,375,799.60	38,726,084.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	169,462,699.38	175,881,889.19	6,419,189.81

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	922.50
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	1,474.10
应收债券利息	1,200,464.46

应收买入返售证券利息	-10,958.89
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.80
合计	1,191,909.97

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	144,248.14
银行间市场应付交易费用	212.50
合计	144,460.64

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	100,000.00
合计	100,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年12月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	181,072,205.13	181,072,205.13
本期申购	3,106.89	3,106.89
本期赎回(以“-”号填列)	-355,223.58	-355,223.58
- 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	180,720,088.44	180,720,088.44

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	29,533,472.73	4,431,163.66	33,964,636.39

本期利润	35,214.75	-695,714.27	-660,499.52
本期基金份额交易产生的变动数	-57,517.78	-7,142.35	-64,660.13
其中：基金申购款	507.62	45.90	553.52
基金赎回款	-58,025.40	-7,188.25	-65,213.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,511,169.70	3,728,307.04	33,239,476.74

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2017年12月25日(基金合同生效日)至2017年 12月31日
活期存款利息收入	619.84
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	1,031.87
其他	5.46
合计	1,657.17

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月25日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
卖出股票成交总额	362,804.38
减：卖出股票成本总额	106,522.88
买卖股票差价收入	256,281.50

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月25日(基金合同生效日)至2017年 12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	10,400,000.00
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	10,189,616.44
减：应收利息总额	400,000.00
买卖债券差价收入	-189,616.44

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他投资交易。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年12月25日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
1. 交易性金融资产	-695,714.27
——股票投资	-906,042.61
——债券投资	210,328.34
——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	-695,714.27

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年12月25日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
基金赎回费收入	6.34
合计	6.34

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年12月25日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
交易所市场交易费用	725.58
银行间市场交易费用	-
合计	725.58

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年12月25日(基金合同生效日)至2017 年12月31日
审计费用	2,707.58
信息披露费	1,727.58
汇划费	237.91
其他费用	0.00
律师费	40,000.00
帐户维护费	30.00
持有人大会费用	0.00
合计	44,703.07

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、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
海澜集团有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：根据 2017 年 12 月 30 日《东吴基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》，经东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证监会证监许可[2017]1664 号文批复同意，本公司原股东上海兰生（集团）有限公司将其持有的本公司 30%股权转让给海澜集团有限公司。截止财务报表批准日，该股权转让尚未完成工商变更登记。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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年12月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	61,490.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,003.90

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	10,248.37	

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.10.5 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 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,046,914.52	619.84

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年 12 月 25 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间获得的利息收入为人民币 1,031.87 元，2017 年末结算备付金余额为人民币 3,275,692.19 元。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	说明
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.2 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
603986	兆易创新	2017年11月1日	重大资产重组	153.72	2018年3月2日	150.00	26,400	2,590,227.20	4,058,208.00	-
000022	深赤湾A	2017年11月20日	重大资产重组	24.14	-	-	118,500	2,766,677.84	2,860,590.00	-
300730	科创信	2017	重大事	41.55	2018年	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-

	息	年 12 月 25 日	项		1 月 2 日					
002919	名臣健 康	2017 年 12 月 28 日	重大事 项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金,基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在严格风险控制的基础上,追求稳健收益。本基金主要由投资研究团队根据对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势和风险收益水平;在各大类资产投资比例限制前提下,根据大类资产风险收益分析结果,并结合该基金风险收益目标,最终确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例。

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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金基金合同约定投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，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；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	13,062,344.10
合计	13,062,344.10

注：未评级债券包括国债、同业存单、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日
AAA	4,971,500.00
AAA 以下	20,692,240.00
未评级	-
合计	25,663,740.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市。因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017 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	4,046,914.52	-	-	-	-	-	4,046,914.52
清算备付金	3,275,692.19	-	-	-	-	-	3,275,692.19
存出保证金	17,362.88	-	-	-	-	-	17,362.88
交易性金融资		-22,468,393.60	15,461,450.50	796,240.00		-137,155,805.09	175,881,889.19

产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售证券	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,710,097.02	10,710,097.02
应收利息	-	-	-	-	-	1,191,909.97	1,191,909.97
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	791.85	791.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,339,969.59	22,468,393.60	15,461,450.50	796,240.00	-	-149,058,603.93	215,124,657.62
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	271,473.94	271,473.94
应付托管费	-	-	-	-	-	45,245.66	45,245.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	144,460.64	144,460.64
应交税费	-	-	-	-	-	603,912.20	603,912.20
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,165,092.44	1,165,092.44
利率敏感度缺口	27,339,969.59	22,468,393.60	15,461,450.50	796,240.00	-	-147,893,511.49	213,959,565.18

