

东吴配置优化混合型证券投资基金  
(原东吴保本混合型证券投资基金转型)  
2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月二十六日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 22 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。

东吴配置优化混合型证券投资基金根据《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》的约定由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来。东吴保本混合型证券投资基金于 2012 年 8 月 13 日生效，该基金保本周期期限三年，自该基金基金合同生效日期至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即本基金于 2015 年 8 月 13 日到期。由于不符合保本基金存续条件，根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满后，选择期截止日的次日，即 2015 年 8 月 19 日起东吴保本混合型证券投资基金转型为“东吴配置优化混合型证券投资基金”。就前述基金变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关备案手续。

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

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

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。（其中转型前东吴保本混合型证券投资基金报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 8 月 18 日止，转型后东吴配置优化混合型证券投资基金报告期自 2015 年 8 月 19 日起至 2015 年 12 月 31 日止）

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现（转型前）.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	23
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	23
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	23
<b>§6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	24
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>25</b>
6.1 审计报告基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
<b>§7 年度财务报表(转型前)</b> .....	<b>26</b>
7.1 资产负债表(转型前).....	26
7.2 利润表.....	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	28
7.4 报表附注.....	29
<b>§7 年度财务报表(转型后)</b> .....	<b>49</b>

7.1 资产负债表（转型后） .....	49
7.2 利润表 .....	50
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	51
7.4 报表附注 .....	52
<b>§8 投资组合报告(转型前) .....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	69
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	69
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	71
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	71
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.12 投资组合报告附注 .....	72
<b>§8 投资组合报告(转型后) .....</b>	<b>72</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	72
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	73
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后) .....	74
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	75
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	75
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	75
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	75
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	75
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12 投资组合报告附注 .....	76
<b>§9 基金份额持有人信息(转型前) .....</b>	<b>77</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	77
<b>§9 基金份额持有人信息(转型后) .....</b>	<b>77</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	77
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>78</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	82
11.8 其他重大事件（转型后） .....	84
11.8 其他重大事件（转型前） .....	86
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>91</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>91</b>
13.1 备查文件目录.....	91
13.2 存放地点.....	91
13.3 查阅方式.....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	东吴保本混合型证券投资基金
基金简称	东吴保本混合
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 13 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	60,942,614.53 份
基金合同存续期（若有）	3 年

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	东吴配置优化混合型证券投资基金
基金简称	东吴配置优化混合
基金主代码	582003
交易代码	582003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 19 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,223,073.84 份
基金合同存续期（若有）	不定期

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金主要通过投资组合保险策略的运用，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳健增长。
投资策略	本基金遵循保本增值的投资理念，根据恒定组合投资保险策略原理进行资产配置，保证保本周期到期时本金安全，同时通过精选个股和个券实现基金资产的稳健增长。
业绩比较基准（若有）	银行三年期定期存款收益率（税后）。
风险收益特征（若有）	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要投资于具有持续竞争优势的企业，追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金在严格风险控制的基础上，追求稳健收益。
业绩比较基准（若有）	60%*沪深 300 指数+40%*中国债券综合全价指数。
风险收益特征（若有）	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	林葛
	联系电话	021-50509888-8308	010-66060069
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-68121816
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京复兴门内大街 2 8 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		200135	100031
法定代表人		王炯	刘士余

基金管理人于 2016 年 2 月 3 日发布法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为王炯先生。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座（14 幢）20 楼
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	转型前	转型后	2014 年	2013 年
	报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日）	报告期（2015 年 8 月 19 日至 12 月 31 日）		
本期已实现收益	17,461,736.95	1,225,838.55	5,440,074.81	16,897,087.09
本期利润	17,974,804.28	-99,386.91	28,506,791.11	-7,201,434.48
加权平均基金份额本期利润	0.1112	-0.0028	0.1091	-0.0155
本期加权平均净值利润率	9.76%	-0.24%	10.62%	-1.51%
本期基金份额净值增长率	9.76%	17.50%	10.70%	-3.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015 年 8 月 18 日）	报告期末（2015 年 12 月 31 日）	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	23,045,142.42	4,576,283.91	12,298,031.35	-8,517,716.19
期末可供分配基金份额利润	0.3781	0.1745	0.0638	-0.0278
期末基金资产净值	72,002,808.38	30,799,357.75	207,546,339.93	298,080,975.84
期末基金份额净值	1.181	1.175	1.076	0.972



3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015年8月18日）	报告期末（2015年12月31日）	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	18.10%	17.50%	7.60%	-2.80%

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

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

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

4、本基金转型前为东吴保本混合型证券投资基金。东吴保本混合型证券投资基金于2012年8月13日成立，2015年8月19日变更为“东吴配置优化混合型证券投资基金”。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

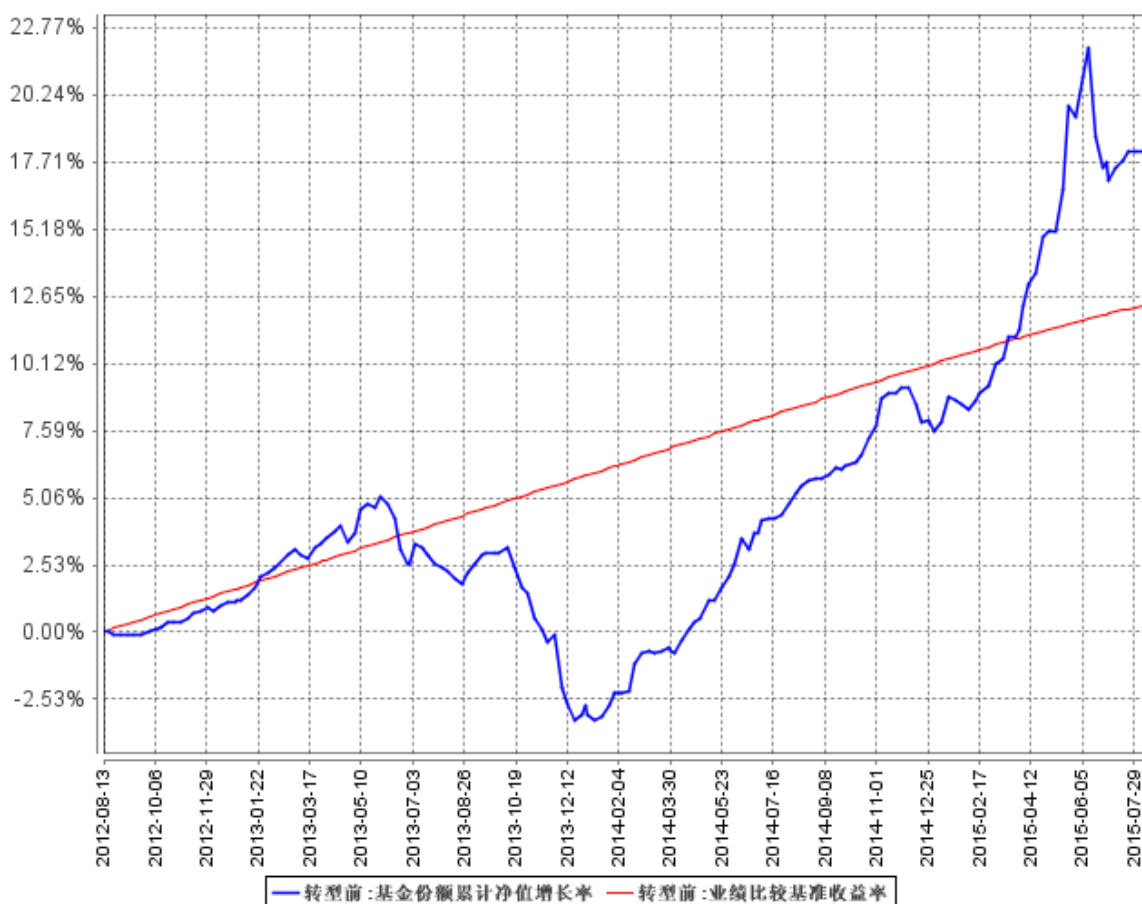
转型前						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.34%	0.08%	-8.11%	2.08%	8.45%	-2.00%
过去六个月	6.01%	0.38%	-0.98%	1.77%	6.99%	-1.39%
过去一年	11.10%	0.29%	33.08%	1.42%	-21.98%	-1.13%
过去三年	18.10%	0.21%	39.45%	1.00%	-21.35%	-0.79%
自基金合同生效起至今	18.10%	0.20%	36.01%	1.00%	-17.91%	-0.80%

