

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	东吴深证 100 指数增强 (LOF)
场内简称	东吴 100
基金主代码	165806
交易代码	165806
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2012 年 3 月 9 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,288,529.70 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-04-27

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	田青
	联系电话	021-50509888-8308	010-67595096
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		王炯	王洪章

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-329,903.75
本期利润	-2,611,064.76
加权平均基金份额本期利润	-0.2239
本期加权平均净值利润率	-20.85%
本期基金份额净值增长率	-17.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,139,575.01
期末可供分配基金份额利润	0.1009
期末基金资产净值	12,428,104.71
期末基金份额净值	1.101
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.10%

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、本基金于 2012 年 3 月 9 日成立。

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	2.23%	1.38%	1.55%	1.23%	0.68%	0.15%
过去三个月	-0.18%	1.39%	-0.16%	1.22%	-0.02%	0.17%
过去六个月	-17.03%	2.27%	-14.81%	2.05%	-2.22%	0.22%
过去一年	-28.18%	2.70%	-25.20%	2.43%	-2.98%	0.27%
过去三年	35.09%	1.98%	42.23%	1.84%	-7.14%	0.14%
自基金合同生效起至今	10.10%	1.79%	14.07%	1.71%	-3.97%	0.08%

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、本基金于 2012 年 3 月 9 日成立。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地—上海市浦东新区源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生(集团)有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和经中国证监会批准的其他业务。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、以德兴业”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2016 年 6 月 30 日, 公司旗下管理着 23 只公募基金, 27 只专户资产管理计划, 137 只存续专项资产管理计划 (子公司), 涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线, 可满足不同类型投资者的投资需求。

2016 年, 公司在成长股投资的传统优势基础上, 引入了量化投资策略, 在业内率先成立了绝对收益部, 更加强化绝对收益理念。

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

近年来, 公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩, 斩获了诸多奖项, 比如 2015 年度十大风云基金公司 (《大众证券报》)、2014 年度最佳投资风格*金蝉奖 (东吴新经济股票型基金, 《华夏理财》杂志)、2014 年度新财富最智慧投资机构 (《新财富》杂志) 等。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周健	本基金基金经理	2013 年 6 月 5 日	-	9 年	硕士, 南开大学毕业。曾就职于海通证券; 2011 年 5 月加入东吴基金管理有限公司, 曾任公司研究策划部研究员, 现任基金经理, 自 2012 年 05 月 03 日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自 2013 年 6 月 5 日起担任东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理、自 2016 年 2 月 3 日起担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2016 年 2 月 5 日起担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券

					投资基金基金经理，自 2016 年 6 月 3 日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，其中自 2012 年 10 月 27 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金在 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 6 月 30 日持续出现基金资产净值低于 5000 万元的情况，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，除此之外，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.101 元，累计净值 1.101 元；本报告期份额净值增长率-17.03%，同期业绩比较基准收益率为-14.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

深证 100 指数行业分布均衡合理，指数成分股成长性较高，流动性较好，中长期的投资价值明显。作为被动投资的基金，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对基准指数的跟踪偏离、主动增强获取超额收益为投资目标，努力为投资者实现单位风险收益上的最优化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

及中国证监会相关规定和基金合同的约定, 日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行, 基金份额净值由基金管理人完成估值后, 经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内, 因赎回等原因, 本基金在 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 6 月 30 日持续出现基金资产净值低于 5000 万元的情况, 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

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

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

本报告期, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	889,280.86	1,275,032.27
结算备付金		-	891.94
存出保证金		675.39	1,285.33
交易性金融资产	6.4.7.2	11,716,597.68	14,752,530.05
其中：股票投资		11,716,597.68	14,752,530.05
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	175.62	281.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	6,817.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,606,729.55	16,036,838.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,864.34	-
应付管理人报酬		10,096.34	13,134.92
应付托管费		1,514.45	1,970.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,688.21	921.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	154,461.50	280,000.00
负债合计		178,624.84	296,026.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,288,529.70	11,858,737.23
未分配利润	6.4.7.10	1,139,575.01	3,882,074.78
所有者权益合计		12,428,104.71	15,740,812.01
负债和所有者权益总计		12,606,729.55	16,036,838.96

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.101 元，基金份额总额 11,288,529.70 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-2,317,023.07	18,961,542.71
1.利息收入		4,023.35	13,337.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,023.35	13,337.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-41,112.39	26,908,828.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-129,157.98	26,771,121.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	88,045.59	137,707.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,281,161.01	-8,046,782.63