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日)
利率下降 25 个基点	26,329.08
利率上升 25 个基点	-26,232.99

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	137,155,805.09	64.10
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	137,155,805.09	64.10

注：本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例为 0 - 95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准	
	2. 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 12 月 31 日)
	1. 业绩基准下跌 1%	-2,444,915.95
	2. 业绩基准下跌 5%	-12,224,579.76
3. 业绩基准下跌 10%	-24,449,159.51	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 130,088,498.89 元，属于第二层次的余额为人民币 45,793,390.30 元，无属于第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末未以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：东吴配置优化混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 24 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 24 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,039,237.73	1,340,033.29
结算备付金		3,275,692.19	32,409.61
存出保证金		17,362.88	10,178.14
交易性金融资产	7.4.7.2	186,788,295.59	231,807,471.55
其中：股票投资		138,082,923.39	91,637,213.35
基金投资		-	-
债券投资		48,705,372.20	140,170,258.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	20,000,000.00	-
应收证券清算款		-	394,857.50
应收利息	7.4.7.5	1,564,147.43	2,632,348.47
应收股利		-	-
应收申购款		499.25	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	575.62	-
资产总计		216,685,810.69	236,217,298.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 24 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	17,000,000.00
应付证券清算款		538,638.03	-
应付赎回款		1,167.35	291.77
应付管理人报酬		209,983.81	237,314.24
应付托管费		34,997.29	39,552.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	144,130.03	178,332.50
应交税费		603,912.20	603,912.20

应付利息		-	330.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	116,140.46	110,001.10
负债合计		1,648,969.17	18,169,734.75
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	181,072,205.13	186,322,901.70
未分配利润	7.4.7.10	33,964,636.39	31,724,662.11
所有者权益合计		215,036,841.52	218,047,563.81
负债和所有者权益总计		216,685,810.69	236,217,298.56

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日），基金份额净值 1.188 元，基金份额总额 181,072,205.13 份。

2. 自 2017 年 12 月 25 日起，原《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》失效，《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。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）。

7.2 利润表

会计主体：东吴配置优化混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		50,423,233.22	-1,679,528.55
1. 利息收入		4,535,831.42	581,584.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	83,000.04	75,340.27
债券利息收入		3,979,874.10	452,533.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		472,957.28	53,711.08
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		37,473,759.87	-1,057,851.93
其中：股票投资收益	7.4.7.12	34,473,901.50	-897,708.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	424,191.34	-292,151.28
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,575,667.03	132,007.98
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	8,412,975.76	-1,205,141.12

4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	666.17	1,879.64
减：二、费用		6,182,592.74	1,457,806.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,409,336.84	592,562.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	568,222.85	98,760.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,694,939.23	560,870.36
5. 利息支出		313,055.42	25,685.25
其中：卖出回购金融资产支出		313,055.42	25,685.25
6. 其他费用	7.4.7.20	197,038.40	179,927.52
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		44,240,640.48	-3,137,335.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		44,240,640.48	-3,137,335.14

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东吴配置优化混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月24日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月24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)	186,322,901.70	31,724,662.11	218,047,563.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,240,640.48	44,240,640.48
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)	-5,250,696.57	-1,364,103.69	-6,614,800.26
其中：1. 基金申购款	213,398.20	50,886.29	264,284.49
2. 基金赎回款	-5,464,094.77	-1,414,989.98	-6,879,084.75
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)	-	-40,636,562.51	-40,636,562.51
五、期末所有者权益(基金净值)	181,072,205.13	33,964,636.39	215,036,841.52
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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）	26,223,073.84	4,576,283.91	30,799,357.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,137,335.14	-3,137,335.14
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）	160,099,827.86	30,285,713.34	190,385,541.20
其中：1.基金申购款	169,945,943.78	31,909,169.41	201,855,113.19
2.基金赎回款	-9,846,115.92	-1,623,456.07	-11,469,571.99
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）	186,322,901.70	31,724,662.11	218,047,563.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
王炯	吕晖	吴婷
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴配置优化混合型证券投资基金（原名为东吴保本混合型证券投资基金，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]506号《关于同意东吴保本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管理人向社会公众公开发行募集，基金合同于2012年8月13日正式生效，首次设立募集规模为775,673,452.62份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。2015年8月13日，东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满后，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”。自《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》生效之日起，《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。本基金的基金管理人和注册登记机构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。

