

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告 (未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	东吴深证 100 指数增强 (LOF)
场内简称	东吴 100
基金主代码	165806
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2012 年 3 月 9 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,786,774.76 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 4 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证 100 价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利息（税后）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	田青
	联系电话	021-50509888-8206	010-67595096

	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		王炯	田国立

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、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-34,870.87
本期利润	-1,000,903.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1858
本期加权平均净值利润率	-14.52%
本期基金份额净值增长率	-15.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	545,926.78
期末可供分配基金份额利润	0.1140
期末基金资产净值	5,332,701.54
期末基金份额净值	1.114
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.40%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

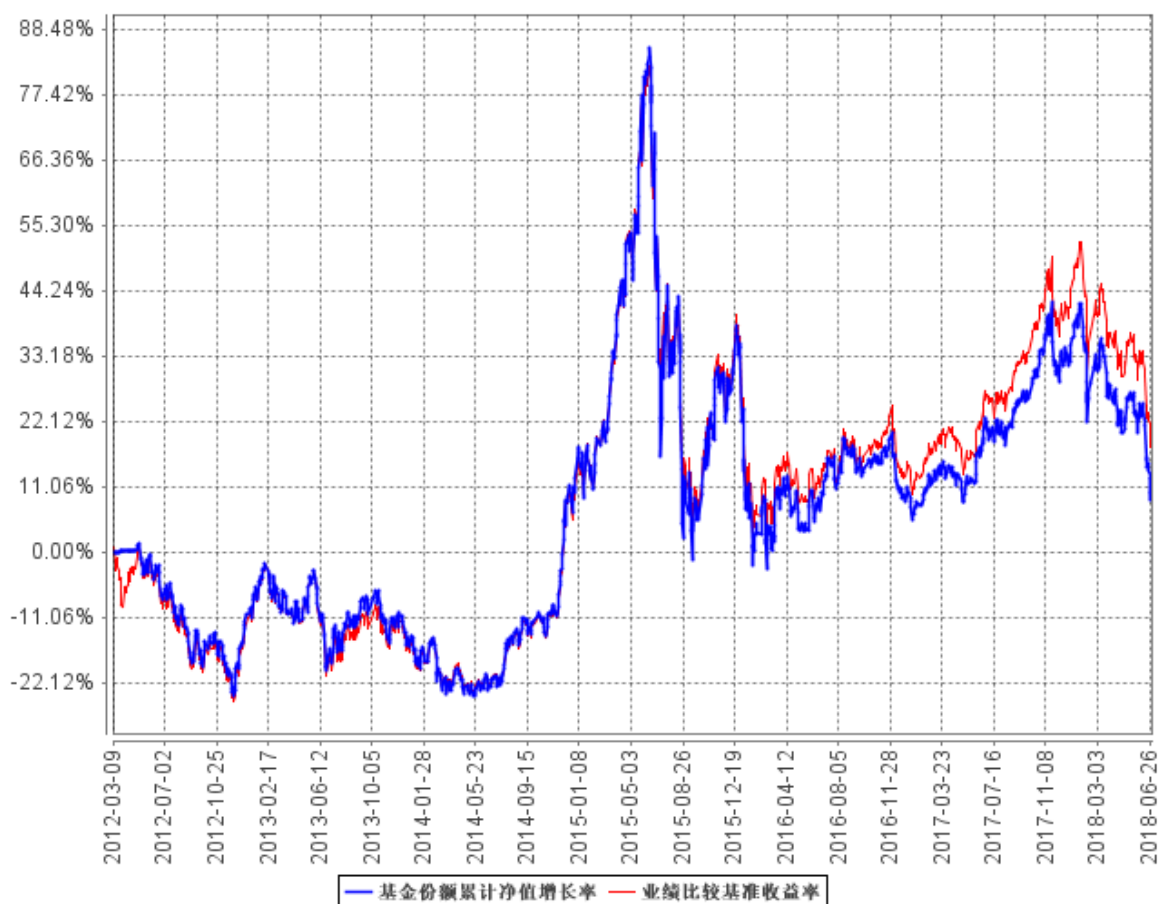
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-9.65%	1.64%	-8.08%	1.57%	-1.57%	0.07%
过去三个月	-12.56%	1.35%	-11.36%	1.31%	-1.20%	0.04%
过去六个月	-15.67%	1.38%	-13.92%	1.34%	-1.75%	0.04%
过去一年	-7.86%	1.19%	-4.16%	1.15%	-3.70%	0.04%
过去三年	-27.33%	1.77%	-20.52%	1.63%	-6.81%	0.14%
自基金合同	11.40%	1.59%	21.36%	1.52%	-9.96%	0.07%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：基金业绩比较基准=95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、基金业绩比较基准=95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

