东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十九日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴阿尔法灵活配置混合
基金主代码	000531
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3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	251,652,050.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，坚持以大类资产轮动为主、金融衍生品对冲投资为辅的投资策略，在有效控制风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金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。在大类资产配置方面，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需及具体行业发展情况、证券市场估值水平等方面问题的深入研究，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，通过公司数量化模型确定资产配置比例并动态地优化管理。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。

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	吕晖	贺倩
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@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

2.4 信息披露方式

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

§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	6,845,608.00
本期利润	-16,085,395.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1078
本期基金份额净值增长率	3.95%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2018年6月30日)**
期末可供分配基金份额利润	0.0257
期末基金资产净值	331,315,333.52
期末基金份额净值	1.317

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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。

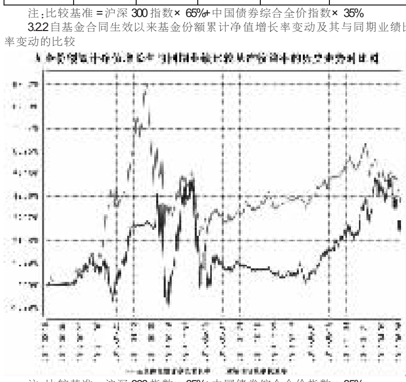
3.2 基金净值表现

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	-6.66%	2.10%	-4.86%	0.83%	-1.80%	1.27%
过去三个月	-13.13%	1.65%	-6.11%	0.74%	-7.02%	0.91%
过去六个月	3.95%	1.55%	-7.63%	0.75%	11.58%	0.80%
过去一年	19.73%	1.22%	-2.47%	0.62%	22.20%	0.60%
过去三年	1.54%	1.82%	-13.99%	0.97%	15.53%	0.85%
自基金合同生效起至今	31.70%	1.62%	43.79%	1.01%	-12.09%	0.61%

注：比较基准＝沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

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



注：比较基准＝沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

§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]132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184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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
程涛	公司总经理助理兼投资总监、基金经理	2018年2月27日	–	15年	博士，曾任联合证券有限责任公司投资银行部高级经理，泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理，农银汇理基金管理有限公司基金经理、投资部总经理；2013年3月起程涛同志加入东吴基金管理有限公司，曾任公司基金经理、总经理助理、首席投资官、专户投资总监等职，现任公司总经理助理兼投资总监、基金经理。其中，自2017年6月21日起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，自2018年2月27日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年4月19日起担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。其中，2013年8月1日至2015年2月6日任东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理，2013年8月1日至2015年2月6日任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理，2013年8月13日至2015年2月6日任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理，2014年3月19日至2015年4月14日任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王立立	权益投资部副总经理、基金经理	2014年6月14日	2018年3月3日	7年	硕士，复旦大学世界经济专业。2010年7月至2010年12月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理，2011年1月至2012年7月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员，自2012年7月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部行业研究员、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2015年2月6日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、自2015年5月29日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理。其中，2015年12月30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，2013年12月24日至2018年2月27日担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，2014年6月14日至2018年3月3日担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张能进	基金经理	2016年5月10日	2018年3月3日	10年	硕士，2007年7月至2009年11月就职于东北证券，任行业研究员，2009年11月加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，现任基金经理，自2018年2月27日起担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，其中，2016年5月10日至2018年3月3日担任东吴阿尔法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遵规守信情况的说明

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

4.3 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

今年上半年风险事件较多，一方面广义信用紧缩带来了经济下行的预期以及低等级主体的连环违约，周期股虽然中间有所反弹，但趋势向下；另一方面，贸易摩擦经过多番谈判，预期变化频繁，导致全球股市波动率快速上升，大幅增加了权益市场的风险溢价水平，导致市场追寻低风险确定性的股票。

在这样的背景下，一方面利率水平由于资金供求的改善和基本面下行预期快速下行，优质的具有确定性业绩增长和政策支撑的成长股受到追捧，导致了风格转换；另一方面，由于市场风险偏好较低，资金纷纷进入后周期的避险品种，如医药、休闲服务、食品饮料等抱团取暖，产生了一波行情。