4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	1,226.98	86,159.41
减: 二、费用		294,041.69	804,044.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	62,381.15	225,125.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,357.17	33,768.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	12,904.05	258,407.34
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	209,399.32	286,742.09
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-2,611,064.76	18,157,498.55
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-2,611,064.76	18,157,498.55

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	11,858,737.23	3,882,074.78	15,740,812.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-2,611,064.76	-2,611,064.76
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)	-570,207.53	-131,435.01	-701,642.54
其中: 1. 基金申购款	934,306.33	78,850.76	1,013,157.09
2. 基金赎回款	-1,504,513.86	-210,285.77	-1,714,799.63
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	11,288,529.70	1,139,575.01	12,428,104.71

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益 (基金净值)	64,287,371.15	8,066,749.05	72,354,120.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,157,498.55	18,157,498.55
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)	-51,758,901.93	-19,548,946.58	-71,307,848.51
其中: 1. 基金申购款	30,295,192.01	8,584,634.87	38,879,826.88
2. 基金赎回款	-82,054,093.94	-28,133,581.45	-110,187,675.39
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)	12,528,469.22	6,675,301.02	19,203,770.24

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

吕晖

沈静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2011]1278 号《关于核准东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准, 由东吴基金管理有限公司作为管理人向社会公众公开发行募集, 基金合同于 2012 年 3 月 9 日正式生效, 首次设立募集规模为 385,199,023.48 份基金份额。

本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为东吴基金管理有限公司, 注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括投资于国内依法发行上市的股票 (包括

创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	889,280.86
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	889,280.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,502,526.96	11,716,597.68	214,070.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,502,526.96	11,716,597.68	214,070.72

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	175.32
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.30
合计	175.62

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,688.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,688.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37.18
应付指数使用费	50,000.00
预提审计费	24,863.02
预提上市年费	29,835.26
预提信息披露费	49,726.04
合计	154,461.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,858,737.23	11,858,737.23
本期申购	934,306.33	934,306.33
本期赎回(以“-”号填列)	-1,504,513.86	-1,504,513.86
- 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	11,288,529.70	11,288,529.70

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,068,318.80	-6,186,244.02	3,882,074.78
本期利润	-329,903.75	-2,281,161.01	-2,611,064.76
本期基金份额交易产生的变动数	-473,853.27	342,418.26	-131,435.01
其中：基金申购款	786,138.49	-707,287.73	78,850.76
基金赎回款	-1,259,991.76	1,049,705.99	-210,285.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,264,561.78	-8,124,986.77	1,139,575.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	3,975.59
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	41.27
其他	6.49
合计	4,023.35

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,503,048.94
减：卖出股票成本总额	4,632,206.92
买卖股票差价收入	-129,157.98

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末持有债券。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具交易。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	88,045.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	88,045.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,281,161.01
——股票投资	-2,281,161.01
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,281,161.01

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,226.98
-	-
合计	1,226.98

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	12,904.05
银行间市场交易费用	-
合计	12,904.05

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	49,726.04
上市费	29,835.26
汇划费	475.00
指数使用费	100,000.00
帐户维护费	4,500.00
合计	209,399.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 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	4,669,731.26	55.77%	123,750,444.33	82.72%

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份 有限公司	4,255.50	55.57%	243.83	9.07%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	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	110,036.19	82.78%	50,467.85	100.00%

注：1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。
2、股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金比率是公允，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	62,381.15
其中：支付销售机构的客 户维护费	10,874.95	41,330.00

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%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% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,357.17	33,768.93

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的费率计提，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 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 3 月 9 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	6,303,909.21	6,303,909.21
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,303,909.21	6,303,909.21
期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.8435%	50.3167%

注：本关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	889,280.86	3,975.59	1,215,120.98	12,394.54

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015 年 12 月 21 日	重大资产重组	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	37,066	424,268.81	674,601.20	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项停牌	22.07	-	-	23,232	432,387.65	512,730.24	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大资产重组	12.44	-	-	11,532	135,231.04	143,458.08	-
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项停牌	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	4,570	95,928.55	76,410.40	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.29	-	-	6,800	68,068.00	56,372.00	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大资产重组	18.72	2016 年 7 月 4 日	22.59	2,600	62,068.00	48,672.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现对标的指数的有效跟踪。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指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—中国建设银行股份有限公司。本基金认为与中国建设银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责

