

东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49

§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
§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	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴安盈量化
场内简称	-
基金主代码	002270
交易代码	002270
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	211,261,790.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用选股、择时量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。
业绩比较基准	65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	汤嵩彦
	联系电话	021-50509888-8308	95559
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tangsy@bankcomm.com

客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	95559
传真	021-50509888-8211	021-62701216
注册地址	上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200135	200120
法定代表人	王炯	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 2 月 3 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,437,170.98
本期利润	-4,409,162.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0278
本期加权平均净值利润率	-2.67%
本期基金份额净值增长率	4.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,856,713.15
期末可供分配基金份额利润	0.0419
期末基金资产净值	220,118,503.61
期末基金份额净值	1.042
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.20%

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、本基金成立于 2016 年 2 月 3 日，合同生效当期不是完整报告期。

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

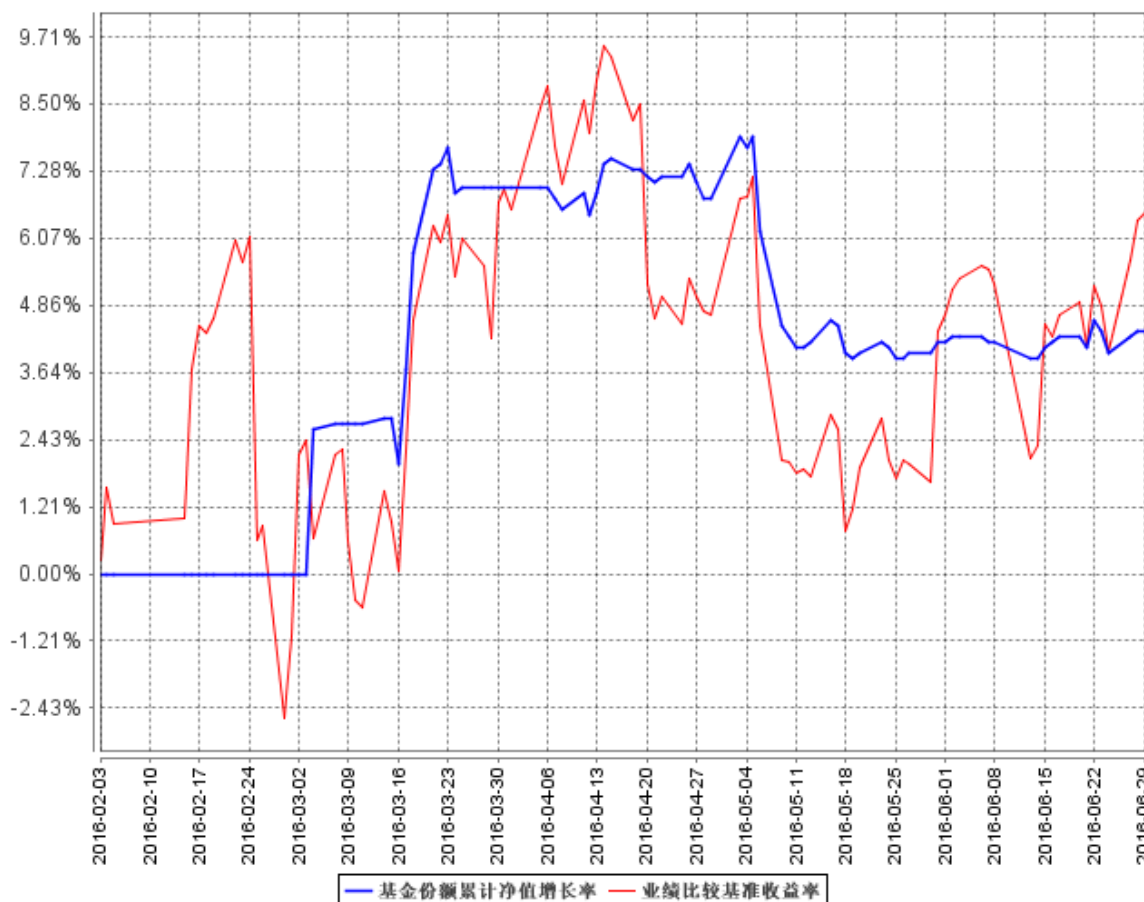
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.00%	0.20%	2.10%	1.01%	-2.10%	-0.81%
过去三个月	-2.62%	0.37%	-0.34%	1.08%	-2.28%	-0.71%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.51%	6.59%	1.32%	-2.39%	-0.81%

注：1、比较基准=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率。

2、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期。

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、比较基准=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率。

2、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期。

§ 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 日获证监基金字[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—上海市浦东新区源深路 279 号，统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生（集团）有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理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、以德兴业”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，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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着 23 只公募基金，27 只专户资产管理计划，137 只存续专项资产管理计划（子公司），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。

2016 年，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，在业内率先成立了绝对收益部，更加强化绝对收益理念。

经过多年积累和布局，公司已形成三大投研“特色”：1. 权益投资坚持自下而上精选优质成长股，把握中国经济转型升级机遇；2. 绝对收益首倡“用权益投资做绝对收益”的理念，利用量化模型进行择时和选股操作，严控回撤、优化收益；3. 固定收益回归稳健本源，兼顾流动性管理，为大类资产配置提供基础性产品。

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 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

