东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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	东吴智慧医疗
基金主代码	002919
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月11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	204,330,865.44份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票，通过量化选股与择时相结合的方法，在充分控制基金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%×中证医疗指数收益率+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	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	3,269,197.99
本期利润	-3,396,932.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0153
本期基金份额净值增长率	-1.95%
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	-0.0956
期末基金资产净值	184,805,434.86
期末基金份额净值	0.904

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。

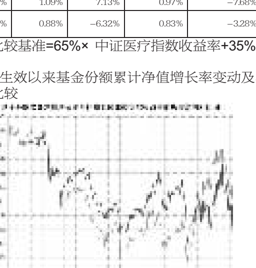
3.2 基金净值表现

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	-5.14%	1.85%	-5.01%	1.39%	-0.13%	0.46%
过去三个月	-0.88%	1.55%	-0.72%	1.18%	-0.16%	0.37%
过去六个月	-1.95%	1.36%	9.60%	1.12%	-11.55%	0.24%
过去一年	-0.55%	1.09%	7.13%	0.97%	-7.68%	0.12%
自基金合同生效起至今	-9.60%	0.88%	-6.32%	0.83%	-3.28%	0.05%

注：本基金业绩比较基准=65%× 中证医疗指数收益率+35%× 中债综合全价（总值）指数收益率

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：本基金业绩比较基准=65%× 中证医疗指数收益率+35%× 中债综合全价（总值）指数收益率

§ 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
周健	基金经理	2016年8月11日	–	11年	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。
秦斌	基金经理	2016年10月18日	–	8年	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、投资总部数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、基金经理助理，现任基金经理，其中自2016年7月7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、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年10月18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。

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，其他日期为对外公告日；

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

2018年，A股的宏观经济环境和资产定价环境呈现出历年少见的复杂性，年初地产产业链信号积极，工业品价格延续年底趋势继续上行，市场继续一轮通胀交易；之后中观数据显示原材料库存偏高，开工不强，市场在疑虑中呈现通缩交易的特点；3月下旬贸易战预期形成，A股市场避险交易特征明显；4-5月微观经济数据显著向上，市场一度呈现再次的通胀交易特征；但后来这一过程被信用环境的悲观预期及贸易战升温的预期打破，通缩交易叠加避险交易的特征再次上演。申万医药生物指数半年上涨3.11%，收高位风高浪大半年K线。

本基金严格按照量化模型在股票池内进行选股并结合择时模型进行仓位管理，由于选股加大了对个股基本面业绩确定性及市场一致预期的权重，且主线配置个股均集中于各个细分子行业龙头，业绩相对强弱企稳，逐步走出困局。

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0.904元；本报告期基金份额净值增长率为-1.95%，业绩比较基准收益率为9.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年中国经济的韧性特征比较显著，而美国加息周期的推进导致全球无风险收益率有震荡上行的趋势，此外，贸易摩擦的演进伴随外部环境的超预期变数叠加金融去杠杆带来信用环境二元化，在供给侧化解传统产能后，政策加快推动"工程师红利"的资产化，独角兽和CDR又给市场结构带来附加影响。在这几个因素的共振影响下，A股市场呈现周期性修正与系统性折价并存的过程。

展望下半年，随着经济增长外部环境的不确定性已显著上升，社融存量增速的下降，信用市场二元化趋势的扩大，可预期国内政策的边际调整是大概率事件。

A股市场生态悄然发生变化，供给侧改革提升上市公司质量导致小盘绩差股风险偏好趋势下降，去杠杆、紧信用，龙头公司具备更稳健经营杠杆、更充沛现金流，业绩马太效应进一步放大；中国资本市场开放提速，A股融入全球，在横向比较的估值体系下，A股龙头公司仍具备低估优势。

过去的一年，"一九"效应显著，随着市场生态逐步改善，市场结构有望往"二八"、"三七"切换，作为量化系基金有望突出重围。

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：东吴智慧医疗量化策略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	30,664,233.26	48,063,478.97
结算备付金	2,481,645.41	1,190,377.93
存出保证金	865,939.89	609,608.77
交易性金融资产	161,603,739.42	190,291,721.15
其中：股票投资	161,603,739.42	190,291,721.15
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	7,057.83	12,268.49
应收股利	–	–
应收申购款	6,090.86	1,687.35
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	195,628,706.67	240,169,142.66
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	10,027,396.69	13,293,392.18
应付赎回款	14,370.79	587,444.14
应付管理人报酬	232,641.51	289,858.37
应付托管费	38,773.59	48,309.71
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	381,131.03	142,528.75
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	128,958.20	61,104.19
负债合计	10,823,271.81	14,422,637.34
所有者权益：		
实收基金	204,330,865.44	244,958,168.46
未分配利润	-19,525,430.58	-19,211,663.14
所有者权益合计	184,805,434.86	225,746,505.32
负债和所有者权益总计	195,628,706.67	240,169,142.66