注：1. 比较基准=银行三年期定期存款收益率（税后）。

2. 过去三个月：2015年7月1日至2015年8月18日，过去六个月：2015年4月1日至2015年8月18日，过去一年：2014年10月8日至2015年8月18日，过去三年：2012年10月8日至2015年8月18日，自基金合同生效起至今：2012年8月13日至2015年8月18日。

### 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

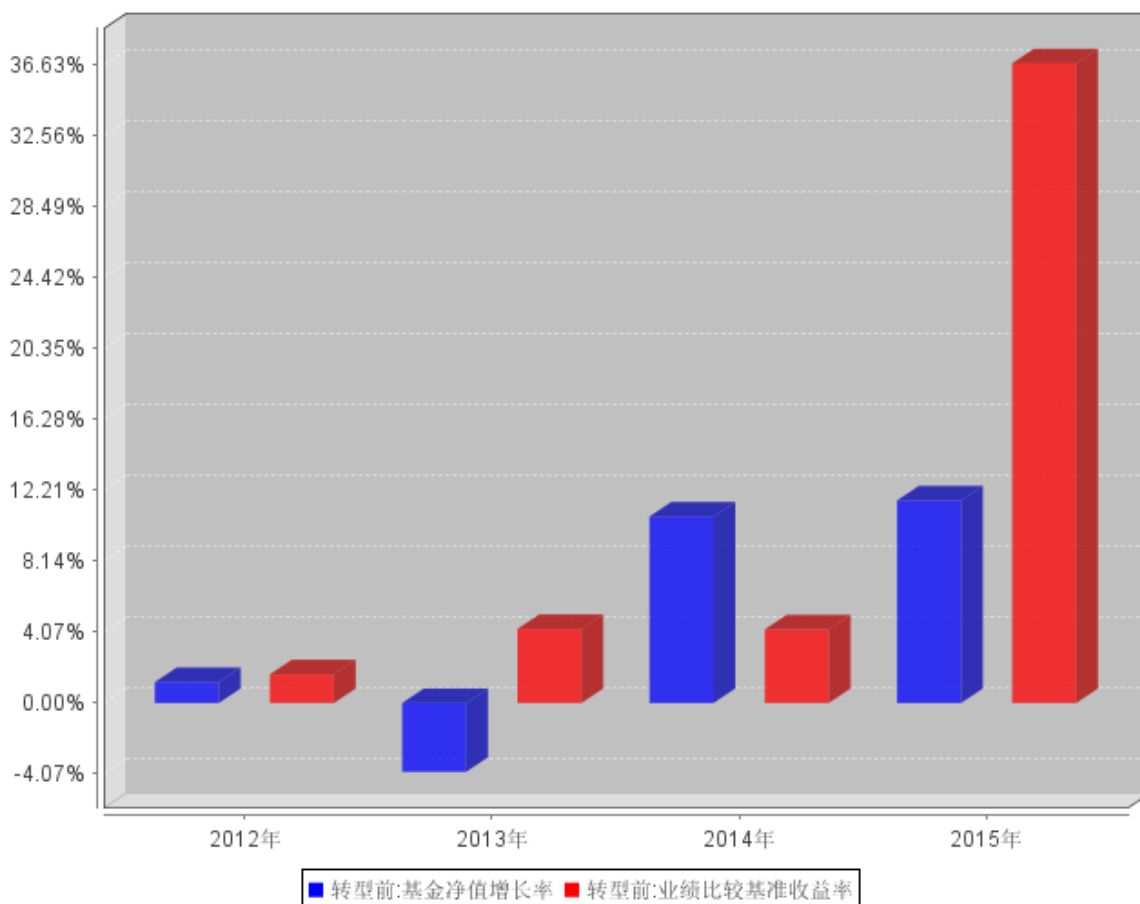
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：比较基准=银行三年期定期存款收益率（税后）。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 比较基准=银行三年期定期存款收益率（税后）。

2. 东吴保本混合型证券投资基金于 2012 年 8 月 13 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

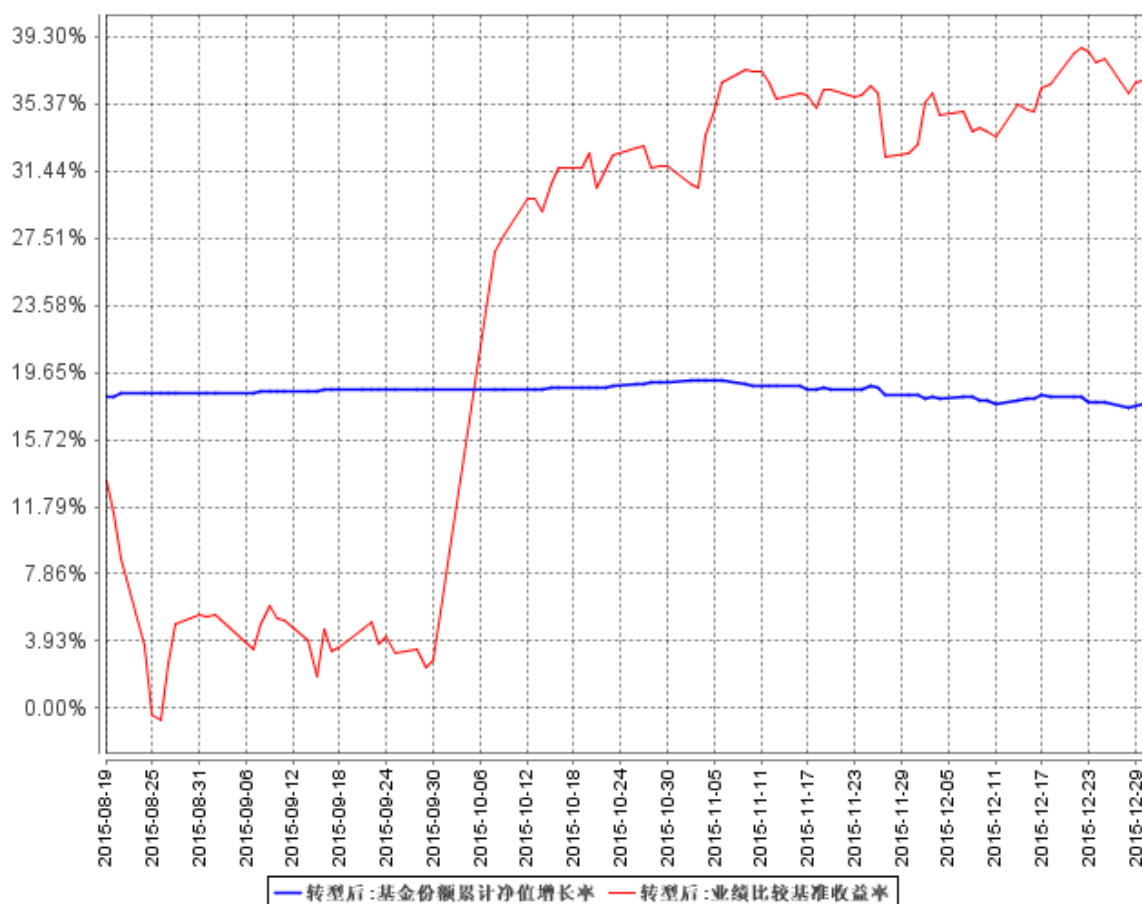
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型后						
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
过去三个月	-0.93%	0.11%	10.42%	1.00%	-11.35%	-0.89%
自基金合同生效起至今	-0.51%	0.09%	0.21%	1.39%	-0.72%	-1.30%