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周健	本基金基金经理	2016年2月3日	-	9年	硕士，南开大学毕业。曾就职于海通证券；2011年5月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研究策划部研究员，现任基金经理，自2012年05月03日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自2013年6月5日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理、自2016年2月3日起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、自2016年2月5日起担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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，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。
秦斌	本基金基金经理助理	2016 年 2 月 3 日	-	7 年	秦斌同志，硕士，2009 年 07 月至 2015 年 6 月就职于东吴证券股份有限公司，历任研究所金融工程分析师、投资总部量化与衍生品交易研究员，2015 年 7 月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员，现任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、周健为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；

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，因赎回等原因，本基金在 2016 年 3 月 4 日至 2016 年 4 月 1 日连续二十一个交易日出现基金资产净值低于 5000 万元的情况，除此之外，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之

间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从 2 季度数据来看，经济出现小幅回升，这是预期之中的。但是细看指标，数据显示出经济动能仍然不足。首先是民间投资仍然落后，房地产投资见高回落；其次是通缩造成实际利率仍然处于高位，对实体投资和居民消费形成抑制；第三是外部冲击不断，全球化受阻，大环境不利于整体增长。在上述因素的作用之下，股票市场出现大幅波动，但并未引发系统性风险，震荡市的特征尤为明显。报告期内，本基金主要采用量化择时和选股策略，严格控制仓位，在日常的基金操作中积极应对申购赎回，并在个股配置上进行适度偏离，力争获得超额收益。

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 1.042 元，累计净值 1.042 元；本报告期份额净值增长率 4.20%，同期业绩比较基准收益率为 6.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段经济和市场运行形势，个人认为经济和市场面临的风险要大于机会。短期看，信贷刺激之后，经济阶段性企稳，但是负面效应是资产价格出现泡沫化，以煤炭、钢铁为首的原材料价格出现剧烈反弹，反而影响到供给侧改革的推进，投资渠道不畅导致政策空间被大大压缩。中长期来看，结构性改革的必要性不容置疑，但是考虑到短期稳增长的需求，又不能快速推进，这将拉长经济波动和出清的时间。市场方面，由于资金收益率快速下行，股市整体估值水平上升，资金的风险偏好却有下降的迹象，这体现在两个方面，一是创业板和成长股的量价萎靡，另一方面是市场开始更加关注消费品板块、高股息的类债券资产以及带有公用事业性质的 PPP 主题等，这种趋势对市场中长期走势偏负面。综上所述，在当前经济环境和股市估值水平下，短期还看不到风险爆发，所以市场上会有较多的结构性机会，但由于经济和股市的基本面问题，整体空间并不大。

随着年初大幅杀跌后，市场恐慌情绪逐渐消退，上半年沪指月线有 4 个月出现窄幅整理的星

线，千股跌停的恐慌逐渐被淡忘，市场进入正常运转模式，基准指数低点逐步抬高，两市成交量逐渐萎缩后开始缓慢放大，投资者及机构参与热情逐步恢复，随着 A 股市场赚钱效应的逐步体现，A 股市场的成交量能将逐步回升，下半年可操作的波段机会大概率增加。本基金将继续采用量化体系来操作，量化择时、选股及资金配置，在控制回撤的前提下力求将收益做到最大，努力为投资者实现单位风险收益上的最优化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司副总经理、运营负责人、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；运营负责人、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、合规风控业务相关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

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，因赎回等原因，本基金在 2016 年 3 月 4 日至 2016 年 4 月 1 日连续二十一个交易日出现基金资产净值低于 5000 万元的情况。

§ 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

2016 年上半年度，基金托管人在东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016 年上半年度，东吴基金管理有限公司在东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2016 年上半年度，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,149,643.77	-
结算备付金		5,700,435.74	-
存出保证金		140,135.70	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,943,254.28	-
其中：股票投资		32,195,883.68	-
基金投资		-	-
债券投资		12,747,370.60	-
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	124,600,452.30	-
应收证券清算款		28,930,128.52	-
应收利息	6.4.7.5	509,976.68	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,000,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		220,974,026.99	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		243,197.55	-
应付管理人报酬		266,973.65	-
应付托管费		44,495.60	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	175,267.77	-
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	125,588.81	-
负债合计		855,523.38	-
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	211,261,790.46	-
未分配利润	6.4.7.10	8,856,713.15	-
所有者权益合计		220,118,503.61	-
负债和所有者权益总计		220,974,026.99	-

注：1、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立。

2、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.042 元，基金份额总额 211,261,790.46 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年2月3日(基金	上年度可比期间 2015年1月1日至
-----	-----	--------------------	-----------------------

		合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 30 日
一、收入		-2,498,854.18	-
1.利息收入		1,108,799.76	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	334,298.46	-
债券利息收入		213,688.15	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		560,813.15	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,532,642.23	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,623,260.54	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-52,665.61	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	143,283.92	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,008.94	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	896,979.35	-
减：二、费用		1,910,307.86	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,002,371.76	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	167,062.01	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	611,439.13	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	129,434.96	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,409,162.04	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,409,162.04	-