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”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起，《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。

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数 × 60%+中国债券综合全价指数 × 40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券基金业协会颁布的相关规定。

根据东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议，本基金于 2017 年 12 月 25 日转型为东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金继续运作，故本财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(8) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认,并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账;

(9) 权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(10) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(11) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为八次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%;若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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. 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简

称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	5,039,237.73	1,340,033.29
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,039,237.73	1,340,033.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	130,107,975.47	138,082,923.39	7,974,947.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,565,416.04	48,705,372.20
	银行间市场	-	-
	合计	49,565,416.04	48,705,372.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	179,673,391.51	186,788,295.59	7,114,904.08
项目	上年度末 2016年12月31日		

		成本	公允价值	估值增值
股票		92,332,026.03	91,637,213.35	-694,812.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	70,734,439.26	70,082,258.20	-652,181.06
	银行间市场	70,039,077.94	70,088,000.00	48,922.06
	合计	140,773,517.20	140,170,258.20	-603,259.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		233,105,543.23	231,807,471.55	-1,298,071.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月24日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	302.66	751.58
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	442.23	14.60
应收债券利息	1,563,400.20	2,631,577.69
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	2.34	4.60
合计	1,564,147.43	2,632,348.47

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	575.62	-
合计	575.62	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	143,917.53	177,112.51
银行间市场应付交易费用	212.50	1,219.99
合计	144,130.03	178,332.50

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	1.10
预提费用	116,140.46	110,000.00
合计	116,140.46	110,001.10

7.4.7.9 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12月24日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	186,322,901.70	186,322,901.70
本期申购	213,398.20	213,398.20
本期赎回(以“-”号填列)	-5,464,094.77	-5,464,094.77
- 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	181,072,205.13	181,072,205.13

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	35,594,717.40	-3,870,055.29	31,724,662.11
本期利润	35,827,664.72	8,412,975.76	44,240,640.48
本期基金份额交易产生的变动数	-1,252,346.88	-111,756.81	-1,364,103.69
其中：基金申购款	44,326.68	6,559.61	50,886.29
基金赎回款	-1,296,673.56	-118,316.42	-1,414,989.98
本期已分配利润	-40,636,562.51	-	-40,636,562.51
本期末	29,533,472.73	4,431,163.66	33,964,636.39

7.4.7.11 存款利息收入

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12月24日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	48,998.51	66,542.29
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	33,193.29	4,233.15
其他	808.24	4,564.83
合计	83,000.04	75,340.27

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月24日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	562,199,690.38	155,034,723.43
减：卖出股票成本总额	527,725,788.88	155,932,432.06
买卖股票差价收入	34,473,901.50	-897,708.63

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月24日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	119,138,523.07	22,878,339.87

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	114,822,282.26	22,779,412.44
减：应收利息总额	3,892,049.47	391,078.71
买卖债券差价收入	424,191.34	-292,151.28

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月24日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,575,667.03	132,007.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,575,667.03	132,007.98

7.4.7.16 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12月24日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	8,412,975.76	-1,205,141.12
——股票投资	8,669,760.60	-451,373.49
——债券投资	-256,784.84	-753,767.63
——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	8,412,975.76	-1,205,141.12

7.4.7.18 其他收入

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12月24日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	666.04	1,272.84
转换费收入	0.13	606.80
合计	666.17	1,879.64

7.4.7.19 交易费用

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12月24日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,694,589.23	559,620.36
银行间市场交易费用	350.00	1,250.00
合计	1,694,939.23	560,870.36

7.4.7.20 其他费用

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12月24日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	57,292.42	50,000.00
信息披露费	88,272.42	90,000.00
汇划费	4,243.56	3,567.52
其他费用	900.00	-
帐户维护费	36,330.00	36,360.00
持有人大会费用	10,000.00	-
合计	197,038.40	179,927.52

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起，《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。

截至财务报表批准日，除以上和在 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：根据 2017 年 12 月 30 日《东吴基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》，经东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证监会证监许可[2017]1664 号文批复同意，本公司原股东上海兰生（集团）有限公司将其持有的本公司 30%股权转让给海澜集团有限公司。截止财务报表批准日，该股权转让尚未完成工商变更登记。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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 24 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	113,192,202.28	10.09%	-	-