任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	889,280.86	-	-	-	-	-	889,280.86
清算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	675.39	-	-	-	-	-	675.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	11,716,597.68	11,716,597.68
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	-	-	-	-	-	175.62	175.62
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	889,956.25	-	-	-	-	11,716,773.30	12,606,729.55
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,864.34	9,864.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,096.34	10,096.34
应付托管费	-	-	-	-	-	1,514.45	1,514.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,688.21	2,688.21
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	154,461.50	154,461.50
负债总计	-	-	-	-	-	178,624.84	178,624.84
利率敏感度缺口	889,956.25	-	-	-	-	-11,538,148.46	12,428,104.71
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,275,032.27	-	-	-	-	-	1,275,032.27
清算备付金	891.94	-	-	-	-	-	891.94
存出保证金	1,285.33	-	-	-	-	-	1,285.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-14,752,530.05	14,752,530.05
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	-	-	-	-	-	281.53	281.53
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	6,817.84	6,817.84
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,277,209.54	-	-	-	-	-14,759,629.42	16,036,838.96
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,134.92	13,134.92
应付托管费	-	-	-	-	-	1,970.24	1,970.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	921.79	921.79
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	280,000.00	280,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	296,026.95	296,026.95
利率敏感度缺口	1,277,209.54	-	-	-	-	-14,463,602.47	15,740,812.01

注：东吴深证 100 指数基金于 2012 年 3 月 9 日成立；表中所示为本基金资产及负债的利率风险敞口，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

	影响金额 (单位: 人民币元)	
	本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
利率下降 25 个基点	-	-
利率上升 25 个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为股票型指数增强基金, 按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 基金管理人会对投资组合进行适当调整, 以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金原则上投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	11,716,597.68	94.28	14,752,530.05	93.72
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	11,716,597.68	94.28	14,752,530.05	93.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	1. 业绩基准下跌 1%	-137,951.96	-169,937.81
	2. 业绩基准下跌 5%	-689,759.81	-849,689.03
	3. 业绩基准下跌 10%	-1,379,519.62	-1,699,378.06

注: 报告期内, 本基金 2016 年 beta 值为 1.11, 2015 年 beta 为 1.08。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§ 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	11,716,597.68	92.94
	其中: 股票	11,716,597.68	92.94
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	889,280.86	7.05
7	其他各项资产	851.01	0.01
8	合计	12,606,729.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	56,503.20	0.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,070,533.37	48.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	92,951.72	0.75
E	建筑业	64,448.64	0.52
F	批发和零售业	229,330.62	1.85
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	1,436,130.77	11.56
J	金融业	1,675,226.33	13.48
K	房地产业	1,150,112.98	9.25
L	租赁和商务服务业	136,068.39	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	291,965.96	2.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	287,108.30	2.31
S	综合	87,844.40	0.71
	合计	11,578,224.68	93.16

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	21,296.00	0.17
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		
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	117,077.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	138,373.00	1.11

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000002	万 科 A	37,066	674,601.20	5.43
2	000651	格力电器	23,232	512,730.24	4.13
3	000333	美的集团	15,538	368,561.36	2.97
4	000001	平安银行	38,260	332,862.00	2.68
5	000725	京东方 A	119,717	276,546.27	2.23
6	000858	五 粮 液	8,017	260,793.01	2.10
7	000776	广发证券	14,615	244,947.40	1.97
8	002024	苏宁云商	21,117	229,330.62	1.85
9	300059	东方财富	10,160	225,552.00	1.81
10	002450	康得新	12,455	212,980.50	1.71
11	002415	海康威视	9,514	204,170.44	1.64
12	000783	长江证券	17,095	198,302.00	1.60
13	300104	乐视网	3,259	172,433.69	1.39
14	002594	比亚迪	2,634	160,700.34	1.29