注：本基金于 2016 年 2 月 3 日成立。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	211,164,009.95	-	211,164,009.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,409,162.04	-4,409,162.04
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)	97,780.51	13,265,875.19	13,363,655.70
其中：1.基金申购款	223,051,991.99	15,253,859.04	238,305,851.03
2.基金赎回款	-222,954,211.48	-1,987,983.85	-224,942,195.33
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)	211,261,790.46	8,856,713.15	220,118,503.61
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注：本基金于 2016 年 2 月 3 日成立。

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：

<u>王炯</u>	<u>吕晖</u>	<u>沈静</u>
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

东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2795 号文《关于准予东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 211,164,009.95 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国交通银行股份有限公司。

本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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期自 2016 年 2 月 3 日起至 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如报表日有成交价，应当以当日收盘价作为公允价值。活跃市场中的报价是指易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格。如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应当以最近交易日收盘价作为公允价值；如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应当在谨慎原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定公允价值。

(2) 金融工具不存在活跃市场的，本公司采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考计量日市场参与者在主要市场或最有利市场中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具当前的公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

6.4.4.6 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，且目前可执行该种法定权利，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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同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也可按直线法计算。

6.4.4.11 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 12 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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，

主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起营改增后，基金买卖股票、债券的差价收入免收增值税。

2、对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。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	11,149,643.77
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	11,149,643.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,995,384.43	32,195,883.68	200,499.25

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,919,860.91	12,747,370.60
	银行间市场	-	-
	合计	12,919,860.91	12,747,370.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	44,915,245.34	44,943,254.28	28,008.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	60,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	64,600,452.30	-
合计	124,600,452.30	-

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	10,516.60
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	2,308.59
应收债券利息	483,564.08
应收买入返售证券利息	13,430.71
应收申购款利息	100.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	56.70

合计	509,976.68
----	------------

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	167,622.57
银行间市场应付交易费用	7,645.20
合计	175,267.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	303.65
预提费用	125,285.16
合计	125,588.81

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	211,164,009.95	211,164,009.95
本期申购	223,051,991.99	223,051,991.99
本期赎回(以“-”号填列)	-222,954,211.48	-222,954,211.48
- 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	211,261,790.46	211,261,790.46

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	-	-	-
本期利润	-4,437,170.98	28,008.94	-4,409,162.04
本期基金份额交易产生的变动数	15,293,493.83	-2,027,618.64	13,265,875.19
其中：基金申购款	17,414,340.98	-2,160,481.94	15,253,859.04
基金赎回款	-2,120,847.15	132,863.30	-1,987,983.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,856,322.85	-1,999,609.70	8,856,713.15

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
活期存款利息收入	149,626.94
定期存款利息收入	66,888.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	115,946.08
其他	1,836.55
合计	334,298.46

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 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
卖出股票成交总额	370,220,781.93
减：卖出股票成本总额	374,844,042.47
买卖股票差价收入	-4,623,260.54

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	9,342,077.03
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	9,030,634.96
减:应收利息总额	364,107.68
买卖债券差价收入	-52,665.61

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末未进行权证投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	143,283.92

基金投资产生的股利收益	-
合计	143,283.92

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
1. 交易性金融资产	28,008.94
——股票投资	200,499.25
——债券投资	-172,490.31
——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	28,008.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
基金赎回费收入	896,979.31
其他	0.04
合计	896,979.35

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
交易所市场交易费用	611,439.13
银行间市场交易费用	-
合计	611,439.13

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	35,795.76
信息披露费	89,489.40
其他费用	400.00
银行汇划费用	2,249.80
帐户维护费	1,500.00
合计	129,434.96

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	776,988,235.18	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东吴证券股份有限公	27,572,708.82	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东吴证券股份有限公	3,913,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份有限 公司	171,970.42	100.00%	167,622.57	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
--	--	------	--	-------

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效 日)至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,002,371.76	-
其中：支付销售机构的客户维护费	49,030.36	-

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日) 至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	167,062.01	-

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期间基金管理人未持有本基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
活期存款利息收入	11,149,643.77	149,626.94	-	-

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016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的证券。

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
600577	精达股份	2016年5月3日	重大资产重组	4.18	-	-	92,600	400,032.00	387,068.00	-
600330	天通股份	2016年5月23日	重大资产重组	13.93	-	-	23,100	317,195.00	321,783.00	-

600237	铜峰电子	2016年6月30日	重大事项停牌	7.61	2016年7月7日	7.42	40,100	308,492.00	305,161.00	-
600764	中电广通	2016年6月20日	重大资产重组	26.89	-	-	4,800	99,264.00	129,072.00	-
000955	欣龙控股	2016年4月8日	重大资产重组	8.55	-	-	12,700	100,475.00	108,585.00	-
300356	光一科技	2016年5月26日	重大事项停牌	48.44	2016年8月10日	44.27	500	21,643.80	24,220.00	-
300176	鸿特精密	2016年4月27日	重大资产重组	30.20	-	-	600	19,512.35	18,120.00	-
002212	南洋股份	2016年5月3日	重大事项停牌	11.28	2016年8月17日	12.41	1,500	16,665.36	16,920.00	-
300242	明家联合	2016年5月9日	重大资产重组	34.55	2016年8月12日	36.69	300	9,429.14	10,365.00	-
000802	北京文化	2016年6月1日	重大资产重组	23.52	-	-	400	9,322.15	9,408.00	-
000948	南天信息	2016年6月28日	重大事项停牌	19.31	2016年7月12日	21.00	400	7,109.84	7,724.00	-
002059	云南旅游	2016年6月1日	重大事项停牌	8.56	-	-	599	5,342.09	5,127.44	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金主要通过灵活应用选股、择时量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