注：业绩比较基金=60%\*沪深 300 指数+40%\*中国债券综合全价指数。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

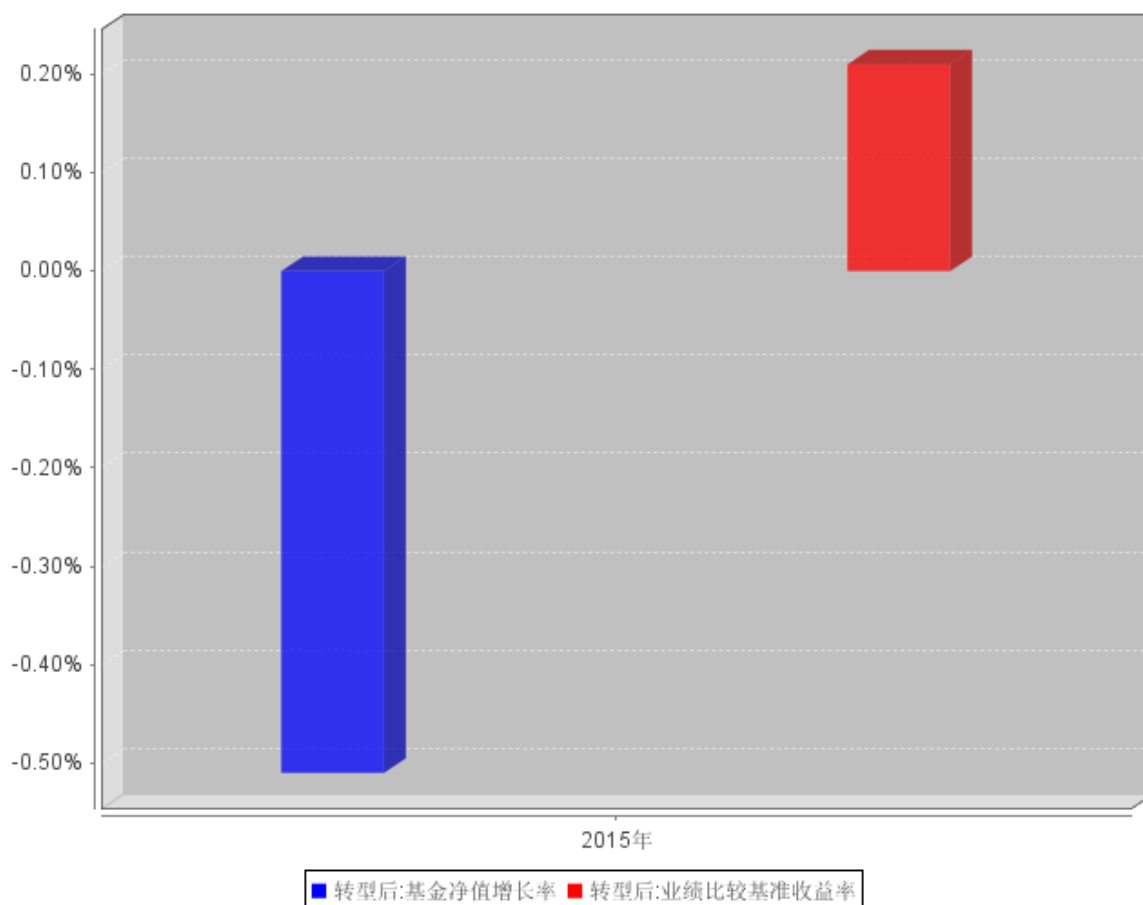


注：1. 业绩比较基金=60%\*沪深 300 指数+40%\*中国债券综合全价指数。

2. 东吴配置优化混合型证券投资基金由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2015 年 8 月 19 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未滿一年。按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末仍处于建仓期。

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

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 业绩比较基金=60%\*沪深 300 指数+40%\*中国债券综合全价指数。

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

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

过去三年未进行过利润分配。

转型后

本基金自成立以来未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字【2003】82 号批准设立的证券投资基金管

理公司，于 2004 年 9 月正式成立，注册资本人民币 1 亿元，公司股东为东吴证券股份有限公司（占 70%股份）、上海兰生（集团）有限公司（占 30%股份）。

公司经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。自 2005 年发行第一支基金以来，公司逐渐形成了高中低风险结合的完善产品线，并走出了一条独具特色的新兴产业投资产品线。公司经过十多年的发展，资产管理规模超 400 亿元，发行公募产品 20 只，专户产品 20 只，子公司专项资产管理计划 124 个。公司一直坚持建立现代财富管理机构，促进公募、专户和专项三项业务齐头并进的发展战略方向，以服务实体经济为目标，加大创新力度，促进公司业务的多元化发展。

东吴基金拥有一支经验丰富而又充满活力的专业团队，平均年龄 33 岁，其中一半以上员工具有硕士及以上学历，具有 5 年以上基金、证券从业经历的占 70%，公司高管和主要投资管理机构的平均金融从业年限为 10 年，具有丰富的实践操作经验和管理经验。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有争、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”的远大理想，创造性地树立自己独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

2015 年，公司顺应东吴证券互联网财富管理战略，以财富管理多元化、业务拓展平台化、营销服务网络化、运营管理规范化为抓手，认真部署、合理统筹各项工作，推动东吴基金转型创新上新台阶，整体经营情况实现较好的发展势头，公司营业收入与利润总额连续三年创了新高。目前公司各项产品线日臻完善，现代财富管理公司初现雏形：公司公募、专户、专项三业并举，产品线覆盖股票、债券、平台融资类资管计划等多个领域；投资范围横跨一级市场、一级半市场、二级市场；服务客户既包括投资理财领域也包括政府、企业等实体经济领域。由此公司业务结构也日趋多元化，成功向现代财富管理公司不断迈进。下一步，公司将秉承“三满意一放心”的经营理念，继续以市场为导向、以客户为中心，强化服务意识，拓展发展空间，全面提高公司的核心竞争力，谱写向现代财富管理公司转型的新篇章。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨庆定	本基金基金经理、基金投资	2014 年 6 月 28 日	-	10 年	博士，上海交通大学管理专业毕业。历

	总部总经理				任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理；2007 年 7 月至 2010 年 6 月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理；2013 年 4 月再次加入东吴基金管理有限公司，现担任公司基金投资总部总经理，其中自 2013 年 6 月 25 日起担任东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理、自 2014 年 5 月 9 日起担任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金经理、自 2014 年 6 月 28 日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自 2014 年 6 月 28 日起担任东吴保本混合型证券投资基金基金经理。
戴斌	本基金基	2014 年 11 月	-	9 年	博士，中国人