2、本基金于 2012 年 3 月 9 日成立。

§ 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、中国证监会许可的其他业务。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,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 2018 年 6 月 30 日,公司管理的资产规模合计 676.03 亿元,其中,公募资产管理规模(含货币基金) 292.19 亿元,专户资产管理规模 294.61 亿元、专项资产管理规模 89.23 亿元。管理各类产品 134 只,其中,公募基金 28 只,专户产品 63 只,子公司资产计划 43 只,形成了高中低不同风险层次的多元化产品线。

经过多年积累和布局,公司的公募业务已形成三大投研特色:一是权益投资坚持自下而上精选优质成长股的投资风格,把握中国经济转型升级机遇;二是绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念,借助量化模型进行择时和选股;三是固定收益以稳健为本,兼顾收益率和流动性,为大类资产配置提供基础性工具。尤其是 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,引入了量化投资策略,发行了多只量化公募产品,并在业内率先成立了绝对收益部。2017 年,公司对投研模块进行了变革,引进了彭敢等公募行业领军人物,投研磨合红利已开始显现,尤其是固定收益投资崭露头角。

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,比如第十五届“金基金”奖债券基金奖*东吴增利债券基金(《上海证券报》)、2017 年度三年持续回报普通债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2017 年度最受欢迎新发基金*东吴双三角股票型基金(东方财富风云榜)、2016 年度积极债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金*东吴鼎利债券基金 LOF(东方财富风云榜)等。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周健	基金经理	2013年6月5日	-	11年	周健先生, 硕士, 南开大学毕业, 11年证券从业经历。曾就职于海通证券; 2011年5月加入东吴基金管理有限公司, 曾任公司研究策划部研究员, 现任基金经理, 自2012年05月03日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自2013年6月5日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理、自2016年6月3日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 自2016年8月11日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 其中, 自2012年10月27日至2015年5月29日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理, 2016年2月3日至2017年4月19日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016年2月5日至2017年4月19日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

朱冰兵	基金经理	2017 年 3 月 9 日	-	7 年	朱冰兵同志, 南京大学计算机应用专业, 学士学位。曾任江苏省昆山市信托投资公司证券营业部、东吴证券营业部信息技术部系统工程师, 自 2003 年 10 月参与我司筹建以来, 一直就职于我司, 其中 2003 年 10 月至 2010 年 6 月任系统工程师, 2010 年 7 月至今, 一直从事研究工作, 历任助理研究员、研究员、基金经理助理, 现任基金经理, 其中, 自 2017 年 3 月 9 日起担任东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 东吴中证新兴产业指数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交易进行了相关分析，未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济数据整体平稳，但是由于受到去杠杆、中美贸易摩擦等诸多利空因素影响，市场表现不佳。国内负债率高企，为了防范金融风险，国家决定去杠杆，出台资管新规、收缩棚改政策等措施，影响较大，不仅导致大量质押爆仓和信用违约，也引发市场对金融风险及未来经济下滑的担忧。外部中美贸易摩擦反复，预期不明确，美国的遏制态度使市场认识到中国现有的差距及中长期发展的艰巨性，美国加息、缩表也约束了国内的政策空间。内忧外患相结合，市场风险偏好大幅下降，引发市场整体快速的调整。