对于与债券投资相关的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。本基金的银行存款存放于本基金的托管行—交通银行股份有限公司。本基金认为与交通银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 40%。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	11,149,643.77	-	-	-	-	-	11,149,643.77
清算备付金	5,700,435.74	-	-	-	-	-	5,700,435.74
存出保证金	140,135.70	-	-	-	-	-	140,135.70
交易性金融资产	-	3,326,881.00	9,420,489.60	-	-	-32,195,883.68	44,943,254.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	124,600,452.30	-	-	-	-	-	124,600,452.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-28,930,128.52	28,930,128.52
应收利息	-	-	-	-	-	509,976.68	509,976.68
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	5,000,000.00	5,000,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	141,590,667.51	3,326,881.00	9,420,489.60	-	-	-66,635,988.88	220,974,026.99
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	243,197.55	243,197.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	266,973.65	266,973.65
应付托管费	-	-	-	-	-	44,495.60	44,495.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	175,267.77	175,267.77
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	125,588.81	125,588.81

负债总计	-	-	-	-	-	855,523.38	855,523.38
利率敏感度缺口	141,590,667.51	3,326,881.00	9,420,489.60	-	-	-65,780,465.50	220,118,503.61
上年度末 2015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							
负债							

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	利率下降 25 个基点	9,870.64	-
	利率上升 25 个基点	-9,839.19	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	32,195,883.68	14.63	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,195,883.68	14.63	-	-

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-318,511.47	-
	2. 业绩基准下跌 5%	-1,592,557.37	-
	3. 业绩基准下跌 10%	-3,185,114.75	-

注：报告期内，本基金 2016 年 beta 值为 0.14，该基金于 2016 年 2 月 3 日成立。

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	32,195,883.68	14.57
	其中：股票	32,195,883.68	14.57
2	固定收益投资	12,747,370.60	5.77

	其中：债券	12,747,370.60	5.77
	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	124,600,452.30	56.39
	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	16,850,079.51	7.63
7	其他各项资产	34,580,240.90	15.65
8	合计	220,974,026.99	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,406,279.90	1.55
C	制造业	22,137,014.97	10.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,910,435.10	1.32
F	批发和零售业	991,365.67	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	483,267.85	0.22
H	住宿和餐饮业	19,861.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	538,966.25	0.24
J	金融业	90,835.00	0.04
K	房地产业	138,595.20	0.06
L	租赁和商务服务业	159,471.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	815,591.10	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	5,127.44	0.00
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	18,896.00	0.01
S	综合	480,177.20	0.22
	合计	32,195,883.68	14.63

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601890	亚星锚链	76,800	698,112.00	0.32
2	600558	大西洋	95,400	434,070.00	0.20
3	000039	中集集团	30,400	430,768.00	0.20
4	600992	贵绳股份	34,600	427,310.00	0.19
5	603969	银龙股份	30,500	406,565.00	0.18
6	600577	精达股份	92,600	387,068.00	0.18
7	000733	振华科技	16,026	360,585.00	0.16
8	000701	厦门信达	20,300	357,889.00	0.16
9	002013	中航机电	26,200	353,176.00	0.16
10	603018	设计股份	12,100	349,206.00	0.16
11	600372	中航电子	17,700	344,619.00	0.16
12	600391	成发科技	8,900	342,205.00	0.16
13	600316	洪都航空	17,500	341,425.00	0.16
14	000532	力合股份	18,770	340,863.20	0.15
15	000823	超声电子	34,000	340,000.00	0.15
16	000738	中航动控	12,800	337,920.00	0.15
17	600685	中船防务	13,046	330,846.56	0.15
18	600150	中国船舶	14,800	329,448.00	0.15
19	600893	中航动力	9,400	325,710.00	0.15
20	600330	天通股份	23,100	321,783.00	0.15
21	601899	紫金矿业	95,300	321,161.00	0.15
22	601800	XD 中国交	30,000	315,900.00	0.14
23	601777	力帆股份	26,800	315,436.00	0.14
24	600237	铜峰电子	40,100	305,161.00	0.14
25	601898	中煤能源	56,800	293,088.00	0.13
26	601369	陕鼓动力	45,200	288,376.00	0.13
27	603936	博敏电子	6,100	285,846.00	0.13
28	002544	杰赛科技	8,900	285,423.00	0.13