	金经理、 基金投资 总部副总 经理	6 日		民大学金融学 毕业。自 2007 年 1 月起加入 东吴基金管理 有限公司一直 从事证券投资 研究工作，曾 任研究部宏观 经济、金融工 程研究员，产 品策划部产品 设计研究员， 基金经理助理， 现任基金 投资总部副总 经理，其中自 2013 年 12 月 24 日起担任东 吴新产业混合 型证券投资基金 基金经理， 自 2014 年 11 月 6 日起担任 东吴保本混合 型证券投资基金 基金经理， 自 2014 年 12 月 12 日起担任 东吴价值成长 双动力混合型 证券投资基金 基金经理，自 2015 年 5 月 27 日起担任东吴 移动互联混合 型证券投资基金 基金经理， 自 2015 年 7 月 1 日起担任东 吴新趋势价值 线灵活配置混 合型基金基金 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。

### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨庆定	本基金基金经理、基金投资总部总经理	2015年8月19日	-	10年	博士，上海交通大学管理专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理；2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理；2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司，现担任公司基金投资总部总经理，其中自2013年6月25日起担任东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理、自2014年5月9日起担任东吴中证可转换债券指数分级

					证券投资基金基金经理、自 2014 年 6 月 28 日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 8 月 19 日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理。
戴斌	本基金基金经理、基金投资总部副总经理	2015 年 8 月 19 日	-	9 年	博士，中国人民大学金融学专业。自 2007 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司一直从事证券投资研究工作，曾任研究部宏观经济、金融工程研究员，产品策划部产品设计研究员，基金经理助理，现任基金投资总部副总经理，其中自 2013 年 12 月 24 日起担任东吴新兴产业混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月 19 日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理，自

					2014 年 12 月 12 日起担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理,自 2015 年 5 月 27 日起担任东吴移动互联网混合型证券投资基金基金经理,自 2015 年 7 月 1 日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为基金合同生效日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获

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

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析未发现异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年宏观经济依然在寻底过程中。各单月增速数据看，新增固定资产投资增速全年都徘徊在 20%以内，其中房地产投资增速更是一路下降为个位数，12 月增速仅为 1%；社会消费品零售总额尽管依然有两位数增长，但较往年也下了一个台阶，全年基本在 10%附近徘徊；贸易依然保持顺差，但增速较往年也有明显回落。三驾马车的疲弱造成宏观经济短期难有表现。

这一背景下，货币政策保持了宽松态势。年内央行多次降息降准，并通过公开市场操作等方式向市场注入流动性，降低了实体资金价格。目前看，这一趋势并未发生改变。

资本市场发生了剧烈波动。年初大盘蓝筹与中小创比翼齐飞，至二季度成长股疯涨，到 6 月份市场剧烈调整，至 9 月份市场阶段性见底企稳反弹。全年看，A 股震荡剧烈，走势惊心动魄。成长股表现依然优于蓝筹股，概念板块中，上半年互联网金融一枝独秀，下半年传媒、新能源汽车崛起，国企改革、迪斯尼等也有阶段性表现。

配置优化基金出于规避风险的考虑，始终将控制仓位作为操作核心，建仓较为谨慎，以成长股为主要配置方向。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，东吴配置优化混合型证券投资基金份额净值为 1.175 元，累计净值为 1.175 元；本报告期（2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日）份额净值增长率为-0.51%，同

期业绩比较基准收益率为 0.21%。

截至 2015 年 8 月 18 日,东吴保本混合型证券投资基金份额净值为 1.181 元,累计净值为 1.181 元;本报告期(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日)份额净值增长率为 9.76%,同期业绩比较基准收益率为 7.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体上我们对 2016 年市场持谨慎乐观态度。

尽管市场在新年伊始就出现明显下跌,个股跌幅更是惊人,但往后看,不确定性正在逐步消失。海外市场逐步稳定,货币政策继续收紧的概率不大;国内看,货币政策依然处于宽松周期,且宏观经济层面的托底政策正在加码,尤其对房地产行业的刺激已经明确,这将对整体经济的企稳起到至关重要的作用。供给侧改革的力度也明显加大,也为经济见底回升奠定了基础。

结构性上看,尽管由于估值较高、行业政策制约等不利因素尚存,但随着市场调整,尤其是成长股的风险已经得到相当程度的释放。站在全年维度看,目前已经是布局优质成长股的良好时机。

配置优化基金将坚持自下而上的选股策略,坚持选择能够代表未来发展方向的优质成长股进行布局。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发,着力探索新形势下的内部风险控制体系,完善内幕交易防控机制,确保各项法规和制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

同时,强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察,采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式,及时发现情况,提出改进建议并跟踪改进落实情况,推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告,定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内,本基金管理人内部监察重点开展的工作包括:

(1) 优化风险控制模式,完善风控系统建设。本基金管理人除了做好日常风控以外,持续升级系统功能,完善和改进各类风控阈值,使公司风控能力不断加强,风控水平持续提高,为公司快速发展创新业务提供坚实有力的支撑。

(2) 深入重点专项稽核,做好常规稽核工作。随着业务的不断发展创新,本基金管理人持续梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等,全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核,内

容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(3) 促进信批规范化，加强日志化管理。加强对信批媒体联系签约、新基金发行上市、定期报告、临时公告等信批时间线及工作节点的分解整理，关注信批的及时性和准确性，通过制作信批日历保障日常信批的按时执行，提高协作效率，保障信息披露的及时性。

(4) 推动合规文化建设，加深合规理念渗透。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强了内部合规培训力度，深化基金从业人员风合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司运营总监、基金会计、产品策划人员、监察稽核人员、基金投资部负责人等组成，同时，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。产品策划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；运营总监、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；监察稽核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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，因赎回等原因，本基金存在连续六十个交易日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在拟定相关应对方案。

### § 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告（转型前）

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天衡审字（2016）00671 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	东吴保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的东吴保本混合型证券投资基金（以下简称“保本基金”）财务报表，包括 2015 年 8 月 18 日（基金合同失效前日）的资产负债表、2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日（基金合同失效前日）止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是保本基金的基金管理人东吴基金管理有限公司的责任，这种责任包括：(1) 按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，保本基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，公允反映了保本基金 2015 年 8 月 18 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和所有者权益（基金净值）变动分配情况。	
注册会计师的姓名	陆德忠	魏娜
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国·南京	
审计报告日期	2016 年 2 月 23 日	



## § 6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天衡审字（2016）00680 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴配置优化混合型证券投资基金（原保本混合型证券投资基金）全体基金份额持有人；
引言段	我们审计了后附的东吴配置优化混合型证券投资基金（原保本混合型证券投资基金）（以下简称“配置优化基金”）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是配置优化基金的基金管理人东吴基金管理有限公司的责任，这种责任包括：(1) 按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，配置优化基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，公允反映了配置优化基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和所有者权益（基金净值）变动分配情况。

注册会计师的姓名	陆德忠	魏娜
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国·南京	
审计报告日期	2016 年 2 月 23 日	

## § 7 年度财务报表(转型前)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：东吴保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 8 月 18 日

单位：人民币元

资产	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	57,017,247.95	8,146,432.33
结算备付金		4,004,411.63	11,854,366.62
存出保证金		25,267.43	27,876.20
交易性金融资产	7.4.7.2	40,950,159.28	408,116,712.02
其中：股票投资		-	12,068,057.10
基金投资		-	-
债券投资		40,950,159.28	396,048,654.92
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	30,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,698,411.96	10,636,622.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	19,809.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		133,695,498.25	438,801,819.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>报告期初至转型前</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	224,999,688.80
应付证券清算款		30,000,000.00	4,510,426.53