7.4.10.1.2 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 12 月 24 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	6,834,746.68	25.06%	65,106,005.84	72.96%

7.4.10.1.3 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12月24日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	249,600,000.00	6.91%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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12月24日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股 份有限公司	105,415.96	10.21%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

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 12 月 24 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,409,336.84	592,562.98
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	1,413,739.57	130,186.87

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 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 12 月 24 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	568,222.85	98,760.48

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 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12月24日		2016年1月1日至2016年12月31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	5,039,237.73	48,998.51	1,340,033.29	66,542.29

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年度获得的利息收入为人民币 33,193.29 元（2016 年度：人民币 4,233.15 元），2017 年末结算备付金余额为人民币 3,275,692.19 元（2016 年末：人民币 32,409.61 元）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2017 年 11 月 30 日	-	2017 年 11 月 30 日	2.2400	40,569,828.33	66,734.18	40,636,562.51	
合计	-	-	-	2.2400	40,569,828.33	66,734.18	40,636,562.51	

7.4.12 期末 (2017 年 12 月 24 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	说明
300735	光弘科技	2017年12月21日	2017年12月29日	新股流通受限	9.99	9.99	3,764	37,602.36	37,602.36	-
002922	伊戈尔	2017年12月22日	2017年12月29日	新股流通受限	12.41	12.41	1,245	15,450.45	15,450.45	-
603329	上海雅仕	2017年12月22日	2017年12月29日	新股流通受限	10.54	10.54	1,182	12,458.28	12,458.28	-
603283	赛腾股份	2017年12月15日	2017年12月25日	新股流通受限	6.90	6.90	1,349	9,308.10	9,308.10	-
300684	中石科技	2017年12月18日	2017年12月27日	新股流通受限	8.00	8.00	827	6,616.00	6,616.00	-
603655	朗博科技	2017年12月21日	2017年12月29日	新股流通受限	6.46	6.46	880	5,684.80	5,684.80	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
603986	兆易创新	2017年11月1日	重大资产重组	156.46	2018年3月2日	150.00	26,400	2,590,227.20	4,130,544.00	-
000022	深赤湾A	2017年11月20日	重大资产重组	24.14	-	-	118,500	2,766,677.84	2,860,590.00	-
002915	中欣氟材	2017年12月19日	重大事项	21.85	2017年12月25日	24.04	1,085	6,976.55	23,707.25	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日）止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金基金合同约定投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，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；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	40,094,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	13,040,692.20	33,394,000.00
合计	13,040,692.20	73,488,000.00

注：未评级债券包括国债、同业存单、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月24日	上年度末 2016年12月31日
AAA	4,969,000.00	1,378,129.20
AAA 以下	30,695,680.00	65,304,129.00
未评级	-	-
合计	35,664,680.00	66,682,258.20

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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

过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年12 月24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	5,039,237.73	-	-	-	-	-	5,039,237.73
清算备付金	3,275,692.19	-	-	-	-	-	3,275,692.19
存出保证金	17,362.88	-	-	-	-	-	17,362.88
交易性金融资产	9,998,000.00	22,471,620.80	15,438,071.40	797,680.00	-	138,082,923.39	186,788,295.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售证券	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,564,147.43	1,564,147.43
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	499.25	499.25
其他资产	-	-	-	-	-	575.62	575.62
资产总计	38,330,292.80	22,471,620.80	15,438,071.40	797,680.00	-	139,648,145.69	216,685,810.69
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-	-	538,638.03	538,638.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,167.35	1,167.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	209,983.81	209,983.81
应付托管费	-	-	-	-	-	34,997.29	34,997.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	144,130.03	144,130.03
应交税费	-	-	-	-	-	603,912.20	603,912.20
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	116,140.46	116,140.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,648,969.17	1,648,969.17
利率敏感度缺口	38,330,292.80	22,471,620.80	15,438,071.40	797,680.00	-	-137,999,176.52	215,036,841.52
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	1,340,033.29	-	-	-	-	-	1,340,033.29
清算备付金	32,409.61	-	-	-	-	-	32,409.61
存出保证金	10,178.14	-	-	-	-	-	10,178.14
交易性金融资产	-	33,531,000.00	85,602,938.20	21,036,320.00	-	91,637,213.35	231,807,471.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	394,857.50	394,857.50
应收利息	-	-	-	-	-	2,632,348.47	2,632,348.47
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,382,621.04	33,531,000.00	85,602,938.20	21,036,320.00	-	94,664,419.32	236,217,298.56
负债							
卖出回购	17,000,000.00	-	-	-	-	-	17,000,000.00