29	601699	潞安环能	42,900	280,566.00	0.13
30	300123	太阳鸟	19,500	273,780.00	0.12
31	002116	中国海诚	18,400	273,424.00	0.12
32	000049	德赛电池	6,400	268,416.00	0.12
33	002179	中航光电	6,139	265,941.48	0.12
34	002025	航天电器	10,600	261,714.00	0.12
35	600068	XD 葛洲坝	44,100	256,662.00	0.12
36	600343	航天动力	10,650	253,257.00	0.12
37	600677	XD 航天通	13,600	250,920.00	0.11
38	600039	四川路桥	63,660	250,820.40	0.11
39	600118	中国卫星	7,400	248,640.00	0.11
40	600326	西藏天路	30,900	247,818.00	0.11
41	601390	中国中铁	35,000	243,950.00	0.11
42	002128	露天煤业	31,789	238,735.39	0.11
43	600188	XD 兖州煤	21,800	238,492.00	0.11
44	601669	中国电建	41,600	237,536.00	0.11
45	600348	阳泉煤业	36,700	233,779.00	0.11
46	300140	启源装备	10,400	230,880.00	0.10
47	600192	长城电工	21,000	225,120.00	0.10
48	600973	宝胜股份	28,140	221,743.20	0.10
49	600879	航天电子	13,200	205,656.00	0.09
50	600468	百利电气	14,300	202,345.00	0.09
51	600517	置信电气	21,200	201,612.00	0.09
52	002076	雪莱特	12,000	200,400.00	0.09
53	300456	耐威科技	2,900	196,475.00	0.09
54	600312	平高电气	12,500	195,750.00	0.09
55	002151	北斗星通	5,800	195,228.00	0.09
56	601179	中国西电	38,200	193,674.00	0.09
57	002056	横店东磁	11,000	187,000.00	0.08
58	601668	中国建筑	30,700	163,324.00	0.07
59	000561	烽火电子	14,400	160,128.00	0.07
60	600775	南京熊猫	10,700	159,965.00	0.07
61	000032	深桑达 A	10,323	157,838.67	0.07
62	600498	烽火通信	6,400	155,392.00	0.07
63	600776	东方通信	18,500	155,215.00	0.07
64	002374	丽鹏股份	22,462	153,864.70	0.07
65	000070	特发信息	5,800	152,076.00	0.07
66	002414	高德红外	5,577	150,411.69	0.07
67	002114	罗平锌电	5,400	147,204.00	0.07

68	600198	大唐电信	7,400	147,112.00	0.07
69	601968	宝钢包装	14,300	146,718.00	0.07
70	000868	安凯客车	18,800	143,068.00	0.06
71	002060	粤水电	20,800	142,896.00	0.06
72	002307	北新路桥	18,056	141,739.60	0.06
73	600686	金龙汽车	9,600	141,408.00	0.06
74	603128	华贸物流	14,403	141,293.43	0.06
75	600961	株冶集团	13,800	140,622.00	0.06
76	000060	中金岭南	13,400	139,762.00	0.06
77	300228	富瑞特装	8,200	139,400.00	0.06
78	600805	悦达投资	16,050	139,314.00	0.06
79	002191	劲嘉股份	12,000	139,080.00	0.06
80	600284	浦东建设	13,300	138,852.00	0.06
81	600362	江西铜业	10,200	137,496.00	0.06
82	002342	巨力索具	23,700	137,460.00	0.06
83	000813	天山纺织	11,200	136,528.00	0.06
84	000957	中通客车	3,000	136,200.00	0.06
85	600512	腾达建设	33,100	135,710.00	0.06
86	300263	隆华节能	12,100	135,278.00	0.06
87	002062	宏润建设	22,760	134,739.20	0.06
88	000630	铜陵有色	52,800	134,112.00	0.06
89	600303	曙光股份	9,000	133,650.00	0.06
90	000807	云铝股份	20,300	132,965.00	0.06
91	601028	玉龙股份	18,600	132,804.00	0.06
92	600074	保千里	8,875	132,415.00	0.06
93	601069	西部黄金	5,700	132,297.00	0.06
94	002628	成都路桥	18,870	131,523.90	0.06
95	000890	法尔胜	12,400	131,316.00	0.06
96	600489	中金黄金	11,600	130,384.00	0.06
97	000768	中航飞机	6,600	129,954.00	0.06
98	002141	蓉胜超微	4,300	129,860.00	0.06
99	600764	中电广通	4,800	129,072.00	0.06
100	600311	荣华实业	20,700	128,961.00	0.06
101	300215	电科院	10,000	128,800.00	0.06
102	600038	中直股份	3,100	128,588.00	0.06
103	600988	赤峰黄金	6,869	128,106.85	0.06
104	600531	豫光金铅	15,300	127,755.00	0.06
105	600820	隧道股份	15,200	127,528.00	0.06
106	300257	开山股份	7,700	127,204.00	0.06