从经济基本面上来看，一二季度总体经济平稳，名义GDP预估在10%以上；后半年在信用紧缩未完全对冲的情况下，仍有下行压力；但基于我国低库存、企业负债率降低的事实，不存在大幅下滑的基础。整体仍将是弱周期的调整。

该期间东吴阿尔法基金奉行绝对收益理念，操作注重风险收益比指标，使基金组合的收益与承担的风险互相匹配，对行业无明显的倾向，选股的方向为各个板块中成长性企业，在企业的真正成长阶段进行投资。

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1.317元；本报告期基金份额净值增长率为3.95%，业绩比较基准收益率为-7.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，市场短期仍将承压。货币政策已经微调预调，扩需求的措施也已经提上台面，但在资本金不足、非标回标、风险偏好较低以及金融稳杠杆的背景下，金融机构信用扩张的能力显著被限制，需要做更多的工作以及需要更多的时间去协调。而在中期的维度来看，贸易摩擦、全球经济回落、经济结构变化都是需要考量的因素。

在利率的典型下行期及信用紧缩的背景下，本基金将主线布局于业绩确定性强、信用风险可控、估值合理的优质成长股，根据市场的变化和基本面情况的变化适度参与避险类股票和周期类股票，兼顾风险和收益的平衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司副总经理、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；公司副总经理、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，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

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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2018年1月1日至2018年6月30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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	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	19,661,820.27	9,095,045.56
结算备付金	631,595.83	507,671.08
存出保证金	165,669.14	85,859.37
交易性金融资产	313,505,398.58	131,529,319.37
其中：股票投资	313,505,398.58	131,529,319.37
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	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	4,940.96	2,804.90
应收股利	–	–
应收申购款	447,340.96	29,372.85
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	334,416,765.74	141,250,073.13
负债和所有者权益	**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	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	2,022,826.44	6,056.47
应付管理人报酬	386,350.72	186,133.60
应付托管费	64,391.79	31,022.26
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	481,081.55	149,249.74
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	146,781.72	50,004.53
负债合计	3,101,432.22	422,466.60
所有者权益：		
实收基金	251,652,050.11	111,150,152.20
未分配利润	79,663,283.41	29,677,454.33
所有者权益合计	331,315,333.52	140,827,606.53
负债和所有者权益总计	334,416,765.74	141,250,073.13

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.317元，基金份额总额251,652,050.11份。

6.2 利润表

会计主体：东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-12,529,944.34	9,615,189.72
1.利息收入	96,661.60	60,135.55
其中：存款利息收入	96,661.60	60,135.55
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)	9,353,155.29	7,714,106.22
其中：股票投资收益	7,691,364.80	5,701,753.17
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	1,661,790.49	2,012,353.05
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-22,931,003.36	1,837,445.36
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	951,242.13	3,502.59
减：二、费用	3,555,451.02	1,992,824.97
1.管理人报酬	1,542,924.87	1,002,618.01
2.托管费	257,154.15	167,102.97
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	1,589,698.73	644,717.76
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	165,673.27	178,386.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-16,085,395.36	7,622,364.75
减：所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-16,085,395.36	7,622,364.75

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金

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)	111,150,152.20	29,677,454.33	140,827,606.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-16,085,395.36	-16,085,395.36
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)	140,501,897.91	66,071,224.44	206,573,122.35
其中：1.基金申购款	337,100,262.82	147,993,387.23	485,093,650.05
2.基金赎回款	-196,598,364.91	-81,922,162.79	-278,520,527.70
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)	251,652,050.11	79,663,283.41	331,315,333.52
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)	33,599,831.51	1,851,656.95	35,451,488.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	7,622,364.75	7,622,364.75
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)	110,207,622.00	4,911,395.67	115,119,017.67
其中：1.基金申购款	113,701,917.68	5,119,166.14	118,821,083.82
2.基金赎回款	-3,494,295.68	-207,770.47	-3,702,066.15
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)	143,807,453.51	14,385,417.37	158,192,870.88

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

东吴阿尔法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[2014]161号文《关于同意东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于2014年3月19日正式生效，首次设立募集规模为776,778,645.84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。

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、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(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金业绩比较基准＝沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

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〉》、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征增值税试点的通知》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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	1,542,924.87	1,002,618.01
其中：支付销售机构的客户维护费	320,354.26	52,620.95

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷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前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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 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	257,154.15	167,102.97