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.904元，基金份额总额204,330,865.44份。

6.2 利润表

会计主体：东吴智慧医疗量化策略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	1,674,912.60	-11,670,003.67
1.利息收入	213,053.31	487,030.48
其中：存款利息收入	213,053.31	390,605.01
债券利息收入	–	87.67
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	96,337.80
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	8,097,580.85	-28,135,301.52
其中：股票投资收益	7,221,881.28	-29,131,225.40
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	29,912.33
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	875,699.57	966,011.55
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-6,666,130.52	15,889,690.86
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	30,408.96	88,576.51
减：二、费用	5,071,845.13	4,221,331.11
1. 管理人报酬	1,498,026.90	2,422,257.14
2. 托管费	249,671.13	403,709.51
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	3,166,558.10	1,238,266.64
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	157,589.00	157,097.82
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-3,396,932.53	-15,891,334.78
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-3,396,932.53	-15,891,334.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴智慧医疗量化策略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）	244,958,168.46	-19,211,663.14	225,746,505.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-3,396,932.53	-3,396,932.53
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）	-40,627,303.02	3,083,165.09	-37,544,137.93
其中：1.基金申购款	2,151,269.36	-185,747.31	1,965,522.05
2.基金赎回款	-42,778,572.38	3,268,912.40	-39,509,659.98
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）	204,330,865.44	-19,525,430.58	184,805,434.86

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）	379,636,245.83	-17,259,123.59	362,377,122.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-15,891,334.78	-15,891,334.78
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）	-62,874,697.05	4,316,131.81	-58,558,565.24
其中：1.基金申购款	1,685,898.87	-108,905.43	1,576,993.44
2.基金赎回款	-64,560,595.92	4,425,037.24	-60,135,558.68
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）	316,761,548.78	-28,834,326.56	287,927,222.22

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

东吴智慧医疗量化策略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"）证监基金字[2016]627号《关于同意东吴智慧医疗量化策略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2016年8月11日正式生效，首次设立募集规模为556,759,946.47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（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）。

本基金的业绩比较基准为：65%× 中证医疗指数收益率+35%× 中债综合全价（总值）指数收益率。

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 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 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	3,894,841,188.76	100.00%	1,489,906,206.58	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	–	–	1,030,000.00	100.00%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 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	857,848.76	100.00%	381,131.03	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	324,767.28	100.00%	182,542.10	100.00%

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

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	1,498,026.90	2,422,257.14
其中：支付销售机构的客户维护费	769,178.49	1,233,467.51

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

H=E× 1.50%÷ 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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	249,671.13	403,709.51

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

本基金本报告期期间基金管理人未持有本基金份额。

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。

6.4.8.5 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	30,664,233.26	182,665.83	87,594,464.76	380,458.82

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。

6.4.9 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	–
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	–
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	–

6.4.9.2 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
603939	益丰药房	2018年4月17日	重大资产重组	59.72	2018年7月16日	65.69	35,314	2,060,017.50	2,108,952.08	–
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大资产重组	16.60	2018年7月31日	16.50	26,700	433,074.00	443,220.00	–

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	161,603,739.42	82.61
	其中：股票	161,603,739.42	82.61
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	33,145,878.67	16.94
7	其他各项资产	879,088.58	0.45
8	合计	195,628,706.67	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	120,725,089.85	65.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.04
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	13,762,762.42	7.45
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	5,692,733.00	3.08
J	金融业	2,482,844.00	1.34
K	房地产业	1,968,000.00	1.06
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	81,226.14	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	16,256,424.16	8.80
R	文化、体育和娱乐业	563,100.00	0.30
S	综合	–	–
	合计	161,603,739.42	87.45

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	600276	恒瑞医药	110,680	8,385,116.80	4.54
2	600196	复星医药	167,215	6,921,028.85	3.75
3	600867	通化东宝	282,128	6,762,608.16	3.66
4	300015	爱尔眼科	201,898	6,519,286.42	3.53
5	000661	长春高新	28,400	6,466,680.00	3.50
6	600332	白云山	168,900	6,426,645.00	3.48
7	002737	葵花药业	277,469	6,001,654.47	3.25
8	600566	济川药业	121,804	5,869,734.76	3.18
9	600521	华海药业	189,685	5,062,692.65	2.74
10	600529	山东药玻	204,323	4,971,178.59	2.69