证券款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	291.77	291.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	237,314.24	237,314.24
应付托管费	-	-	-	-	-	39,552.38	39,552.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	178,332.50	178,332.50
应交税费	-	-	-	-	-	603,912.20	603,912.20
应付利息	-	-	-	-	-	330.56	330.56
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	110,001.10	110,001.10
负债总计	17,000,000.00	-	-	-	-	1,169,734.75	18,169,734.75
利率敏感度缺口	-15,617,378.96	33,531,000.00	85,602,938.20	21,036,320.00	-	93,494,684.57	218,047,563.81

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 24 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	28,338.55	208,531.69
	利率上升 25 个基点	-28,235.56	-207,595.91

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月24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	138,082,923.39	64.21	91,637,213.35	42.03
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	138,082,923.39	64.21	91,637,213.35	42.03

注：本基金投资组合中，股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 30% - 80%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为 20% - 70%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 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12月24日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-1,842,865.73	-3,326.33
	2. 业绩基准下跌 5%	-9,214,328.66	-16,631.65
3. 业绩基准下跌 10%	-18,428,657.32	-33,263.31	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 24 日（基金合同失效前日），本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 130,980,962.15 元，属于第二层次的余额为人民币 55,807,333.44 元，无属于第三层次的余额。（于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 90,243,745.83 元，属于第二层次的余额为人民币 141,563,725.72 元，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期末未发生变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上年度末均未以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	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	其他各项资产	11,920,161.72	5.54
9	合计	215,124,657.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	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

8.2.2 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沪港通股票。

8.2.3 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	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
11	300144	宋城演艺	142,097	2,651,530.02	1.24
12	002179	中航光电	66,784	2,629,953.92	1.23
13	002003	伟星股份	229,652	2,629,515.40	1.23
14	600196	复星医药	58,900	2,621,050.00	1.23
15	600028	中国石化	426,800	2,616,284.00	1.22
16	600089	特变电工	263,743	2,613,693.13	1.22
17	000429	粤高速 A	321,600	2,608,176.00	1.22
18	601919	中远海控	385,200	2,607,804.00	1.22
19	002027	分众传媒	183,800	2,587,904.00	1.21
20	000581	威孚高科	107,800	2,587,200.00	1.21
21	600030	中信证券	141,000	2,552,100.00	1.19
22	600729	重庆百货	101,800	2,551,108.00	1.19
23	000895	双汇发展	96,213	2,549,644.50	1.19
24	600004	白云机场	173,226	2,546,422.20	1.19
25	601607	上海医药	105,229	2,545,489.51	1.19
26	000601	韶能股份	353,000	2,541,600.00	1.19

27	300342	天银机电	156,440	2,528,070.40	1.18
28	002601	龙蟠佰利	157,500	2,523,150.00	1.18
29	601318	中国平安	35,984	2,518,160.32	1.18
30	300251	光线传媒	240,900	2,517,405.00	1.18
31	600886	国投电力	342,800	2,516,152.00	1.18
32	600998	九州通	132,700	2,514,665.00	1.18
33	300059	东方财富	193,985	2,512,105.75	1.17
34	002563	森马服饰	319,500	2,511,270.00	1.17
35	300003	乐普医疗	103,876	2,509,644.16	1.17
36	600023	浙能电力	469,400	2,501,902.00	1.17
37	600038	中直股份	53,700	2,498,661.00	1.17
38	002389	南洋科技	117,800	2,489,114.00	1.16
39	000063	中兴通讯	68,400	2,487,024.00	1.16
40	000998	隆平高科	96,600	2,484,552.00	1.16
41	600056	中国医药	99,693	2,481,358.77	1.16
42	600570	恒生电子	53,400	2,477,760.00	1.16
43	600535	天士力	69,500	2,472,810.00	1.16
44	002343	慈文传媒	69,100	2,460,651.00	1.15
45	300408	三环集团	121,920	2,457,907.20	1.15
46	601211	国泰君安	132,504	2,453,974.08	1.15
47	002831	裕同科技	43,800	2,447,544.00	1.14
48	601688	华泰证券	139,000	2,399,140.00	1.12
49	600859	王府井	115,778	2,361,871.20	1.10
50	002008	大族激光	47,700	2,356,380.00	1.10
51	600562	国睿科技	97,900	2,350,579.00	1.10
52	300188	美亚柏科	114,300	2,283,714.00	1.07
53	600452	涪陵电力	66,400	2,269,552.00	1.06
54	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.03
55	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
56	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
57	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
58	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
59	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
60	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
61	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
62	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
63	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.01
64	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
65	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01