报告期内，本基金主要采用复制指数配置策略，密切跟踪指数，控制相对基准的偏离；严格从基本面出发，坚持价值投资策略，从较长投资周期维度来精选有核心竞争力、估值低、业绩增长确定的优质公司，通过公司的长期业绩增长来克服市场的波动，获得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.114 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.67%，业绩比较基准收益率为-13.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，内部防风险、去杠杆仍是主要矛盾，目前整体宏观杠杆率较高，在内部较高的资产价格和美国持续加息的大背景下，去杠杆预计会坚持。资管新规和理财新规调整，以及保持流动性合理充裕，并不意味着放水刺激，政策调整也只会使去杠杆有序推进并防止衍生风险发生，政策着力点将在减税、乡村振兴、鼓励消费和支持创新方面，扶持第三产业、新兴产业的快速增长，实现经济转型。一季度社融增速下滑，其滞后效应影响三季度经济增速。由于上半年处理地方债等，财政发力不多，预计下半年政策空间较大，经济整体可能稳中有降但是总体可控。预计

下半年，中美贸易摩擦仍有干扰，但是边际影响将减弱；汇率贬值是主动应对且可控，短期担忧释放。美国遏制中国发展将是其长期战略，预计未来仍会有反复。

市场风险偏好较低，对去杠杆影响实体的负面消息及对经济、盈利的担忧、中美贸易摩擦在前期已有较为充分的反映。目前市场调整幅度较大，整体估值处于历史底部区域，继续往下空间不大。随着看到一些政策、流动性及盈利预期的边际变化，内外部的一些不确定性的消除，海外资金的持续流入，预计未来市场有可能震荡筑底、稳步走高。市场仍处于存量博弈阶段，在去杠杆及市场参与者结构变化的背景下，整体市场风格不会有太大变化。

坚持消费+创新两条主线，在出口、投资等受约束的情况下，它们是未来中国经济转型的方向。我们看好大众消费、免税、医药、内容付费、云计算、智能制造等细分领域，自下而上精选未来成长性好的优质公司，也看好具有核心竞争力、受益于供给侧改革后盈利能力提升的龙头公司，以及前期因市场情绪超跌的公司的估值修复。操作上从基本面出发，寻求业绩、成长的确定性和估值的匹配性。我们将坚持价值投资理念，精选个股，通过业绩长期的确定性来消除市场波动的影响，给投资者以持续、稳定的绝对回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、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，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约

定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日出现基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	334,629.17	405,533.44
结算备付金		1,352.00	13,404.85
存出保证金		1,048.10	1,018.60
交易性金融资产	6.4.7.2	5,051,731.61	6,683,346.42
其中：股票投资		5,051,731.61	6,683,346.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		40,930.20	54,142.07
应收利息	6.4.7.5	73.25	103.71
应收股利		-	-
应收申购款		99.88	998.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	16,666.78	-
资产总计		5,446,530.99	7,158,547.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,250.66	-
应付管理人报酬		4,757.08	6,022.57
应付托管费		713.56	903.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,539.81	4,475.79

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,568.34	98,000.00
负债合计		113,829.45	109,401.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,786,774.76	5,337,370.87
未分配利润	6.4.7.10	545,926.78	1,711,775.26
所有者权益合计		5,332,701.54	7,049,146.13
负债和所有者权益总计		5,446,530.99	7,158,547.89

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.114 元，基金份额总额 4,786,774.76 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-762,570.06	838,854.17
1.利息收入		3,129.53	1,856.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,129.53	1,856.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		190,629.81	24,026.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	153,777.64	-14,662.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	36,852.17	38,689.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-966,032.56	809,938.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,703.16	3,032.33