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	600276	恒瑞医药	53,695,559.30	23.79
2	000963	华东医药	53,628,396.18	23.76
3	600196	复星医药	52,318,673.81	23.18
4	300015	爱尔眼科	47,537,910.82	21.06
5	000661	长春高新	40,576,423.63	17.97
6	600566	济川药业	38,745,917.18	17.16
7	300003	乐普医疗	37,898,516.97	16.79
8	600867	通化东宝	32,820,116.50	14.54
9	600521	华海药业	32,793,522.41	14.53
10	002044	美年健康	30,308,742.83	13.43
11	300347	泰格医药	29,907,874.17	13.25
12	600056	中国医药	29,515,431.09	13.07
13	600436	片仔癀	29,326,693.42	12.99
14	601607	上海医药	28,686,803.22	12.71
15	002262	恩华药业	28,169,016.02	12.48
16	603883	老百姓	24,108,413.02	10.68
17	000513	丽珠集团	23,010,095.46	10.19
18	600690	青岛海尔	22,745,646.99	10.08
19	000538	云南白药	22,647,403.65	10.03
20	603658	安图生物	21,949,139.20	9.72
21	300188	美亚柏科	21,394,704.71	9.48
22	002223	鱼跃医疗	19,883,929.42	8.81
23	000999	华润三九	19,566,177.50	8.67
24	600332	白云山	19,378,304.75	8.58
25	601318	中国平安	18,849,870.24	8.35
26	300463	迈克生物	17,606,606.03	7.80
27	002332	仙琚制药	17,419,456.49	7.72
28	002294	信立泰	17,150,202.09	7.60
29	002422	科伦药业	16,699,499.34	7.40
30	600285	羚锐制药	16,305,518.61	7.22
31	601336	新华保险	16,303,655.00	7.22
32	600570	恒生电子	16,091,882.01	7.13
33	002007	华兰生物	15,847,580.00	7.02
34	300009	安科生物	15,575,015.80	6.90
35	600062	华润双鹤	15,241,401.84	6.75
36	600031	三一重工	15,179,543.50	6.72
37	300124	汇川技术	14,909,084.04	6.60
38	002439	启明星辰	14,768,552.30	6.54
39	300482	万孚生物	14,519,554.00	6.43
40	002142	宁波银行	14,449,555.84	6.40
41	603993	洛阳钼业	14,195,320.00	6.29
42	600529	山东药玻	13,762,895.30	6.10
43	603019	中科曙光	13,518,847.90	5.99
44	002405	四维图新	13,446,350.38	5.96
45	002737	葵花药业	13,405,147.19	5.94
46	603939	益丰药房	12,993,735.90	5.76
47	300024	机器人	12,601,385.20	5.58
48	600446	金证股份	12,528,400.39	5.55
49	600518	康美药业	12,471,972.86	5.52
50	600588	用友网络	12,387,531.52	5.49
51	000423	东阿阿胶	11,481,969.60	5.09
52	300170	汉得信息	11,146,519.00	4.94
53	600519	贵州茅台	10,872,438.60	4.82
54	300630	普利制药	10,841,404.10	4.80
55	600216	浙江医药	10,683,131.00	4.73
56	300357	我武生物	10,556,501.35	4.68
57	300136	信维通信	10,460,386.00	4.63
58	300529	健帆生物	10,419,120.29	4.62
59	000425	徐工机械	10,301,174.64	4.56
60	300122	智飞生物	10,022,175.00	4.44
61	300558	贝达药业	9,461,588.00	4.19
62	601939	建设银行	9,288,339.00	4.11
63	600845	宝信软件	9,174,372.35	4.06
64	600535	天士力	9,154,085.40	4.06
65	600038	中直股份	9,049,983.00	4.01
66	300336	新文化	8,700,051.00	3.85
67	601398	工商银行	8,515,194.00	3.77
68	600999	招商证券	8,339,381.00	3.69
69	002095	生意宝	8,322,814.87	3.69
70	601003	柳钢股份	8,319,547.00	3.69
71	603368	柳药股份	8,309,453.24	3.68
72	002727	一心堂	8,112,765.30	3.59
73	300212	易华录	8,042,667.00	3.56
74	000858	五粮液	7,652,721.00	3.39
75	300271	华宇软件	7,614,690.00	3.37
76	002217	合力泰	7,482,707.91	3.31
77	300367	东方网力	7,379,746.00	3.27
78	000063	中兴通讯	7,317,875.01	3.24
79	600329	中新药业	7,263,974.10	3.22
80	002410	广联达	7,239,839.00	3.21
81	000636	风华高科	7,106,661.60	3.15
82	603387	基蛋生物	7,065,826.80	3.13
83	002050	三花智控	6,812,076.00	3.02
84	002589	瑞康医药	6,709,262.00	2.97
85	600594	益佰制药	6,537,533.00	2.90
86	300244	迪安诊断	6,520,870.80	2.89
87	300036	超图软件	6,438,516.31	2.85
88	000977	浪潮信息	6,369,710.16	2.82
89	600763	通策医疗	6,259,440.00	2.77
90	300302	同有科技	6,052,402.63	2.68
91	603799	华友钴业	5,722,299.00	2.53
92	002343	慈文传媒	5,707,374.88	2.53
93	002008	大族激光	5,678,822.66	2.52
94	300199	翰宇药业	5,595,073.00	2.48
95	002016	世荣兆业	5,578,338.00	2.47
96	002042	华孚时尚	5,556,019.00	2.46
97	300296	利亚德	5,529,144.00	2.45
98	002475	立讯精密	5,213,318.53	2.31
99	002415	海康威视	5,204,007.00	2.31
100	300059	东方财富	5,199,501.66	2.30
101	300316	晶盛机电	5,187,988.94	2.30
102	300054	鼎龙股份	5,104,986.00	2.26
103	600976	健民集团	5,003,825.06	2.22
104	300014	亿纬锂能	4,915,149.00	2.18
105	000786	北新建材	4,782,811.00	2.12
106	603108	润达医疗	4,730,026.60	2.10
107	600511	国药股份	4,681,948.00	2.07
108	601766	中国中车	4,674,935.00	2.07
109	002020	京新药业	4,620,740.00	2.05
110	600702	舍得酒业	4,563,059.25	2.02