107	600766	园城黄金	8,800	127,072.00	0.06
108	002487	大金重工	14,300	126,555.00	0.06
109	002155	湖南黄金	9,598	126,405.66	0.06
110	600379	宝光股份	6,410	125,443.70	0.06
111	002436	兴森科技	5,500	125,345.00	0.06
112	002547	春兴精工	11,300	124,978.00	0.06
113	600862	中航高科	8,800	124,784.00	0.06
114	002023	海特高新	7,200	124,776.00	0.06
115	002438	江苏神通	5,700	124,773.00	0.06
116	000951	中国重汽	13,050	124,758.00	0.06
117	601001	大同煤业	23,200	124,584.00	0.06
118	002660	茂硕电源	8,250	124,327.50	0.06
119	300279	和晶科技	2,600	123,474.00	0.06
120	600006	XD 东风汽	13,900	123,293.00	0.06
121	300161	华中数控	4,000	122,600.00	0.06
122	300069	金利华电	3,800	121,980.00	0.06
123	002103	广博股份	6,000	121,260.00	0.06
124	600213	亚星客车	9,500	121,220.00	0.06
125	300092	科新机电	7,913	121,068.90	0.06
126	600218	全柴动力	11,800	120,596.00	0.05
127	002446	盛路通信	3,800	120,308.00	0.05
128	002658	雪迪龙	6,900	119,991.00	0.05
129	002222	福晶科技	7,600	119,320.00	0.05
130	300131	英唐智控	10,100	119,281.00	0.05
131	002369	卓翼科技	10,600	119,250.00	0.05
132	000777	中核科技	5,000	117,800.00	0.05
133	000811	烟台冰轮	10,418	116,889.96	0.05
134	300470	日机密封	1,200	116,784.00	0.05
135	002491	通鼎互联	6,700	114,302.00	0.05
136	600960	渤海活塞	11,300	113,452.00	0.05
137	000530	大冷股份	10,600	112,996.00	0.05
138	000552	靖远煤电	32,100	112,992.00	0.05
139	601088	中国神华	8,000	112,560.00	0.05
140	601101	昊华能源	17,700	112,041.00	0.05
141	600502	安徽水利	15,200	112,024.00	0.05
142	601186	中国铁建	11,200	111,552.00	0.05
143	600395	盘江股份	13,500	111,510.00	0.05
144	600123	兰花科创	15,500	111,290.00	0.05
145	000983	西山煤电	13,500	110,025.00	0.05

146	000955	欣龙控股	12,700	108,585.00	0.05
147	600841	上柴股份	7,221	100,877.37	0.05
148	002598	山东章鼓	8,300	98,770.00	0.04
149	300034	钢研高纳	4,200	92,820.00	0.04
150	600765	中航重机	5,800	84,564.00	0.04
151	300024	机器人	3,300	83,787.00	0.04
152	000880	潍柴重机	6,099	83,251.35	0.04
153	600592	XD 龙溪股	7,900	82,318.00	0.04
154	603117	万林股份	4,300	80,410.00	0.04
155	603223	恒通股份	2,600	78,936.00	0.04
156	002338	奥普光电	1,177	72,326.65	0.03
157	600547	山东黄金	1,700	66,147.00	0.03
158	300114	中航电测	2,150	64,070.00	0.03
159	601727	上海电气	8,400	63,504.00	0.03
160	000026	飞亚达 A	5,500	62,865.00	0.03
161	601127	小康股份	2,605	62,181.35	0.03
162	002678	珠江钢琴	5,040	61,840.80	0.03
163	600612	老凤祥	1,500	61,275.00	0.03
164	600435	北方导航	4,500	59,895.00	0.03
165	600667	太极实业	5,800	57,942.00	0.03
166	002711	欧浦智网	3,800	56,620.00	0.03
167	002049	紫光国芯	1,200	52,740.00	0.02
168	000901	航天科技	1,300	52,195.00	0.02
169	600651	飞乐音响	4,100	51,906.00	0.02
170	002014	永新股份	3,200	51,040.00	0.02
171	000988	华工科技	2,500	50,125.00	0.02
172	600135	乐凯胶片	2,800	47,656.00	0.02
173	601633	长城汽车	5,500	46,420.00	0.02
174	600119	长江投资	2,800	42,532.00	0.02
175	600270	外运发展	2,408	42,115.92	0.02
176	600057	象屿股份	4,000	41,120.00	0.02
177	600787	中储股份	5,450	40,493.50	0.02
178	600676	交运股份	4,500	40,185.00	0.02
179	002243	通产丽星	3,100	39,525.00	0.02
180	300330	华虹计通	2,200	39,182.00	0.02
181	603021	山东华鹏	800	36,240.00	0.02
182	603600	永艺股份	600	36,000.00	0.02
183	603019	中科曙光	900	35,838.00	0.02
184	300518	盛讯达	741	34,715.85	0.02

185	600990	四创电子	400	34,676.00	0.02
186	002303	美盈森	2,800	34,412.00	0.02
187	600184	光电股份	1,500	33,960.00	0.02
188	601515	东风股份	3,000	33,900.00	0.02
189	603026	石大胜华	800	33,696.00	0.02
190	600180	瑞茂通	2,200	33,242.00	0.02
191	000922	佳电股份	3,300	32,010.00	0.01
192	600562	国睿科技	900	30,861.00	0.01
193	600416	湘电股份	2,200	27,434.00	0.01
194	600151	航天机电	2,400	27,120.00	0.01
195	300008	天海防务	800	26,640.00	0.01
196	600268	国电南自	3,300	25,014.00	0.01
197	000400	许继电气	1,600	24,704.00	0.01
198	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
199	300356	光一科技	500	24,220.00	0.01
200	000783	长江证券	2,000	23,200.00	0.01
201	300349	金卡股份	500	21,500.00	0.01
202	603958	哈森股份	1,455	21,097.50	0.01
203	600104	上汽集团	1,000	20,290.00	0.01
204	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
205	300101	振芯科技	700	19,551.00	0.01
206	000550	江铃汽车	800	19,488.00	0.01
207	000625	长安汽车	1,400	19,138.00	0.01
208	600418	江淮汽车	1,500	19,020.00	0.01
209	300066	三川智慧	1,900	18,601.00	0.01
210	600060	海信电器	1,048	18,528.64	0.01
211	300176	鸿特精密	600	18,120.00	0.01
212	601958	金钼股份	2,200	17,930.00	0.01
213	300371	汇中股份	493	17,738.14	0.01
214	002212	南洋股份	1,500	16,920.00	0.01
215	000016	深康佳 A	3,500	16,835.00	0.01
216	600698	湖南天雁	2,800	16,576.00	0.01
217	002210	飞马国际	800	16,272.00	0.01
218	000903	云内动力	2,000	16,060.00	0.01
219	600480	凌云股份	1,100	15,510.00	0.01
220	300259	新天科技	1,200	15,156.00	0.01
221	600459	贵研铂业	500	14,940.00	0.01
222	600523	贵航股份	800	14,864.00	0.01
223	300112	万讯自控	900	14,796.00	0.01