66	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
67	603655	朗博科技	880	8,184.00	0.00

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300664	鹏鹞环保	32,323.20	0.02
2	603161	科华控股	20,753.25	0.01
3	002923	润都股份	16,227.54	0.01
4	603080	新疆火炬	16,143.20	0.01

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。

8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002916	深南电路	266,551.58	0.12
2	002918	蒙娜丽莎	96,252.80	0.04

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

8.3.3 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	85,447.19
卖出股票收入（成交）总额	362,804.38

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。

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,685,224.10	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

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	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

8.6 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

8.11.4 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。

8.11.5 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	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

8.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 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	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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	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	-	-

0	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

8.2.2 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沪港通股票。

8.3 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	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
11	000895	双汇发展	96,213	2,636,236.20	1.23
12	601333	广深铁路	482,900	2,622,147.00	1.22
13	300144	宋城演艺	142,097	2,621,689.65	1.22
14	000429	粤高速 A	321,600	2,617,824.00	1.22
15	000581	威孚高科	107,800	2,616,306.00	1.22
16	601607	上海医药	105,229	2,611,783.78	1.21
17	600089	特变电工	263,743	2,608,418.27	1.21
18	000063	中兴通讯	68,400	2,603,988.00	1.21
19	600019	宝钢股份	307,800	2,594,754.00	1.21
20	002179	中航光电	66,784	2,591,219.20	1.21
21	002003	伟星股份	229,652	2,590,474.56	1.20
22	002008	大族激光	47,700	2,583,909.00	1.20
23	600056	中国医药	99,693	2,578,060.98	1.20
24	600028	中国石化	426,800	2,573,604.00	1.20
25	601919	中远海控	385,200	2,569,284.00	1.19
26	600030	中信证券	141,000	2,564,790.00	1.19

27	600886	国投电力	342,800	2,560,716.00	1.19
28	600570	恒生电子	53,400	2,547,180.00	1.18
29	002831	裕同科技	43,800	2,546,970.00	1.18
30	300342	天银机电	156,440	2,543,714.40	1.18
31	600004	白云机场	173,226	2,542,957.68	1.18
32	002027	分众传媒	183,800	2,541,954.00	1.18
33	600023	浙能电力	469,400	2,530,066.00	1.18
34	600535	天士力	69,500	2,528,410.00	1.18
35	300251	光线传媒	240,900	2,524,632.00	1.17
36	002563	森马服饰	319,500	2,520,855.00	1.17
37	000601	韶能股份	353,000	2,520,420.00	1.17
38	600038	中直股份	53,700	2,517,993.00	1.17
39	600998	九州通	132,700	2,515,992.00	1.17
40	000998	隆平高科	96,600	2,510,634.00	1.17
41	300408	三环集团	121,920	2,506,675.20	1.17
42	300003	乐普医疗	103,876	2,503,411.60	1.16
43	300059	东方财富	193,985	2,502,406.50	1.16
44	601211	国泰君安	132,504	2,501,675.52	1.16
45	002389	南洋科技	117,800	2,495,004.00	1.16
46	601688	华泰证券	139,000	2,486,710.00	1.16
47	600729	重庆百货	101,800	2,485,956.00	1.16
48	600859	王府井	115,778	2,447,546.92	1.14
49	600562	国睿科技	97,900	2,446,521.00	1.14
50	600452	涪陵电力	66,400	2,426,256.00	1.13
51	002343	慈文传媒	69,100	2,422,646.00	1.13
52	300188	美亚柏科	114,300	2,401,443.00	1.12
53	002601	龙蟠佰利	157,500	2,381,400.00	1.11
54	002916	深南电路	3,068	166,162.88	0.08
55	002918	蒙娜丽莎	1,512	90,689.76	0.04
56	300735	光弘科技	3,764	37,602.36	0.02
57	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
58	002915	中欣氟材	1,085	23,707.25	0.01
59	603477	振静股份	1,955	22,990.80	0.01
60	002919	名臣健康	821	21,748.29	0.01
61	002922	伊戈尔	1,245	15,450.45	0.01
62	603329	上海雅仕	1,182	12,458.28	0.01
63	603283	赛腾股份	1,349	9,308.10	0.00
64	300684	中石科技	827	6,616.00	0.00
65	603655	朗博科技	880	5,684.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600900	长江电力	5,061,757.32	2.32
2	000581	威孚高科	4,569,741.00	2.10
3	300182	捷成股份	4,456,081.66	2.04
4	601318	中国平安	4,433,691.84	2.03
5	002563	森马服饰	4,163,675.00	1.91
6	600019	宝钢股份	3,982,450.00	1.83
7	600348	阳泉煤业	3,918,041.60	1.80
8	600038	中直股份	3,897,024.41	1.79
9	600023	浙能电力	3,842,601.00	1.76
10	600176	中国巨石	3,841,372.00	1.76
11	000541	佛山照明	3,711,870.16	1.70
12	000028	国药一致	3,658,910.59	1.68
13	601333	广深铁路	3,610,364.00	1.66
14	000876	新希望	3,591,778.00	1.65
15	002389	南洋科技	3,544,623.16	1.63
16	600054	黄山旅游	3,499,519.06	1.60
17	300144	宋城演艺	3,482,033.86	1.60
18	002821	凯莱英	3,478,100.00	1.60
19	600028	中国石化	3,458,920.00	1.59
20	002343	慈文传媒	3,448,607.00	1.58