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	000963	华东医药	55,976,901.27	24.80
2	600276	恒瑞医药	50,279,315.39	22.27
3	600196	复星医药	45,251,623.78	20.05
4	300015	爱尔眼科	44,181,250.05	19.57
5	000661	长春高新	40,041,783.69	17.74
6	300003	乐普医疗	38,483,418.25	17.05
7	600566	济川药业	37,660,949.50	16.68
8	600867	通化东宝	37,128,038.65	16.45
9	600056	中国医药	36,327,101.58	16.09
10	600521	华海药业	31,374,821.89	13.90
11	601607	上海医药	31,306,622.33	13.87
12	002044	美年健康	30,296,700.06	13.42
13	600436	片仔癀	30,142,351.94	13.35
14	300347	泰格医药	29,398,178.61	13.02
15	000538	云南白药	28,289,360.39	12.53
16	000513	丽珠集团	27,443,499.46	12.16
17	603883	老百姓	25,219,168.54	11.17
18	002262	恩华药业	25,054,101.37	11.10
19	300188	美亚柏科	22,639,203.84	10.03
20	000999	华润三九	22,514,748.30	9.97
21	600690	青岛海尔	22,426,748.61	9.93
22	600062	华润双鹤	20,314,584.15	9.00
23	603658	安图生物	19,230,621.65	8.52
24	002294	信立泰	18,830,009.24	8.34
25	601318	中国平安	18,768,218.98	8.31
26	300009	安科生物	18,172,601.83	8.05
27	601336	新华保险	17,215,224.20	7.63
28	002332	仙琚制药	16,485,892.83	7.30
29	002223	鱼跃医疗	15,768,718.56	6.99
30	002439	启明星辰	15,693,804.91	6.95
31	600570	恒生电子	15,682,579.98	6.95
32	300124	汇川技术	15,604,783.98	6.91
33	002142	宁波银行	15,564,516.65	6.89
34	603993	洛阳钼业	15,048,133.00	6.67
35	600285	羚锐制药	14,992,816.23	6.64
36	600031	三一重工	14,906,741.64	6.60
37	002007	华兰生物	14,295,068.28	6.33
38	300463	迈克生物	13,989,898.53	6.20
39	002405	四维图新	13,137,378.20	5.82
40	603019	中科曙光	12,962,658.00	5.74
41	600588	用友网络	12,830,513.98	5.68
42	600038	中直股份	12,781,091.80	5.66
43	000423	东阿阿胶	12,709,265.31	5.63
44	002422	科伦药业	12,586,709.05	5.58
45	600518	康美药业	12,462,440.06	5.52
46	300024	机器人	12,415,829.06	5.50
47	603939	益丰药房	12,383,959.35	5.49
48	600446	金证股份	12,280,651.87	5.44
49	600332	白云山	12,112,182.31	5.37
50	300357	我武生物	11,631,098.66	5.15
51	300482	万孚生物	11,421,946.54	5.06
52	600845	宝信软件	10,614,620.90	4.70
53	300170	汉得信息	10,459,783.00	4.63
54	600216	浙江医药	10,341,628.20	4.58
55	300136	信维通信	10,295,576.28	4.56
56	000425	徐工机械	10,022,621.00	4.44
57	300529	健帆生物	9,974,285.52	4.42
58	600535	天士力	9,771,826.40	4.33
59	600529	山东药玻	9,759,642.05	4.32
60	600519	贵州茅台	9,404,817.00	4.17
61	300336	新文化	9,380,118.00	4.16
62	002727	一心堂	9,339,678.76	4.14
63	600999	招商证券	9,002,161.00	3.99
64	300122	智飞生物	8,935,813.00	3.96
65	300558	贝达药业	8,877,422.58	3.93
66	601003	柳钢股份	8,613,198.00	3.82
67	300630	普利制药	8,562,528.76	3.79
68	601939	建设银行	8,528,823.00	3.78
69	002095	生意宝	8,367,974.00	3.71
70	000063	中兴通讯	8,324,389.80	3.69
71	300212	易华录	8,175,222.40	3.62
72	300367	东方网力	8,074,633.03	3.58