减：二、费用		238,333.37	251,671.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,982.32	27,976.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,097.40	4,196.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	11,804.34	14,787.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	187,449.31	204,711.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,000,903.43	587,182.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,000,903.43	587,182.24

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,337,370.87	1,711,775.26	7,049,146.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,000,903.43	-1,000,903.43
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）	-550,596.11	-164,945.05	-715,541.16
其中：1. 基金申购款	5,866,952.56	1,537,756.31	7,404,708.87
2. 基金赎回款	-6,417,548.67	-1,702,701.36	-8,120,250.03
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）	4,786,774.76	545,926.78	5,332,701.54

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,361,370.37	546,729.37	6,908,099.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	587,182.24	587,182.24
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）	-1,384,103.92	-94,582.84	-1,478,686.76
其中：1.基金申购款	949,958.44	132,046.95	1,082,005.39
2.基金赎回款	-2,334,062.36	-226,629.79	-2,560,692.15
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）	4,977,266.45	1,039,328.77	6,016,595.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王炯

徐明

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) (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[2011]1278 号《关于核准东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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 3 月 9 日正式生效, 首次设立募集规模为 385,199,023.48 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为东吴基金管理有限公司, 注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，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%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩比较基准为：95%*深证 100 价格指数收益率 +5%*商业银行活期存款利率（税后）。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	334,629.17
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	334,629.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,659,892.68	5,051,731.61	391,838.93
贵金属投资 - 金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,659,892.68	5,051,731.61	391,838.93

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	72.15
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	0.60
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.50
合计	73.25

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	16,666.78
合计	16,666.78

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,539.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,539.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.25
应付指数使用费	50,000.00
预提审计费	23,803.31
预提上市年费	29,752.78
合计	103,568.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,337,370.87	5,337,370.87
本期申购	5,866,952.56	5,866,952.56
本期赎回(以“-”号填列)	-6,417,548.67	-6,417,548.67
- 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	4,786,774.76	4,786,774.76

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,773,930.66	-3,062,155.40	1,711,775.26
本期利润	-34,870.87	-966,032.56	-1,000,903.43
本期基金份额交易产生的变动数	-492,956.03	328,010.98	-164,945.05
其中：基金申购款	5,316,903.32	-3,779,147.01	1,537,756.31
基金赎回款	-5,809,859.35	4,107,157.99	-1,702,701.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,246,103.76	-3,700,176.98	545,926.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	3,061.17
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	58.86
其他	9.50
合计	3,129.53

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	4,191,587.89
减：卖出股票成本总额	4,037,810.25

买卖股票差价收入	153,777.64
----------	------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末持有债券。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期末进行其他投资交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	36,852.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	36,852.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-966,032.56
——股票投资	-966,032.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-966,032.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,703.16
合计	9,703.16

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	11,804.34
银行间市场交易费用	-
合计	11,804.34

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	-
上市费	29,752.78
汇划费	560.00
指数使用费	100,000.00
律师费	26,666.62
持有人大会费用	6,666.60
合计	187,449.31

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,982.32	27,976.46
其中：支付销售机构的客户维护费	11,998.34	1,487.50

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,097.40	4,196.44

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	334,629.17	3,061.17	605,648.98	1,780.04

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	康得	2018	重大	17.08	-	-	3,955	62,984.26	67,551.40	-

	新	年 6 月 4 日	事项 停牌							
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大资产重组	37.99	-	-	1,400	87,356.93	53,186.00	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大资产重组	4.87	-	-	7,500	37,578.38	36,525.00	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	临时停牌	23.28		2018 年 7 月 10 日	24.11	1,500	48,245.17	34,920.00
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大资产重组	13.08	-	-	1,800	26,838.35	23,544.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券、权证和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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间