224	601198	东兴证券	600	14,664.00	0.01
225	600081	东风科技	900	14,553.00	0.01
226	300013	新宁物流	800	14,360.00	0.01
227	000030	富奥股份	2,000	14,340.00	0.01
228	002599	盛通股份	400	14,328.00	0.01
229	300306	远方光电	600	14,238.00	0.01
230	000581	威孚高科	700	14,112.00	0.01
231	600741	华域汽车	1,000	14,010.00	0.01
232	600794	保税科技	2,600	13,962.00	0.01
233	300007	汉威电子	500	13,960.00	0.01
234	002736	国信证券	800	13,800.00	0.01
235	601901	方正证券	1,800	13,788.00	0.01
236	600486	扬农化工	500	13,700.00	0.01
237	300397	天和防务	400	13,600.00	0.01
238	002214	大立科技	1,100	13,563.00	0.01
239	600470	六国化工	1,800	13,518.00	0.01
240	000751	锌业股份	2,400	13,272.00	0.01
241	002724	海洋王	600	13,236.00	0.01
242	002522	浙江众成	700	13,125.00	0.01
243	600482	中国动力	400	13,108.00	0.01
244	600687	刚泰控股	800	13,008.00	0.01
245	002673	西部证券	500	12,930.00	0.01
246	002237	恒邦股份	1,000	12,880.00	0.01
247	002150	通润装备	900	12,852.00	0.01
248	002245	澳洋顺昌	1,000	12,770.00	0.01
249	002585	双星新材	1,200	12,744.00	0.01
250	600141	兴发集团	1,100	12,672.00	0.01
250	600210	紫江企业	2,200	12,672.00	0.01
251	000792	盐湖股份	600	12,660.00	0.01
252	600458	时代新材	800	12,464.00	0.01
253	601211	国泰君安	700	12,453.00	0.01
254	002301	齐心集团	600	12,300.00	0.01
255	000801	四川九洲	988	12,172.16	0.01
256	600456	宝钛股份	600	12,072.00	0.01
257	600731	湖南海利	1,200	12,060.00	0.01
258	002080	中材科技	600	12,048.00	0.01
259	002240	威华股份	900	12,024.00	0.01
260	000758	中色股份	1,500	11,625.00	0.01
261	002400	省广股份	800	11,304.00	0.01

262	600096	云天化	1,200	11,160.00	0.01
263	603698	航天工程	400	10,976.00	0.00
264	300242	明家联合	300	10,365.00	0.00
265	000721	西安饮食	1,400	10,066.00	0.00
266	600536	中国软件	400	9,968.00	0.00
267	601618	中国中冶	2,700	9,963.00	0.00
268	002186	全聚德	500	9,795.00	0.00
269	002077	大港股份	436	9,679.20	0.00
270	600088	中视传媒	400	9,488.00	0.00
271	000802	北京文化	400	9,408.00	0.00
272	600386	北巴传媒	500	9,330.00	0.00
273	002401	中海科技	500	9,170.00	0.00
274	600845	宝信软件	400	8,924.00	0.00
275	000948	南天信息	400	7,724.00	0.00
276	600850	华东电脑	260	7,459.40	0.00
277	600718	东软集团	400	7,328.00	0.00
278	600189	吉林森工	600	6,798.00	0.00
279	002152	广电运通	400	6,576.00	0.00
280	000663	永安林业	500	6,440.00	0.00
281	601226	华电重工	700	6,419.00	0.00
282	600970	中材国际	900	5,670.00	0.00
283	002059	云南旅游	599	5,127.44	0.00
284	600658	电子城	400	4,132.00	0.00
285	600248	延长化建	660	4,026.00	0.00
286	601117	中国化学	700	3,871.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600677	航天通信	3,840,434.00	1.74
2	600343	航天动力	3,836,232.00	1.74
3	600118	中国卫星	3,823,448.50	1.74
4	000721	西安饮食	3,766,761.59	1.71
5	002186	全聚德	3,694,176.00	1.68
6	000733	振华科技	2,999,007.18	1.36

7	600992	贵绳股份	2,951,569.10	1.34
8	600558	大西洋	2,930,811.50	1.33
9	000039	中集集团	2,920,627.72	1.33
10	600685	XD 中船防	2,522,866.03	1.15
11	600150	中国船舶	2,520,862.00	1.15
12	300456	耐威科技	2,076,216.00	0.94
13	002151	北斗星通	2,071,652.40	0.94
14	000049	德赛电池	2,022,605.40	0.92
15	601668	中国建筑	2,003,240.00	0.91
16	601336	新华保险	1,859,085.00	0.84
17	601318	中国平安	1,856,373.00	0.84
18	601601	中国太保	1,854,350.89	0.84
19	601628	中国人寿	1,848,325.00	0.84
20	000532	力合股份	1,800,638.20	0.82