15	000063	中兴通讯	11,135	159,675.90	1.28
16	002304	洋河股份	2,216	159,374.72	1.28
17	000060	中金岭南	15,082	157,305.26	1.27
18	300017	网宿科技	2,322	156,038.40	1.26
19	002353	杰瑞股份	7,620	146,913.60	1.18
20	002465	海格通信	11,532	143,458.08	1.15
21	001979	招商蛇口	10,022	142,813.50	1.15
22	000625	长安汽车	10,438	142,687.46	1.15
23	000100	TCL 集团	42,890	141,108.10	1.14
24	000166	申万宏源	16,722	140,632.02	1.13
25	000423	东阿阿胶	2,648	139,893.84	1.13
26	002230	科大讯飞	4,233	139,054.05	1.12
27	000538	云南白药	2,130	136,959.00	1.10
28	000503	海虹控股	3,400	136,714.00	1.10
29	300024	机器人	5,355	135,963.45	1.09
30	002673	西部证券	5,000	129,300.00	1.04
31	002142	宁波银行	8,595	127,034.10	1.02
32	002241	歌尔股份	4,292	123,094.56	0.99
33	002202	金风科技	7,887	119,330.31	0.96
34	000768	中航飞机	5,814	114,477.66	0.92
35	000839	中信国安	5,297	112,879.07	0.91
36	002736	国信证券	6,400	110,400.00	0.89
37	000402	金融街	11,204	108,902.88	0.88
38	300070	碧水源	7,292	108,504.96	0.87
39	000069	华侨城 A	16,694	106,841.60	0.86
40	300027	华谊兄弟	7,683	104,027.82	0.84
41	000568	泸州老窖	3,405	101,128.50	0.81
42	002456	欧菲光	3,395	100,152.50	0.81
43	000895	双汇发展	4,676	97,634.88	0.79
44	002405	四维图新	3,950	97,170.00	0.78
45	002500	山西证券	5,748	95,186.88	0.77
46	000157	中联重科	23,040	95,155.20	0.77
47	000917	电广传媒	5,693	94,105.29	0.76
48	002008	大族激光	4,114	93,963.76	0.76
49	000686	东北证券	7,183	92,732.53	0.75
50	300124	汇川技术	4,776	92,654.40	0.75
51	002236	大华股份	7,040	92,224.00	0.74
52	000559	万向钱潮	5,883	91,774.80	0.74
53	000413	东旭光电	10,400	89,336.00	0.72

54	000623	吉林敖东	3,558	88,772.10	0.71
55	000009	中国宝安	6,412	87,844.40	0.71
56	000876	新希望	10,018	83,349.76	0.67
57	002475	立讯精密	4,229	83,099.85	0.67
58	000338	潍柴动力	10,534	82,270.54	0.66
59	000793	华闻传媒	8,296	81,964.48	0.66
60	002385	大北农	9,945	80,156.70	0.64
61	000630	铜陵有色	30,884	78,445.36	0.63
62	000750	国海证券	10,500	77,595.00	0.62
63	000826	启迪桑德	2,508	76,619.40	0.62
64	000728	国元证券	4,570	76,410.40	0.61
65	000540	中天城投	12,200	76,006.00	0.61
66	300315	掌趣科技	6,975	73,167.75	0.59
67	000061	农产品	5,922	72,011.52	0.58
68	000977	浪潮信息	2,918	68,427.10	0.55
69	002030	达安基因	2,456	68,276.80	0.55
70	000425	徐工机械	21,604	66,108.24	0.53
71	300168	万达信息	2,500	64,975.00	0.52
72	002292	奥飞娱乐	2,158	64,632.10	0.52
73	002081	金螳螂	6,432	64,448.64	0.52
74	300058	蓝色光标	6,597	64,056.87	0.52
75	000792	盐湖股份	3,030	63,933.00	0.51
76	000970	中科三环	4,308	62,509.08	0.50
77	000709	河钢股份	22,494	62,308.38	0.50
78	300253	卫宁健康	2,520	62,244.00	0.50
79	000738	中航动控	2,200	58,080.00	0.47
80	000046	泛海控股	5,700	57,627.00	0.46
81	300498	温氏股份	1,560	56,503.20	0.45
82	002129	中环股份	6,800	56,372.00	0.45
83	000039	中集集团	3,964	56,169.88	0.45
84	000581	威孚高科	2,729	55,016.64	0.44
85	300251	光线传媒	4,600	53,176.00	0.43
86	300002	神州泰岳	4,993	53,125.52	0.43
87	000712	锦龙股份	2,400	49,824.00	0.40
88	002276	万马股份	2,500	49,525.00	0.40
89	000778	新兴铸管	10,595	49,160.80	0.40
90	000031	中粮地产	5,200	49,036.00	0.39
91	000598	兴蓉环境	9,274	48,966.72	0.39
92	002065	东华软件	2,600	48,672.00	0.39

93	002739	万达院线	600	47,940.00	0.39
94	000800	一汽轿车	4,085	44,444.80	0.36
95	000883	湖北能源	9,500	43,985.00	0.35
96	000878	云南铜业	4,305	43,824.90	0.35
97	002146	荣盛发展	6,120	41,126.40	0.33
98	000825	太钢不锈	11,045	34,902.20	0.28

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300144	宋城演艺	4,700	117,077.00	0.94
2	600111	北方稀土	1,600	21,296.00	0.17