的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现对标指数的有效跟踪。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	334,629.17	-	-	-	-	-	334,629.17
清算备付金	1,352.00	-	-	-	-	-	1,352.00
存出保证金	1,048.10	-	-	-	-	-	1,048.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,051,731.61	5,051,731.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	40,930.20	40,930.20
应收利息	-	-	-	-	-	73.25	73.25
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	99.88	99.88
其他资产	-	-	-	-	-	16,666.78	16,666.78
资产总计	337,029.27	-	-	-	-	5,109,501.72	5,446,530.99
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,250.66	3,250.66

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,757.08	4,757.08
应付托管费	-	-	-	-	-	713.56	713.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,539.81	1,539.81
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	103,568.34	103,568.34
负债总计	-	-	-	-	-	113,829.45	113,829.45
利率敏感度缺口	337,029.27	-	-	-	-	-4,995,672.27	5,332,701.54
上年度末 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	405,533.44	-	-	-	-	-	405,533.44
清算备付金	13,404.85	-	-	-	-	-	13,404.85
存出保证金	1,018.60	-	-	-	-	-	1,018.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-6,683,346.42	6,683,346.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	54,142.07	54,142.07
应收利息	-	-	-	-	-	103.71	103.71
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	998.80	998.80
资产总计	419,956.89	-	-	-	-	-6,738,591.00	7,158,547.89
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	-	-	-	-	-	6,022.57	6,022.57
应付托管费	-	-	-	-	-	903.40	903.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,475.79	4,475.79
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	98,000.00	98,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	109,401.76	109,401.76
利率敏感度缺口	419,956.89	-	-	-	-	-6,629,189.24	7,049,146.13

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日, 本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日: 同), 银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息, 假定利率变动仅影响该类资产的未来收益, 而对其本身的公允价值无重大影响, 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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的股票, 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	5,051,731.61	94.73	6,683,346.42	94.81
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,051,731.61	94.73	6,683,346.42	94.81

注: 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%, 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%, 现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

6.4.13.4.3.2 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 (2018 年 6 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
	1. 业绩基准下跌 1%	-54,393.56	-71,654.57
	2. 业绩基准下跌 5%	-271,967.78	-358,272.85
	3. 业绩基准下跌 10%	-543,935.56	-716,545.70

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,051,731.61	92.75
	其中：股票	5,051,731.61	92.75
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	335,981.17	6.17
7	其他各项资产	58,818.21	1.08
8	合计	5,446,530.99	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	143,130.00	2.68
B	采矿业	20,277.00	0.38
C	制造业	3,299,283.45	61.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,674.00	0.69
F	批发和零售业	149,856.86	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	287,365.09	5.39
J	金融业	320,955.37	6.02
K	房地产业	348,941.72	6.54
L	租赁和商务服务业	82,914.48	1.55
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	64,594.84	1.21
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	53,186.00	1.00
S	综合	-	-
	合计	4,807,178.81	90.15

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	56,412.00	1.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	37,940.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	87,775.00	1.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	35,729.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,930.00	0.20
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	15,766.80	0.30
S	综合	-	-
	合计	244,552.80	4.59