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×0.25%÷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前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2014年3月19日）持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	15,491,092.18	15,491,092.18
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	15,491,092.18	–
期末持有的基金份额	0.00	15,491,092.18
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	10.7700%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	19,661,820.27	83,481.85	17,332,938.99	55,600.09

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	313,505,398.58	93.75
	其中：股票	313,505,398.58	93.75
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	20,293,416.10	6.07
7	其他各项资产	617,951.06	0.18
8	合计	334,416,765.74	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	243,080,083.62	73.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	24,653,740.02	7.44
F	批发和零售业	45,771,574.94	13.82
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	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	313,505,398.58	94.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300476	胜宏科技	2,139,673	32,950,964.20	9.95
2	601799	星宇股份	523,055	31,325,763.95	9.45
3	002341	新纶科技	2,221,300	29,521,077.00	8.91
4	002589	瑞康医药	2,156,141	29,409,763.24	8.88
5	002430	杭氧股份	2,000,623	28,668,927.59	8.65
6	002632	道明光学	2,951,950	26,508,511.00	8.00
7	603688	石英股份	1,934,350	25,997,664.00	7.85
8	603359	东珠景观	1,140,321	24,653,740.02	7.44
9	002832	比音勒芬	605,640	22,408,680.00	6.76
10	300296	利亚德	1,399,295	18,022,919.60	5.44

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.scfund.com.cn的半年度报告正文。

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	300476	胜宏科技	34,384,655.49	24.42
2	002430	杭氧股份	32,978,568.46	23.42
3	300232	洲明科技	32,507,742.34	23.08
4	002589	瑞康医药	32,046,304.36	22.76
5	603688	石英股份	28,989,189.68	20.58
6	002341	新纶科技	28,837,156.65	20.48
7	300296	利亚德	28,774,307.32	20.43
8	601799	星宇股份	28,476,663.64	20.22
9	603359	东珠生态	27,582,826.89	19.59
10	002632	道明光学	27,203,390.00	19.32
11	002640	跨境通	25,798,372.38	18.32
12	002217	合力泰	25,519,451.96	18.12
13	002202	金风科技	24,636,406.08	17.49
14	002832	比音勒芬	22,912,235.92	16.27
15	002376	新北洋	22,493,899.47	15.97
16	002310	东方园林	20,412,563.26	14.49
17	002531	天顺风能	16,407,001.00	11.65
18	002043	兔宝宝	14,938,496.03	10.61
19	600522	中天科技	14,862,132.83	10.55
20	002127	南极电商	9,942,178.69	7.06
21	300470	日机密封	9,888,566.18	7.02
22	300199	翰宇药业	9,484,771.28	6.74
23	002717	岭南股份	9,317,589.80	6.62
24	002035	华帝股份	9,087,295.32	6.45
25	000651	格力电器	9,080,281.00	6.45
26	603338	浙江鼎力	8,652,250.00	6.14
27	000418	小天鹅A	8,425,311.68	5.98
28	000915	山大华特	7,503,204.16	5.33
29	002327	富安娜	7,119,321.32	5.06
30	600612	老凤祥	7,117,995.00	5.05
31	000963	华东医药	7,117,184.75	5.05
32	600708	光明地产	7,116,616.70	5.05
33	600755	厦门国贸	7,116,047.70	5.05
34	002002	鸿达兴业	7,113,450.60	5.05
35	000018	神州长城	7,109,761.00	5.05
36	002431	棕榈股份	6,367,651.27	4.52
37	000910	大亚圣象	6,096,788.00	4.33
38	002648	卫星石化	5,690,247.00	4.04
39	601155	新城控股	5,398,206.00	3.83