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。

8.4.2 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	600900	长江电力	6,878,233.00	3.15
2	600519	贵州茅台	5,152,049.92	2.36
3	600887	伊利股份	5,094,188.00	2.34
4	000661	长春高新	4,925,255.00	2.26

5	600276	恒瑞医药	4,701,316.04	2.16
6	000338	潍柴动力	4,633,396.00	2.12
7	600036	招商银行	4,632,881.18	2.12
8	300182	捷成股份	4,496,509.00	2.06
9	603160	汇顶科技	4,444,436.00	2.04
10	601318	中国平安	4,386,618.56	2.01
11	000876	新希望	4,267,332.92	1.96
12	600348	阳泉煤业	3,966,146.93	1.82
13	002415	海康威视	3,911,103.00	1.79
14	002674	兴业科技	3,855,134.63	1.77
15	601992	金隅股份	3,836,588.00	1.76
16	000541	佛山照明	3,740,080.20	1.72
17	002202	金风科技	3,585,180.60	1.64
18	601939	建设银行	3,534,716.00	1.62
19	000063	中兴通讯	3,422,040.00	1.57
20	000333	美的集团	3,334,620.62	1.53

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

8.4.3 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	565,501,738.32
卖出股票收入（成交）总额	562,199,690.38

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,684,372.20	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

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	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

8.7 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	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

8.12.4 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。

8.12.5 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	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

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 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
537	336,536.48	168,349,326.60	93.15%	12,370,761.84	6.85%

9.2 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开放式基金。

9.3 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 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 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
540	335,318.90	168,349,326.60	92.97%	12,722,878.53	7.03%

9.2 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开放式基金。

9.3 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。

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	181,072,205.13
本报告期期初基金份额总额	-
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)	-
本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 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	60,942,614.53
本报告期期初基金份额总额	186,322,901.70
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	213,398.20
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	5,464,094.77
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)	-
本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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

- 1、2017 年 4 月 10 日，冯玉泉不再担任公司董事一职，由陈建国担任公司董事会董事。
- 2、2017 年 12 月 27 日，陈辉峰、陈如奇、倪雪梅、贝政新不再担任公司董事一职，由汤勇、周虹、张婉苏、方志刚担任公司董事会董事。

本报告期内基金托管人发生以下人事变动：

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 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涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

东吴配置优化混合型证券投资基金自 2017 年 12 月 25 日起正式变更为东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金。变更后基金的投资目标、投资策略和业绩比较基准等按照《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

11.5 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）上海分所，该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 60000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 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	
中金公司	4	362,804.38	100.00%	330.61	100.00%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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

本基金本报告期无新增或退租席位。

11.7.2 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
中金公司	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 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	
中金公司	4	675,042,573.76	60.17%	621,472.91	60.18%	-
东吴证券	2	113,192,202.28	10.09%	105,415.96	10.21%	-
首创证券	2	65,294,919.99	5.82%	59,503.28	5.76%	-
东北证券	1	65,036,879.75	5.80%	59,267.84	5.74%	-
银河证券	1	59,033,311.12	5.26%	53,796.82	5.21%	-
招商证券	1	56,798,928.24	5.06%	51,760.66	5.01%	-
华信证券	1	44,109,845.91	3.93%	41,079.57	3.98%	-
东兴证券	1	43,370,370.73	3.87%	40,391.06	3.91%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金新增交易单元 7 个，为财通证券 2 个、广发证券 1 个、天风证券 2 个、申港证券 1 个、中泰证券 1 个；退租交易单元 3 个，分别为高华证券 1 个、五矿证券 2 个。