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	000333	美的集团	7,956	415,462.32	7.79
2	000651	格力电器	8,632	406,998.80	7.63
3	000858	五粮液	3,317	252,092.00	4.73
4	002415	海康威视	5,771	214,277.23	4.02
5	000002	万科 A	6,800	167,280.00	3.14
6	000725	京东方 A	44,317	156,882.18	2.94
7	300498	温氏股份	6,500	143,130.00	2.68
8	000001	平安银行	14,060	127,805.40	2.40
9	002304	洋河股份	916	120,545.60	2.26
10	000538	云南白药	830	88,776.80	1.66
11	002024	苏宁易购	6,017	84,719.36	1.59
12	300059	东方财富	6,340	83,561.20	1.57
13	002027	分众传媒	8,664	82,914.48	1.55
14	002008	大族激光	1,514	80,529.66	1.51
15	000568	泸州老窖	1,205	73,336.30	1.38
16	002230	科大讯飞	2,250	72,157.50	1.35
17	000776	广发证券	5,334	70,782.18	1.33
18	002475	立讯精密	3,043	68,589.22	1.29
19	000338	潍柴动力	7,768	67,970.00	1.27
20	002450	康得新	3,955	67,551.40	1.27
21	002236	大华股份	2,941	66,319.55	1.24
22	000963	华东医药	1,350	65,137.50	1.22
23	002594	比亚迪	1,334	63,605.12	1.19
24	002142	宁波银行	3,786	61,673.94	1.16
25	300124	汇川技术	1,876	61,570.32	1.15
26	001979	招商蛇口	3,222	61,379.10	1.15
27	002466	天齐锂业	1,200	59,508.00	1.12
28	300003	乐普医疗	1,600	58,688.00	1.10
29	002456	欧菲科技	3,437	55,438.81	1.04
30	002739	万达电影	1,400	53,186.00	1.00
31	000063	中兴通讯	3,936	51,286.08	0.96
32	000423	东阿阿胶	948	51,011.88	0.96
33	002460	赣锋锂业	1,300	50,154.00	0.94

34	300408	三环集团	2,000	47,000.00	0.88
35	000895	双汇发展	1,776	46,904.16	0.88
36	002202	金风科技	3,547	44,834.08	0.84
37	000100	TCL 集团	15,190	44,051.00	0.83
38	300070	碧水源	2,992	41,678.56	0.78
39	300136	信维通信	1,300	39,949.00	0.75
40	000069	华侨城 A	5,494	39,721.62	0.74
41	002340	格林美	6,220	37,631.00	0.71
42	000413	东旭光电	6,200	37,572.00	0.70
43	000540	中天金融	7,500	36,525.00	0.68
44	000768	中航飞机	2,300	35,972.00	0.67
45	300024	机器人	2,055	35,757.00	0.67
46	000503	国新健康	1,100	34,958.00	0.66
47	300072	三聚环保	1,500	34,920.00	0.65
48	002572	索菲亚	1,000	32,180.00	0.60
49	002007	华兰生物	1,000	32,160.00	0.60
50	000425	徐工机械	7,300	30,952.00	0.58
51	002736	国信证券	3,100	28,210.00	0.53
52	000783	长江证券	5,195	28,208.85	0.53
53	002146	荣盛发展	3,200	27,936.00	0.52
54	300017	网宿科技	2,600	27,846.00	0.52
55	002508	老板电器	900	27,558.00	0.52
56	002405	四维图新	1,350	27,337.50	0.51
57	002271	东方雨虹	1,530	26,025.30	0.49
58	000786	北新建材	1,400	25,942.00	0.49
59	002129	中环股份	3,200	25,056.00	0.47
60	000630	铜陵有色	10,884	24,053.64	0.45
61	002310	东方园林	1,800	23,544.00	0.44
62	002092	中泰化学	2,400	23,136.00	0.43
63	000826	启迪桑德	1,311	22,916.28	0.43
64	000839	中信国安	4,593	21,724.89	0.41
65	000060	中金岭南	4,250	20,655.00	0.39
66	000792	盐湖股份	1,900	20,558.00	0.39
67	000983	西山煤电	2,700	20,277.00	0.38
68	002065	东华软件	2,300	19,780.00	0.37
69	002074	国轩高科	1,200	16,872.00	0.32
70	000402	金融街	2,000	16,100.00	0.30
71	002422	科伦药业	500	16,050.00	0.30
72	300433	蓝思科技	700	14,686.00	0.28