应付赎回款		30,843,235.02	640,533.46
应付管理人报酬		65,659.66	219,833.86
应付托管费		10,943.28	36,638.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	22,831.26	21,825.63
应交税费		603,912.20	603,912.20
应付利息		-	5,971.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	146,108.45	216,648.56
负债合计		61,692,689.87	231,255,479.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	60,942,614.53	192,886,061.58
未分配利润	7.4.7.10	11,060,193.85	14,660,278.35
所有者权益合计		72,002,808.38	207,546,339.93
负债和所有者权益总计		133,695,498.25	438,801,819.26

注：1. 报告截止日 2015 年 8 月 18 日，基金份额净值为 1.181 元，基金份额总额为 60,942,614.53 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		22,383,141.73	43,063,382.98
1. 利息收入		14,886,706.24	27,143,646.73
其中：存款利息收入	7.4.7.11	186,404.79	213,671.63
债券利息收入		14,662,117.76	26,921,870.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		38,183.69	8,104.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,729,583.69	-7,567,747.87
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,926,663.52	-2,634,663.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-269,378.05	-5,049,227.60
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	72,298.22	116,142.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	513,067.33	23,066,716.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	253,784.47	420,767.82
<b>减：二、费用</b>		4,408,337.45	14,556,591.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,376,647.65	3,223,824.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	229,441.31	537,304.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	59,605.23	69,356.71
5. 利息支出		2,557,490.64	10,470,258.57
其中：卖出回购金融资产支出		2,557,490.64	10,470,258.57
6. 其他费用	7.4.7.20	185,152.62	255,847.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,974,804.28	28,506,791.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,974,804.28	28,506,791.11

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 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）	192,886,061.58	14,660,278.35	207,546,339.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,974,804.28	17,974,804.28
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）	-131,943,447.05	-21,574,888.78	-153,518,335.83
其中：1. 基金申购款	6,036,746.47	1,047,046.00	7,083,792.47
2. 基金赎回款	-137,980,193.52	-22,621,934.78	-160,602,128.30
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）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	60,942,614.53	11,060,193.85	72,002,808.38
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	306,598,692.03	-8,517,716.19	298,080,975.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,506,791.11	28,506,791.11
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)	-113,712,630.45	-5,328,796.57	-119,041,427.02
其中: 1. 基金申购款	1,971,075.36	93,598.91	2,064,674.27
2. 基金赎回款	-115,683,705.81	-5,422,395.48	-121,106,101.29
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)	192,886,061.58	14,660,278.35	207,546,339.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012][506]号《关于同意东吴保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集,基金合同于2012年8月13日正式生效,首次设立募集规模为775,673,452.62份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人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。

本基金为混合型基金,投资组合中股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中权证不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产投资占基金资产比例不低于

60%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：银行三年期定期存款收益率（税后）。

## 7.4.2 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》、《东吴保本混合型证券投资基金合同》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。

## 7.4.3 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 2015 年 8 月 18 日（基金合同失效前日）的财务状况及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 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。本报告期为 2015 年 1 月 1 日起至 8 月 18 日（基金合同失效前日）止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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。

本基金目前持有的债券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。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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

2、本基金收益分配方式：

- (1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；
- (2) 基金转型后：基金收益分配方式分为两种，现金分红与红利再投资。

投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基



金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知，本基金自 2015 年 3 月 24 日起，对交易所市场上上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券品种以外的固定收益品种估值时，由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。本基金对该会计估计变更采用未来适用法，经测算新估值标准实施日的相关调整对前一估值日基金资产净值的影响未超过 0.5%。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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》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。

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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 8 月 18 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	57,017,247.95	8,146,432.33
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	57,017,247.95	8,146,432.33

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 8 月 18 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	10,001,121.92	10,503,159.28
	银行间市场	29,716,742.46	30,447,000.00
	合计	39,717,864.38	40,950,159.28
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	39,717,864.38	40,950,159.28	1,232,294.90
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	11,782,727.25	12,068,057.10	285,329.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	248,533,150.50	248,169,654.92
	银行间市场	147,081,606.70	147,879,000.00
	合计	395,614,757.20	396,048,654.92
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	407,397,484.45	408,116,712.02	719,227.57

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年8月18日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	30,000,000.00	-
合计	30,000,000.00	-
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年8月18日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	40,605.70	1,174.14
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	23,300.37	5,334.50
应收债券利息	1,634,454.40	10,630,101.12
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	51.49	12.50
合计	1,698,411.96	10,636,622.26

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 8 月 18 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	20,542.79	15,099.51
银行间市场应付交易费用	2,288.47	6,726.12
合计	22,831.26	21,825.63

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 8 月 18 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,525.55	6,648.56
预提费用	142,582.90	210,000.00
合计	146,108.45	216,648.56

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 18 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年末	192,886,061.58	192,886,061.58
本期申购	6,036,746.47	6,036,746.47
本期赎回（以“-”号填列）	-137,980,193.52	-137,980,193.52
- 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	60,942,614.53	60,942,614.53

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,298,031.35	2,362,247.00	14,660,278.35
本期利润	17,461,736.95	513,067.33	17,974,804.28
本期基金份额交易产生的变动数	-19,184,202.75	-2,390,686.03	-21,574,888.78
其中：基金申购款	763,410.78	283,635.22	1,047,046.00
基金赎回款	-19,947,613.53	-2,674,321.25	-22,621,934.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,575,565.55	484,628.30	11,060,193.85

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年8月 18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
活期存款利息收入	57,497.50	33,828.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	128,677.87	179,462.25
其他	229.42	380.70
合计	186,404.79	213,671.63

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年8月18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年12月31日
卖出股票成交总额	24,483,122.77	25,892,889.61
减：卖出股票成本总额	17,556,459.25	28,527,552.63
买卖股票差价收入	6,926,663.52	-2,634,663.02

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年8 月18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	474,362,000.18	336,631,653.34
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	465,793,444.09	337,512,434.07
减：应收利息总额	8,837,934.14	4,168,446.87
买卖债券差价收入	-269,378.05	-5,049,227.60

**7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未进行资产支持证券投资交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未进行权证投资交易。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未进行其他投资交易。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年8 月18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
股票投资产生的股利收益	72,298.22	116,142.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	72,298.22	116,142.75

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年8 月18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	513,067.33	23,066,716.30
——股票投资	-285,329.85	2,543,223.70
——债券投资	798,397.18	20,523,492.60
——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	513,067.33	23,066,716.30

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年8月 18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	241,363.31	418,512.42
转换费收入	12,421.16	2,255.40
合计	253,784.47	420,767.82

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年8月 18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
交易所市场交易费用	58,105.23	68,231.71

银行间市场交易费用	1,500.00	1,125.00
合计	59,605.23	69,356.71

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年8月18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
审计费用	31,507.70	50,000.00
信息披露费	111,075.20	160,000.00
汇划费	15,159.72	9,087.65
数字证书服务费	200.00	400.00
帐户维护费	27,210.00	36,360.00
合计	185,152.62	255,847.65

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年8月18日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
-------	----------------------------	----------------------------------



	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份 有限公司	-	-	22,874,369.04	56.80%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年8月18日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东吴证券股份 有限公司	211,773,386.32	46.71%	40,478,830.81	10.64%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年8月18日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东吴证券股份 有限公司	-	-	2,997,010,000.00	11.31%

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年8月18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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	20,247.15	56.54%	-	-

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年8月18日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,376,647.65	3,223,824.78
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	410,083.48	1,452,763.53