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	002217	合力泰	24,637,621.02	17.49
2	002202	金风科技	22,884,957.35	16.25
3	002376	新北洋	22,124,765.46	15.71
4	002310	东方园林	20,017,512.82	14.21
5	000651	格力电器	19,858,257.62	14.10
6	002035	华帝股份	19,396,537.93	13.77
7	002531	天顺风能	15,378,470.17	10.92
8	600522	中天科技	14,243,382.38	10.11
9	002043	兔宝宝	13,693,398.04	9.72
10	000333	美的集团	12,287,250.70	8.73
11	600755	厦门国贸	11,596,913.78	8.23
12	002127	南极电商	10,599,522.99	7.53
13	000036	华联控股	10,175,694.12	7.23
14	002713	东易日盛	9,851,483.00	7.00
15	002717	岭南股份	9,710,664.60	6.90
16	300199	翰宇药业	9,052,958.98	6.43
17	000921	海信科龙	9,041,861.97	6.42
18	600104	上汽集团	8,758,693.68	6.22
19	300232	洲明科技	8,586,958.03	6.10
20	000666	经纬纺机	8,489,717.89	6.03
21	603338	浙江鼎力	8,427,699.40	5.98
22	000418	小天鹅A	8,379,749.17	5.95
23	600383	金地集团	8,129,230.20	5.77
24	601225	陕西煤业	7,609,911.37	5.40
25	600153	建发股份	7,575,761.50	5.38
26	000915	山大华特	7,533,596.85	5.35
27	600340	华夏幸福	7,487,664.95	5.32
28	002327	富安娜	7,365,890.36	5.23
29	600612	老凤祥	7,324,541.00	5.20
30	600708	光明地产	7,308,445.94	5.19
31	000963	华东医药	6,973,855.00	4.95
32	600380	健康元	6,786,514.38	4.82
33	600657	信达地产	6,752,063.73	4.79
34	002002	鸿达兴业	6,676,499.10	4.74
35	000018	神州长城	6,664,147.23	4.73
36	300296	利亚德	6,497,726.31	4.61
37	002431	棕榈股份	6,375,461.00	4.53
38	000910	大亚圣象	6,268,755.00	4.45
39	600309	万华化学	6,266,290.00	4.45
40	600641	万业企业	6,102,509.20	4.33
41	600507	方大特钢	5,883,707.00	4.18
42	601155	新城控股	5,838,278.95	4.15
43	600690	青岛海尔	5,591,201.09	3.97
44	002648	卫星石化	5,497,433.07	3.90
45	600688	上海石化	5,373,996.00	3.82
46	002640	跨境通	4,981,063.00	3.54

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	659,773,255.40
卖出股票收入(成交)总额	462,557,537.63

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	165,669.14
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,940.96
5	应收申购款	447,340.96
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	617,951.06

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

本基金本报告期末前十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	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
14,086	17,865.40	146,065,792.32	58.04%	105,586,257.79	41.96%

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	1,653.20	0.0007%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：高级管理人员、基金投资和研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(2014年3月19日)基金份额总额	776,778,645.84
本报告期期初基金份额总额	111,150,152.20
本报告期基金总申购份额	337,100,262.82
减：本报告期基金总赎回份额	196,598,364.91
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	251,652,050.11

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：

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

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。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
中泰证券	2	667,531,967.86	59.53%	612,787.57	59.63%	–
长江证券	1	144,000,445.24	12.84%	131,227.61	12.77%	–
安信证券	2	95,972,869.89	8.56%	87,460.18	8.51%	–
国金证券	1	91,230,519.83	8.14%	83,139.14	8.09%	–
招商证券	1	59,195,907.70	5.28%	53,945.38	5.25%	–
东兴证券	1	26,922,596.98	2.40%	25,072.71	2.44%	–
申港证券	2	19,813,644.64	1.77%	18,453.49	1.80%	–
申银万国	1	16,738,478.70	1.49%	15,588.69	1.52%	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
首创证券	2	–	–	–	–	–
银河证券	1	–	–	–	–	–
宏源证券	1	–	–	–	–	–
华信证券	1	–	–	–	–	–
财通证券	2	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
国海证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	4	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
天风证券	2	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	2	–	–	–	–	–
中银国际	2	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	2	–	–	–	–	–
万联证券	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

本基金本报告期新增2个交易单元：申港证券、方正证券；退租2个交易单元：金元证券、国金证券。

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

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。

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180209–20180301	0.00	11,167,163.40	–	11,167,163.40	4.44%
	2	20180206–20180306	15,491,092.18	–	15,491,092.18	0.00	0.00%
	3	20180619–20180630	0.00	64,445,066.30	–	64,445,066.30	25.61%
	4	20180101–20180208	79,441,031.16	–	79,441,031.16	0.00	0.00%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司

2018年8月29日