73	002081	金螳螂	1,300	13,130.00	0.25
74	000938	紫光股份	200	12,520.00	0.23
75	000050	深天马 A	500	7,110.00	0.13
76	002049	紫光国微	100	4,412.00	0.08
77	000709	河钢股份	1,200	3,540.00	0.07
78	002673	西部证券	200	1,510.00	0.03
79	002500	山西证券	200	1,348.00	0.03
80	000728	国元证券	100	740.00	0.01
81	002797	第一创业	100	677.00	0.01
82	000876	新希望	100	634.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	600030	中信证券	3,400	56,338.00	1.06
2	300413	快乐购	1,000	37,940.00	0.71
3	601688	华泰证券	2,100	31,437.00	0.59
4	601888	中国国旅	400	25,764.00	0.48
5	600196	复星医药	600	24,834.00	0.47
6	603589	口子窖	400	24,580.00	0.46
7	002343	慈文传媒	840	15,766.80	0.30
8	603099	长白山	1,000	10,930.00	0.20
9	600138	中青旅	500	9,965.00	0.19
10	600104	上汽集团	200	6,998.00	0.13

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	199,967.00	2.84
2	002230	科大讯飞	147,813.00	2.10
3	002736	国信证券	142,501.00	2.02
4	601688	华泰证券	138,420.00	1.96
5	300498	温氏股份	123,832.00	1.76

6	600028	中国石化	99,152.00	1.41
7	000858	五粮液	91,471.00	1.30
8	603589	口子窖	82,310.00	1.17
9	601111	中国国航	70,550.00	1.00
10	002146	荣盛发展	67,506.00	0.96
11	000338	潍柴动力	64,704.00	0.92
12	300433	蓝思科技	58,047.00	0.82
13	000876	新希望	57,726.00	0.82
14	600782	新钢股份	56,660.00	0.80
15	600196	复星医药	55,348.00	0.79
16	300059	东方财富	54,940.00	0.78
17	601328	交通银行	52,074.00	0.74
18	002572	索菲亚	51,963.00	0.74
19	002797	第一创业	51,451.00	0.73
20	601888	中国国旅	48,303.00	0.69

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002230	科大讯飞	192,757.00	2.73
2	000858	五粮液	179,871.00	2.55
3	300498	温氏股份	149,472.00	2.12
4	603589	口子窖	142,961.00	2.03
5	002736	国信证券	139,276.26	1.98
6	600030	中信证券	128,228.00	1.82
7	000651	格力电器	98,886.00	1.40
8	600028	中国石化	97,784.00	1.39
9	601688	华泰证券	95,569.00	1.36
10	300336	新文化	89,418.00	1.27
11	300059	东方财富	84,356.00	1.20
12	000568	泸州老窖	77,023.00	1.09
13	000338	潍柴动力	71,764.00	1.02
14	601111	中国国航	65,921.00	0.94

15	000333	美的集团	62,028.00	0.88
16	601888	中国国旅	57,809.00	0.82
17	002343	慈文传媒	57,484.00	0.82
18	002241	歌尔股份	54,983.92	0.78
19	600782	新钢股份	53,880.00	0.76
20	000792	盐湖股份	53,699.00	0.76

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,372,228.00
卖出股票收入（成交）总额	4,191,587.89

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未投资债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未投资债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,048.10
2	应收证券清算款	40,930.20
3	应收股利	-
4	应收利息	73.25
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	16,666.78
8	其他	-
9	合计	58,818.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
249	19,224.00	287,747.40	6.01%	4,499,027.36	93.99%

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	上海市物资住宅公司	258,233.00	35.77%
2	武善云	138,200.00	19.14%
3	茹伟	57,100.00	7.91%
4	钟福伟	50,800.00	7.04%
5	毛维贤	32,108.00	4.45%
6	刘玉坤	30,003.00	4.16%
7	李静	29,300.00	4.06%
8	华海南	27,300.00	3.78%
9	冯红	15,000.00	2.08%
10	黄工贝	10,000.00	1.39%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	100.00	0.0021%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 3 月 9 日) 基金份额总额	385,199,023.48
本报告期期初基金份额总额	5,337,370.87
本报告期基金总申购份额	5,866,952.56
减:本报告期基金总赎回份额	6,417,548.67
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	4,786,774.76