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 1.2% 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 1.2% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年8月18日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	229,441.31	537,304.16

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 0.2% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年8月18日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	57,017,247.95	57,497.50	8,146,432.33	33,828.68

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

##### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年8月18日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金以本金安全为导向，基于宏观经济运行变化和阶段性市场特征，运用恒定比例投资组合保险策略（CPPI）进行大类资产配置，通过购买债券等安全资产构建本金安全垫。同时结合东吴“M 值优化模型”动态调整投资品种比例，灵活精选债券和股票，以期在不同市场环境中攻守自如，增厚收益。

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风险管理部负责，组织、协调并与监察稽核部及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。监察稽核部与风险管理部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指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。

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—中国农业银行股份有限公司。本基金认为与中国农业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。

### 7.4.13.3 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公司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 7.4.12 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约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约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。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

金额单位：人民币元

本期末 2015年8 月18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	57,017,247.95	-	-	-	-	-	57,017,247.95
清算备付金	4,004,411.63	-	-	-	-	-	4,004,411.63
存出保证金	25,267.43	-	-	-	-	-	25,267.43
交易性金融资产	-	20,230,000.00	102.78	18,619,656.50	2,100,400.00	-	40,950,159.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	-	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,698,411.96	1,698,411.96
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	91,046,927.01	20,230,000.00	102.78	18,619,656.50	2,100,400.00	1,698,411.96	133,695,498.25
负债							
卖出回购证券款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	30,000,000.00	30,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,843,235.02	30,843,235.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,659.66	65,659.66
应付托管费	-	-	-	-	-	10,943.28	10,943.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,831.26	22,831.26
应交税费	-	-	-	-	-	603,912.20	603,912.20
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	146,108.45	146,108.45
负债总计	-	-	-	-	-	61,692,689.87	61,692,689.87

利率敏感度缺口	91,046,927.01	20,230,000.00	102.78	18,619,656.50	2,100,400.00	-59,994,277.91	72,002,808.38
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,146,432.33	-	-	-	-	-	8,146,432.33
结算备付金	11,854,366.62	-	-	-	-	-	11,854,366.62
存出保证金	27,876.20	-	-	-	-	-	27,876.20
交易性金融资产	-	-68,253,090.00	227,769,564.92	100,026,000.00	12,068,057.10	408,116,712.02	
应收利息	-	-	-	-	10,636,622.26	10,636,622.26	
应收申购款	-	-	-	-	19,809.83	19,809.83	
资产总计	20,028,675.15	-68,253,090.00	227,769,564.92	100,026,000.00	22,724,489.19	438,801,819.26	
负债							
卖出回购金融资产款	224,999,688.80	-	-	-	-	-224,999,688.80	
应付证券清算款	-	-	-	-	4,510,426.53	4,510,426.53	
应付赎回款	-	-	-	-	640,533.46	640,533.46	
应付管理人报酬	-	-	-	-	219,833.86	219,833.86	
应付托管费	-	-	-	-	36,638.98	36,638.98	
应付交易费用	-	-	-	-	21,825.63	21,825.63	
应付利息	-	-	-	-	5,971.31	5,971.31	
应交税费	-	-	-	-	603,912.20	603,912.20	
其他负债	-	-	-	-	216,648.56	216,648.56	
负债总计	224,999,688.80	-	-	-	6,255,790.53	231,255,479.33	
利率敏感度缺口	-204,971,013.65	-68,253,090.00	227,769,564.92	100,026,000.00	16,468,698.66	207,546,339.93	

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。
----	---

	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 8 月 18 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	124,466.86	1,681,383.63
	利率上升 25 个基点	-123,361.93	-1,666,802.45

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 8 月 18 日		上年度末 2014 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	-	-	12,068,057.10	5.81
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	-	-	12,068,057.10	5.81

注：本基金投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产投资占基金资产比例不低于 60%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。



## 7.4.13.4.3.2 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（2015年8月18日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩基准下跌 1%	-90,075.51	-1,303,806.11
	业绩基准下跌 5%	-450,377.57	-6,519,030.54
	业绩基准下跌 10%	-900,755.13	-13,038,061.07

注：报告期内，本基金 2015 年 beta 值为 0.13，2014 年为 0.63。

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

## § 7 年度财务报表(转型后)

## 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：东吴配置优化混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	转型后至报告期末
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	18,492,873.76
结算备付金		1,198,312.04
存出保证金		38,834.26
交易性金融资产	7.4.7.2	12,881,851.86
其中：股票投资		2,823,750.10
基金投资		-
债券投资		10,058,101.76
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	14,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	86,504.35
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-

资产总计		46,698,376.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>转型后至报告期末</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		14,307,676.28
应付赎回款		704,286.29
应付管理人报酬		43,136.61
应付托管费		7,189.44
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	2,801.29
应交税费		603,912.20
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	230,016.41
负债合计		15,899,018.52
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	26,223,073.84
未分配利润	7.4.7.10	4,576,283.91
所有者权益合计		30,799,357.75
负债和所有者权益总计		46,698,376.27

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.175 元，基金份额总额为 26,223,073.84 份。

2. 本基金合同于 2015 年 8 月 19 日生效，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴配置优化混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期
		2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		272,827.99
1. 利息收入		553,115.18
其中：存款利息收入	7.4.7.11	38,367.46
债券利息收入		436,461.62
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		78,286.10
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,044,041.83
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,325,225.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	896.44
<b>减：二、费用</b>		372,214.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	232,789.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	38,798.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,084.71
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	97,542.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-99,386.91
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-99,386.91

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴配置优化混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	60,942,614.53	11,060,193.85	72,002,808.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-99,386.91	-99,386.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-34,719,540.69	-6,384,523.03	-41,104,063.72

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	232,906.95	43,199.11	276,106.06
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-34,952,447.64	-6,427,722.14	-41,380,169.78
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)	26,223,073.84	4,576,283.91	30,799,357.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴配置优化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”，东吴保本混合型证券投资基金于 2015 年 8 月 19 日起转型为东吴配置优化混合型证券投资基金），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]506 号《关于核准东吴保本混合型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为管理人向社会公众公开发行募集，基金合同于 2012 年 8 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 775,673,452.62 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人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。

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 30%—80%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为 20%—70%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：60%\*沪深 300 指数+40%\*中国债券综合全价指数。

### 7.4.2 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》、《东吴配置优化混合型证券投资基金合同》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。

### 7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况及 2015 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。本报告期为 2015 年 8 月 19 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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。

本基金目前持有的债券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。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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

#### **7.4.4.5 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。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且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。

#### **7.4.4.7 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。

#### **7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知，本基金自2015年3月24日起，对交易所市场上上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券品种以外的固定收益品种估值时，由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。本基金对该会计估计变更采用未来适用法，经测算新估值标准实施日的相关调整对前一估值日基金资产净值的影响未超过0.5%。



### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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》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。

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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	18,492,873.76
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	18,492,873.76
-----	---------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	3,067,189.29	2,823,750.10	-243,439.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	101.76	2.05
	银行间市场	9,907,493.42	150,506.58
	合计	9,907,593.13	150,508.63
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,974,782.42	12,881,851.86	-92,930.56

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	14,000,000.00	-
合计	14,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,003.96
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	539.20
应收债券利息	84,943.69
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	17.50
合计	86,504.35

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,801.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,801.29

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16.41
预提费用	230,000.00
合计	230,016.41

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年8月19日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	60,942,614.53	60,942,614.53
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	232,906.95	232,906.95
本期赎回（以“-”号填列）	-34,952,447.64	-34,952,447.64
本期末	26,223,073.84	26,223,073.84