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000721	西安饮食	3,799,263.32	1.73
2	002186	全聚德	3,581,666.16	1.63
3	600343	航天动力	3,486,559.86	1.58
4	600118	中国卫星	3,475,783.00	1.58
5	600677	航天通信	3,455,256.43	1.57
6	000733	振华科技	2,630,097.34	1.19
7	000039	中集集团	2,448,677.90	1.11
8	600558	大西洋	2,437,018.06	1.11
9	600992	贵绳股份	2,373,278.55	1.08
10	600150	中国船舶	2,180,738.90	0.99
11	600685	XD 中船防	2,174,095.75	0.99
12	000702	正虹科技	1,865,453.50	0.85
13	002151	北斗星通	1,809,670.46	0.82
14	601336	新华保险	1,809,502.00	0.82
15	601318	中国平安	1,805,826.00	0.82
16	601668	中国建筑	1,798,735.00	0.82

17	000049	德赛电池	1,787,485.00	0.81
18	600639	浦东金桥	1,779,052.00	0.81
19	002049	紫光国芯	1,762,067.00	0.80
20	601601	中国太保	1,757,104.30	0.80

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	406,839,426.90
卖出股票收入（成交）总额	370,220,781.93

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

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	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,747,370.60	5.79
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	12,747,370.60	5.79

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112046	11 华孚 01	50,000	5,065,500.00	2.30
2	112050	11 报喜 01	43,170	4,354,989.60	1.98
3	122094	11 海正债	33,100	3,326,881.00	1.51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	140,135.70
2	应收证券清算款	28,930,128.52
3	应收股利	-
4	应收利息	509,976.68
5	应收申购款	5,000,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,580,240.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600577	精达股份	387,068.00	0.18	重大资产重组

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
329	642,133.10	189,959,977.03	89.92%	21,301,813.43	10.08%

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	4,627.73	0.0022%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年2月3日）基金份额总额	211,164,009.95
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	223,051,991.99
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	222,954,211.48
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	211,261,790.46

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2016年1月16日，吴永敏先生因退休不再担任公司董事长，由范力先生担任公司董事长。

2、2016 年 1 月 16 日，任少华先生因工作调动辞去公司总经理职务，由王炯先生担任公司总经理，同时王炯先生辞去其所担任的公司副总经理职务。

3、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。

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

本基金本报告期内无相关诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内聘用天衡会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金会计师事务所。

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

本基金本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	776,988,235.18	100.00%	171,970.42	100.00%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

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

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指

标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 1 个广发证券交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	27,572,708.82	100.00%	3,913,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月6日
2	东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告	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）	2016年1月16日
3	东吴基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告	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）	2016年1月16日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证	上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月18日

	券投资基金增加代销机构的公告		
5	东吴基金管理有限公司关于东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理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	2016 年 1 月 21 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石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	2016 年 1 月 21 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海联泰资产管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	2016 年 1 月 21 日
9	东吴基金管理有限公司关于参加上海联泰资产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	2016 年 1 月 21 日
10	东吴基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告	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）	2016 年 2 月 3 日
11	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 4 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中经北证（北京）资产管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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 2 月 19 日

	公告		
13	东吴基金管理有限公司关于参加中经北证（北京）资产管理有限 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	2016 年 2 月 19 日
14	东吴基金管理有限公司关于东吴 安盈量化灵活配置混合型证券投 资基金开放日常申购、赎回、转 换和定期定额投资业务的公告	上海证券报、证券时 报、公司网站	2016 年 3 月 2 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下 东吴安盈量化灵活配置混合型证 券投资基金参加部分代销机构网 上交易和定期定额投资申购费率 优惠活动的公告	上海证券报、证券时 报、公司网站	2016 年 3 月 2 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下 东吴安盈量化灵活配置混合型证 券投资基金在公司直销柜台开展 申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时 报、公司网站	2016 年 3 月 2 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下 基金新增北京钱景财富管理 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）	2016 年 3 月 22 日
18	东吴基金管理有限公司关于参加 北京钱景财富管理有限公司 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、 深交所（巨潮资讯 网）	2016 年 3 月 22 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下 基金新增珠海盈米财富管理有限	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证	2016 年 3 月 25 日

	公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	
20	东吴基金管理有限公司关于参加珠海盈米财富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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 3 月 25 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金参加东吴证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 13 日
22	东吴基金管理有限公司关于公司副总经理变更的公告	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）	2016 年 5 月 4 日
23	东吴基金管理有限公司关于网上交易系统招商银行支付渠道费率优惠调整的公告	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）	2016 年 5 月 24 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司转换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	2016 年 6 月 1 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货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）	2016 年 6 月 2 日

		网)	
26	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	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）	2016年6月8日
27	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）	2016年6月8日
28	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	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）	2016年6月13日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金延迟参与开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	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）	2016年6月14日
30	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业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	2016年6月27日
31	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长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、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年6月29日

32	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	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）	2016 年 6 月 30 日
----	--	---------------------------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴安盈量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。

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
2016 年 8 月 25 日