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2018 年 5 月 12 日东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会以通讯方式召开, 大会审议并通过《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 转型有关事项的议案》, 内容包括东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略和修订基金合同等事项。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动:

2018 年 4 月 3 日, 徐军女士因工作调动辞去公司督察长职务, 由吕晖先生担任公司督察长职务, 同时吕晖先生辞去其所担任的公司副总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》, 上海证监局对公司采取责令改正的决定。公司高度重视, 按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程, 针对性的制定、落实整改措施, 并将及时向监管部门提交整改报告。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	3,374,315.84	44.61%	3,075.06	44.30%	-
恒泰证券	2	2,760,594.30	36.50%	2,535.63	36.53%	-
兴业证券	1	926,029.75	12.24%	862.38	12.42%	-
国信证券	1	502,876.00	6.65%	468.37	6.75%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

本基金本报告期新增 2 个交易单元，分别为天风证券和国泰君安。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2017 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）	2018 年 1 月 2 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	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）	2018 年 1 月 10 日
3	东吴基金管理有限公司关于参加南京苏宁基金销售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）	2018 年 1 月 10 日
4	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2017 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2018 年 1 月 19 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在大泰金石基金销售有限公司的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）	2018 年 1 月 31 日

		网)	
6	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石基金销售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)	2018 年 1 月 31 日
7	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海利得基金销售有限公司的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)	2018 年 2 月 5 日
8	东吴基金管理有限公司关于参加上海利得基金销售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)	2018 年 2 月 5 日
9	东吴基金管理有限公司关于参加北京恒天明泽基金销售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)	2018 年 2 月 6 日
10	东吴基金管理有限公司关于修改东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同、托管协议的公告	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)	2018 年 3 月 26 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 3 月 30 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金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、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 3 月 30 日
13	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)	2018 年 3 月 30 日
14	东吴基金管理有限公司关于参加东海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)	2018 年 3 月 30 日

15	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2017 年年度报告以及摘要	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)	2018 年 3 月 31 日
16	东吴基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告	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)	2018 年 4 月 3 日
17	东吴基金管理有限公司关于公司副总理解聘的公告	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)	2018 年 4 月 3 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金惠家保险代理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)	2018 年 4 月 11 日
19	东吴基金管理有限公司关于参加金惠家保险代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、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 4 月 11 日
20	东吴基金管理有限公司关于工商变更登记的公告	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)	2018 年 4 月 14 日
21	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2018 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 4 月 19 日
22	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书以及摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 4 月 20 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有中兴通讯 (000063) 估值调整的公告	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)	2018 年 4 月 24 日
24	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴深证 100 指数增强	上海证券报、中国证券报、证券时报、公	2018 年 5 月 11 日

	型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会的公告	司网站、深交所 (巨潮资讯网)	
25	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会的第一次提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 5 月 14 日
26	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 5 月 15 日
27	东吴基金管理有限公司关于参加中国银河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)	2018 年 5 月 18 日
28	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 6 月 11 日
29	东吴基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	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)	2018 年 6 月 11 日
30	东吴基金管理有限公司关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2018 年 6 月 12 日
31	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	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)	2018 年 6 月 20 日
32	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	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)	2018 年 6 月 21 日
33	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	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)	2018 年 6 月 22 日
34	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中民财富基金销售 (上海) 有限公司为代销机构并推出定	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2018 年 6 月 22 日

	期定额业务及转换业务的公告	深交所 (巨潮资讯网)	
35	东吴基金管理有限公司关于参加中民财富基金销售 (上海) 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)	2018 年 6 月 22 日
36	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	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)	2018 年 6 月 29 日
37	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)	2018 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20180509-20180516	2,613,834.04	-	2,613,834.04	0.00	0.00%
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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;</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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;</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018 年 5 月 12 日东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议并通过《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 转型有关事项的议案》,内容包括东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略和修订基金合同等事项。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2018 年 8 月 29 日