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。

**7.4.7.10 未分配利润**

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	10,575,565.55	484,628.30	11,060,193.85
本期利润	1,225,838.55	-1,325,225.46	-99,386.91
本期基金份额交易产生的变动数	-6,490,946.45	106,423.42	-6,384,523.03
其中：基金申购款	45,013.02	-1,813.91	43,199.11
基金赎回款	-6,535,959.47	108,237.33	-6,427,722.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,310,457.65	-734,173.74	4,576,283.91

**7.4.7.11 存款利息收入**

项目	本期 2015年8月19日至2015年12月31日
活期存款利息收入	26,649.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,536.67
其他	181.65
合计	38,367.46

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年8月19日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,260,285.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,810,271.25
减：应收利息总额	1,405,972.33
买卖债券差价收入	1,044,041.83

**7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期未进行资产支持证券投资交易。

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

本基金本报告期末未进行权证投资交易。

**7.4.7.14.2 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投资交易。

**7.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年8月19日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,325,225.46
——股票投资	-243,439.19
——债券投资	-1,081,786.27
——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	-1,325,225.46

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年8月19日至2015年12月31日
基金赎回费收入	644.99
转换费收入	251.45
合计	896.44

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年8月19日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	3,084.71
银行间市场交易费用	-
合计	3,084.71

### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	18,492.30
信息披露费	68,924.80
汇划费	975.00
帐户维护费	9,150.00
合计	97,542.10

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：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。

### 7.4.10 本报告期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 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	10,633,684.93	99.99%

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未有应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年8月19日至2015年12月31日
当期应支付的管理费	232,789.79
其中：支付销售机构的客户维护费	79,617.96

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年8月19日至2015年12月31日
当期应支付的托管费	38,798.30

注：支付基金托管人中国农业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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年8月19日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	18,492,873.76	26,649.14

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

##### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。



### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部负责，组织、协调并与监察稽核部及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。监察稽核部与风险管理部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指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。

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—中国农业银行股份有限公司。本基金认为与中国农业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。

#### 7.4.13.3 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公司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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 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							
银行存款	18,492,873.76	-	-	-	-	-	18,492,873.76
清算备付金	1,198,312.04	-	-	-	-	-	1,198,312.04
存出保证金	38,834.26	-	-	-	-	-	38,834.26

交易性金融资产	101.76	-	-	10,058,000.00	-	2,823,750.10	12,881,851.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	-	-	14,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	86,504.35	86,504.35
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,730,121.82	-	-	10,058,000.00	-	2,910,254.45	46,698,376.27
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购证券款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,307,676.28	14,307,676.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	704,286.29	704,286.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,136.61	43,136.61
应付托管费	-	-	-	-	-	7,189.44	7,189.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,801.29	2,801.29
应交税费	-	-	-	-	-	603,912.20	603,912.20
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	230,016.41	230,016.41
负债总计	-	-	-	-	-	15,899,018.52	15,899,018.52
利率敏感度缺口	33,730,121.82	-	-	10,058,000.00	-	12,988,764.07	30,799,357.75

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	42,169.66
	利率上升 25 个基点	-41,891.57

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,823,750.10	9.17
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	2,823,750.10	9.17

本基金投资组合比列为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 30%—80%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为 20%—70%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

##### 7.4.13.4.3.2 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	
	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（2015年12月31日）
分析	业绩基准下跌 1%	-3,326.33
	业绩基准下跌 5%	-16,631.65
	业绩基准下跌 10%	-33,263.31

注：报告期内，本基金 2015 年 beta 值为 0.01。

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无需要说明的其他重要事项。

**§ 8 投资组合报告(转型前)****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	40,950,159.28	30.63
	其中：债券	40,950,159.28	30.63
	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	30,000,000.00	22.44
	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	61,021,659.58	45.64
7	其他资产	1,723,679.39	1.29
8	合计	133,695,498.25	100.00

**8.2 期末按行业分类的股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600594	益佰制药	2,591,020.00	1.25
2	300244	迪安诊断	986,536.00	0.48
3	002115	三维通信	798,972.00	0.38
4	300115	长盈精密	798,720.00	0.38
5	300303	聚飞光电	598,484.00	0.29

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

用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002470	金正大	5,141,252.24	2.48
2	600284	浦东建设	4,166,876.06	2.01
3	600594	益佰制药	3,837,682.00	1.85
4	300265	通光线缆	2,516,109.50	1.21
5	600737	中粮屯河	2,412,564.00	1.16
6	300303	聚飞光电	1,681,892.90	0.81
7	000547	航天发展	1,601,135.00	0.77
8	300115	长盈精密	906,544.11	0.44
9	600030	中信证券	846,269.00	0.41
10	300244	迪安诊断	773,500.00	0.37
11	002115	三维通信	599,297.96	0.29

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,773,732.00
卖出股票收入（成交）总额	24,483,122.77

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,720,159.28	28.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,230,000.00	28.10
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	40,950,159.28	56.87

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1282401	12 雨润 MTN1	200,000	20,230,000.00	28.10
2	124352	13 平凉债	100,000	10,502,000.00	14.59
3	1280359	12 西矿集团 债	100,000	10,217,000.00	14.19
4	112076	12 雅致 02	10	1,056.50	0.00
5	112148	12 光电债	1	102.78	0.00

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,267.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,698,411.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,723,679.39

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 投资组合报告(转型后)

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,823,750.10	6.05
	其中：股票	2,823,750.10	6.05
2	固定收益投资	10,058,101.76	21.54
	其中：债券	10,058,101.76	21.54



	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	14,000,000.00	29.98
	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	19,691,185.80	42.17
7	其他资产	125,338.61	0.27
8	合计	46,698,376.27	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	605,151.00	1.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	329,490.00	1.07
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	940,214.00	3.05
R	文化、体育和娱乐业	948,895.10	3.08
S	综合	-	-
	合计	2,823,750.10	9.17

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)**

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	300244	迪安诊断	9,100	632,814.00	2.05
2	300144	宋城演艺	22,037	623,647.10	2.02
3	300299	富春通信	7,000	329,490.00	1.07
4	000802	北京文化	9,600	325,248.00	1.06
5	300347	泰格医药	10,000	307,400.00	1.00
6	300171	东富龙	10,200	305,796.00	0.99
7	600498	烽火通信	10,500	299,355.00	0.97

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300244	迪安诊断	726,177.00	1.01
2	300144	宋城演艺	677,084.97	0.94
3	300347	泰格医药	367,887.32	0.51
4	300299	富春通信	363,300.00	0.50
5	300171	东富龙	313,091.00	0.43
6	000802	北京文化	312,000.00	0.43
7	600498	烽火通信	307,649.00	0.43

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

**8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

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。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,067,189.29
卖出股票收入（成交）总额	0.00

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

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,058,101.76	32.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,058,101.76	32.66

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1280359	12 西矿集团 债	100,000	10,058,000.00	32.66
2	112148	12 光电债	1	101.76	0.00

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,834.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	86,504.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,338.61

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息(转型前)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,214	50,199.85	0.00	0.00%	60,942,614.53	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 基金份额持有人信息(转型后)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
849	30,887.01	0.00	0.00%	26,223,073.84	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2015 年 8 月 19 日 ) 基金份额总额	60,942,614.53
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	232,906.95
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	34,952,447.64
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 )	-
报告期期末基金份额总额	26,223,073.84