73	002020	京新药业	8,054,089.00	3.57
74	300271	华宇软件	7,837,452.83	3.47
75	002410	广联达	7,484,917.93	3.32
76	000636	风华高科	7,429,521.50	3.29
77	002217	合力泰	7,416,982.51	3.29
78	002737	葵花药业	7,407,088.80	3.28
79	600763	通策医疗	7,243,278.83	3.21
80	000858	五粮液	7,025,633.70	3.11
81	000977	浪潮信息	6,957,085.72	3.08
82	300036	超图软件	6,818,423.07	3.02
83	002589	瑞康医药	6,692,750.84	2.96
84	601398	工商银行	6,571,284.00	2.91
85	002008	大族激光	6,503,914.64	2.88
86	002343	慈文传媒	6,468,965.83	2.87
87	600594	益佰制药	6,431,609.00	2.85
88	603368	柳药股份	6,228,229.64	2.76
89	600329	中新药业	6,114,431.62	2.71
90	300244	迪安诊断	5,893,794.13	2.61
91	002016	世荣兆业	5,622,257.62	2.49
92	300199	翰宇药业	5,597,613.88	2.48
93	300296	利亚德	5,449,076.00	2.41
94	300302	同有科技	5,378,838.50	2.38
95	002042	华孚时尚	5,247,274.60	2.32
96	002415	海康威视	5,177,503.00	2.29
97	600976	健民集团	5,052,819.42	2.24
98	300014	亿纬锂能	5,013,936.14	2.22
99	002027	分众传媒	5,000,330.00	2.22
100	002475	立讯精密	4,945,448.46	2.19
101	300316	晶盛机电	4,808,447.50	2.13
102	603108	润达医疗	4,770,469.60	2.11
103	600702	舍得酒业	4,709,735.00	2.09
104	002773	康弘药业	4,689,323.76	2.08
105	002019	亿帆医药	4,682,793.04	2.07
106	600511	国药股份	4,682,533.16	2.07
107	300054	鼎龙股份	4,664,965.00	2.07
108	601766	中国中车	4,616,106.00	2.04
109	002050	三花智控	4,609,755.00	2.04
110	000786	北新建材	4,572,227.47	2.03
111	603799	华友钴业	4,547,035.00	2.01

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	1,933,858,104.44
卖出股票收入（成交）总额	1,963,101,836.93

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

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	865,939.89
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	7,057.83
5	应收申购款	6,090.86
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	879,088.58

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	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
4,071	50,191.81	1,800,435.69	0.88%	202,530,429.75	99.12%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

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（2016年8月11日）基金份额总额	556,759,946.47
本报告期期初基金份额总额	244,958,168.46
本报告期基金总申购份额	2,151,269.36
减：本报告期基金总赎回份额	42,778,572.38
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	204,330,865.44

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 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
东吴证券	2	3,894,841,188.76	100.00%	857,848.76	100.00%	–
中泰证券	1	–	–	–	–	–
申港证券	2	–	–	–	–	–
财通证券	2	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
天风证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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