11.7.2 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
中金公司	20,439,680.06	74.94%	2,942,793,000.00	81.44%	-	-
东吴证券	6,834,746.68	25.06%	249,600,000.00	6.91%	-	-
首创证券	-	-	101,500,000.00	2.81%	-	-
东北证券	-	-	11,000,000.00	0.30%	-	-
银河证券	-	-	26,000,000.00	0.72%	-	-
招商证券	-	-	86,900,000.00	2.40%	-	-
华信证券	-	-	65,800,000.00	1.82%	-	-
东兴证券	-	-	120,000,000.00	3.32%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	10,000,000.00	0.28%	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

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关于东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 12 月 25 日
2	东吴基金管理有限公司关于调整流通受限股票估值方法的公告	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 12 月 28 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 12 月 29 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2017 年 12 月 29 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 12 月 29 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行股份有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2017 年 12 月 29 日
7	东吴基金管理有限公司关于公	中国证券报、上海证	2017 年 12 月 30 日

	司股权变更公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	
8	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金及资产管理计划征收增值税的公告	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 12 月 30 日

11.9 其他重大事件（转型前）

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	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 13 日
3	东吴配置优化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
4	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 26 日
5	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 2 月 9 日
6	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
7	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 2 月 23 日
8	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 9 日
9	东吴配置优化混合型证券投资	中国证券报、证券时	2017 年 3 月 23 日

	基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	报、公司网站	
10	东吴配置优化混合型证券投资基金 2016 年年度报告以及摘要	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 27 日
11	东吴配置优化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 31 日
12	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 6 日
13	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
14	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
15	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
16	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
17	东吴基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 14 日
18	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 20 日
19	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
20	东吴配置优化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
21	东吴配置优化混合型证券投资基金	中国证券报、证券时	2017 年 5 月 4 日

	基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	报、公司网站	
22	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 5 月 18 日
23	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 6 月 2 日
24	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
25	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 6 月 16 日
26	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 6 月 30 日
27	东吴基金管理有限公司管理的基金 2017 年半年度资产净值公告	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 7 月 1 日
28	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购手续费费率优惠的公告	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 7 月 1 日
29	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 7 月 1 日
30	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 7 月 14 日
31	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	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 7 月 14 日
32	东吴配置优化混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 7 月 19 日

33	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增西南证券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	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 7 月 19 日
34	东吴基金管理有限公司关于参加西南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 7 月 19 日
35	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 7 月 28 日
36	东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 7 月 31 日
37	东吴基金管理有限公司关于参加华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 7 月 31 日
38	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 8 月 11 日
39	东吴基金管理有限公司改聘会计师事务所公告	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 8 月 23 日
40	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 8 月 25 日
41	东吴配置优化混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 8 月 25 日
42	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 9 月 8 日
43	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 9 月 22 日
44	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加平安银行股份有限公司基金代销业务费率优惠活动的公告	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 9 月 26 日

45	东吴配置优化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9月29日
46	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年10月13日
47	东吴配置优化混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年10月27日
48	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年10月27日
49	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月10日
50	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月21日
51	东吴基金管理有限公司《关于以通讯方式召开东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》的更正公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月22日
52	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月22日
53	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月23日
54	东吴基金管理有限公司关于基金经理赵梅玲结束休假恢复履行职务的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月23日
55	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月24日
56	2017 年度东吴配置优化混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年11月28日
57	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017年12月8日
58	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增成都华羿恒信财富投资管理有限公司为代销	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年12月18日

	机构并推出定期定额业务及转换业务的公告		
59	东吴基金管理有限公司关于参加成都华羿恒信财富投资管理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	2017 年 12 月 18 日
60	东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购（含转换转入）业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2017 年 12 月 22 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170101-20171231	168,349,326.60	0.00	0.00	168,349,326.60	93.15%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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；
- 7、《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》；
- 8、《东吴配置优化混合型证券投资基金托管协议》；
- 9、报告期内东吴配置优化混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

13.3 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 3 月 31 日