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内管理人发生的重大人事变动如下：

2015 年 6 月 23 日东吴基金管理有限公司召开 2015 年第一次临时股东会，会议经过审议，全体股东一致通过如下决议：

(1) 同意金燕萍女士辞去第二届董事会董事、副董事长职务；同意戴继雄先生辞去公司第二届董事会董事职务；

(2) 同意张平先生辞去公司第二届董事会独立董事、第二届董事会风险控股委员会委员职务；

(3) 选举陈辉峰先生、全卓伟女士担任公司第二届董事会董事，任期与公司第二届董事会一致；

(4) 选举袁勇志先生担任第二届董事会独立董事，任期与公司第二届董事会一致。

本报告期内基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

东吴保本混合型证券投资基金自 2015 年 8 月 19 日起正式变更为东吴配置优化混合型证券投资基金。变更后基金的投资目标、投资策略和业绩比较基准等按照《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2012 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 50000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### （1）管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，中国证监会以及上海证监局对公司原基金经理魏立波涉嫌违规从事股票交易进行了调查，上海证监局于 2015 年 1 月 23 日对公司作出了采取责令整改措施的决定。公司对此高度重视，及时制定整改计划和整改方案，认真进行改进，逐一落实各项整改要求。

2015 年 7 月，中国证监会以及上海证监局对公司进行内部控制现场检查后，作出了责令改正措施的决定。公司对此高度重视，及时制定整改计划和整改方案，认真进行内控整改，逐一落实各项整改要求。截止本报告期末，公司已按照监管机关的要求完成了整改工作。

### （2）本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	1	1,822,764.32	59.43%	1,661.10	59.30%	-
东方证券	1	936,775.97	30.54%	853.67	30.47%	-
申银万国	1	307,649.00	10.03%	286.52	10.23%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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

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

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金退租交易单元 3 个，分别为华宝证券、国泰君安证券交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元



券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	1,028.15	0.01%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	1,175,300,000.00	100.00%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	10,633,684.93	99.99%	-	-	-	-

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	13,854,411.06	45.79%	12,612.98	46.50%	-
东方证券	1	12,497,560.60	41.30%	11,059.10	40.77%	-
招商证券	1	3,904,883.11	12.91%	3,455.47	12.74%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

中投证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-

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

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

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金新增交易单元 3 个，分别为华信证券、首创证券交易单元；退租交易单元 1 个，为湘财证券交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	164,590,259.66	36.31%	13,757,700,000.00	85.21%	-	-
东方证券	66,885,442.51	14.76%	1,399,158,000.00	8.67%	-	-
招商证券	10,049,461.08	2.22%	988,070,000.00	6.12%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-

华泰联合	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	211,773,386.32	46.72%	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015年8月25日
2	东吴保本混合型证券投资基金2015年半年度报告以及摘要	中国证券报 证券时报 公司网站	2015年8月27日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴配置优化混合型证券投资基金（原东吴保本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	中国证券报 证券时报 公司网站	2015年8月28日
4	东吴基金管理有限公司关于东吴配置优化混合型证券投资基金（原东吴保本混合型证券投资基金）开放日常申购、赎回、	中国证券报 证券时报 公司网站	2015年8月28日

	转换和定期定额投资业务的公告		
5	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海汇付金融服务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	2015 年 9 月 17 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海汇付金融服务有限公司申购费率及定投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	2015 年 9 月 17 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 9 月 24 日
8	东吴保本混合型证券投资基金招募说明书以及摘要	中国证券报 证券时报 公司网站	2015 年 9 月 25 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券有限责任公司基金申购及定期定额投资费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 10 月 20 日
10	东吴保本混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 10 月 26 日
11	东吴基金管理有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问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	2015 年 11 月 5 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增浙江金观诚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	2015 年 12 月 9 日

13	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚财富管理有限公司申购费率及定投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	2015 年 12 月 9 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 12 月 18 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 12 月 25 日
16	东吴基金管理有限公司关于参加上海陆金所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	2015 年 12 月 25 日
17	东吴基金关于参加浙江金观诚财富管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 12 月 28 日
18	东吴基金管理有限公司关于指数熔断情况下旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 12 月 31 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司定投产品费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 12 月 31 日

### 11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2014 年年度资产净值公	上海证券报、中国证券报、证券时报、证	2015 年 1 月 5 日

	告	券日报、公司网站	
2	东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行股份有限公司网上交易申购费率及定投申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
3	东吴保本混合型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 21 日
4	东吴基金管理有限公司关于开通旗下基金在中国工商银行股份有限公司基金转换业务的公告	中证证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 3 月 5 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中证证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 5 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增江苏银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 19 日
7	东吴基金管理有限公司关于变更江苏银行股份有限公司上线代销旗下基金并推出定期定额业务及转换业务时间的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 21 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法变更的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 25 日
9	东吴保本混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报 证券时报 公司网站	2015 年 3 月 27 日
10	东吴保本混合型证券投资基金	中国证券报 证券时	2015 年 3 月 28 日

	2014 年年度报告以及摘要	报 公司网站	
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 3 月 30 日
12	东吴保本混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 4 月 20 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行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	2015 年 5 月 29 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在公司网上交易开展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	2015 年 6 月 8 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加柜台、网上交易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	2015 年 6 月 8 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海好买基金销售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	2015 年 6 月 12 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海好买基金销售有限公司申购费率及定投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	2015 年 6 月 12 日



18	关于东吴基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 26 日
19	东吴基金管理有限公司关于参加数米基金网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	2015 年 6 月 26 日
20	东吴基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 26 日
21	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	2015 年 6 月 29 日
22	东吴基金管理有限公司管理的基金 2015 年半年度资产净值公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 7 月 1 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 7 月 7 日
24	东吴基金管理有限公司关于公司及高管、基金经理投资旗下基金相关事宜公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 7 月 7 日
25	东吴基金管理有限公司关于东吴保本混合型证券投资基金保本周到期即将到期的第一次提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 10 日
26	东吴基金管理有限公司关于东吴保本混合型证券投资基金保本周到期即将到期的第二次提示	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 7 月 17 日

	性公告		
27	东吴保本混合型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 7 月 21 日
28	东吴基金管理有限公司关于东 吴保本混合型证券投资基金保 本周期即将到期的第三次提示 性公告	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 7 月 27 日
29	吴基金管理有限公司关于东吴 保本混合型证券投资基金保本 周期即将到期的第四次提示性 公告	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 7 月 31 日
30	关于修订东吴保本混合型证券 投资基金基金合同的公告	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 8 月 10 日
31	东吴保本混合型证券投资基金 保本周期到期安排及东吴配置 优化混合型证券投资基金转型 后运作相关业务规则的公告	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 8 月 10 日
32	东吴配置优化混合型证券投资 基金基金合同内容摘要	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 8 月 10 日
33	东吴配置优化混合型证券投资 基金招募说明书	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 8 月 10 日
34	东吴配置优化混合型证券投资 基金基金合同	公司网站	2015 年 8 月 10 日
35	东吴配置优化混合型证券投资 基金托管协议	公司网站	2015 年 8 月 10 日
36	吴基金管理有限公司关于东吴 保本混合型证券投资基金保本 周期即将到期的第五次提示性 公告	中国证券报、证券时 报、公司网站	2015 年 8 月 11 日

37	东吴基金管理有限公司关于东吴保本混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资、转托管等业务的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 8 月 11 日
----	---	-----------------	-----------------

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴保本混合型证券投资基金设立的文件（2015 年 8 月 19 日起东吴保本混合型证券投资基金转型为“东吴配置优化混合型证券投资基金”）；
- 2、《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴配置优化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、报告期内东吴配置优化混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日