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	000725	京东方 A	166,295.00	1.06
2	300168	万达信息	152,355.00	0.97
3	002736	国信证券	151,820.00	0.96
4	601808	中海油服	132,994.00	0.84
5	002673	西部证券	130,875.00	0.83
6	002353	杰瑞股份	123,671.00	0.79
7	300144	宋城演艺	109,930.00	0.70
8	000776	广发证券	106,662.00	0.68
9	300059	东方财富	102,066.00	0.65
10	000540	中天城投	101,791.00	0.65
11	000060	中金岭南	94,750.00	0.60
12	000503	海虹控股	94,045.00	0.60
13	002405	四维图新	85,151.00	0.54
14	000750	国海证券	77,092.00	0.49
15	000001	平安银行	74,337.00	0.47

16	300146	汤臣倍健	71,394.00	0.45
17	002129	中环股份	70,070.00	0.45
18	300498	温氏股份	61,100.00	0.39
19	000046	泛海控股	60,668.00	0.39
20	002739	万达院线	59,100.00	0.38

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	002236	大华股份	179,131.00	1.14
2	300146	汤臣倍健	172,712.72	1.10
3	000963	华东医药	155,728.39	0.99
4	600085	同仁堂	147,447.00	0.94
5	601808	中海油服	137,700.00	0.87
6	300104	乐视网	114,258.60	0.73
7	000778	新兴铸管	111,147.00	0.71
8	002241	歌尔股份	103,788.00	0.66
9	000012	南玻A	98,060.54	0.62
10	300017	网宿科技	93,386.00	0.59
11	300168	万达信息	89,756.00	0.57
12	002594	比亚迪	82,566.00	0.52
13	002106	莱宝高科	81,583.46	0.52
14	000063	中兴通讯	81,205.00	0.52
15	601888	中国国旅	80,380.00	0.51
16	002073	软控股份	78,787.80	0.50
17	603288	海天味业	73,785.67	0.47
18	000568	泸州老窖	73,255.00	0.47
19	300024	机器人	67,548.00	0.43
20	002007	华兰生物	65,715.84	0.42

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,877,435.56
--------------	--------------

卖出股票收入 (成交) 总额	4,503,048.94
----------------	--------------

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券广发证券 (000776) 在 2015 年 9 月 12 日公告, 公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份, 违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定, 并被中国证券监督管理委员会处以行政处罚。本基金管理人长期跟踪研究该股票, 我们认为, 该处罚事项未对广发证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程, 符合法律法规和公司制度的规定。除此之外, 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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	675.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	175.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	851.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	674,601.20	5.43	重大资产重组
2	000651	格力电器	512,730.24	4.13	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
281	40,172.70	6,333,423.61	56.10%	4,955,106.09	43.90%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	董霞	116,700.00	33.17%
2	毛维贤	32,108.00	9.13%
3	刘玉坤	30,003.00	8.53%
4	刘梅	30,001.00	8.53%
5	董霞	23,800.00	6.76%
6	胡朝铖	17,100.00	4.86%
7	冯红	15,000.00	4.26%
8	黄工贝	10,000.00	2.84%
9	谷怀玉	10,000.00	2.84%
10	朱洪博	7,900.00	2.25%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	7,525.84	0.0667%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日 (2012 年 3 月 9 日) 基金份额总额	385,199,023.48
本报告期期初基金份额总额	11,858,737.23
本报告期基金总申购份额	934,306.33
减:本报告期基金总赎回份额	1,504,513.86
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-
本报告期末基金份额总额	11,288,529.70

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**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动:

- 1、2016 年 1 月 16 日, 吴永敏先生因退休不再担任公司董事长, 由范力先生担任公司董事长。
- 2、2016 年 1 月 16 日, 任少华先生因工作调动辞去公司总经理职务, 由王炯先生担任公司总经理, 同时王炯先生辞去其所担任的公司副总经理职务。
- 3、2016 年 5 月 4 日, 吕晖先生担任公司副总经理。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无相关诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本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

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	4,669,731.26	55.77%	4,255.50	55.57%	-
招商证券	1	1,581,231.79	18.89%	1,440.94	18.82%	-
兴业证券	1	863,970.03	10.32%	804.60	10.51%	-
中银国际	1	641,373.34	7.66%	584.51	7.63%	-
国信证券	1	540,812.00	6.46%	503.65	6.58%	-
海通证券	2	75,366.60	0.90%	68.68	0.90%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期交易单元新增 1 个交易单元为招商证券；新增 2 个交易单元为海通证券；新增 1 个交易单元为天风证券。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司基金代销业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 1 月 4 日
2	东吴基金管理有限公司管理的基金 2015 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 1 月 4 日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 1 月 6 日

		网)	
4	东吴基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 6 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 11 日
6	东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 16 日
7	东吴基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 16 日
8	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 20 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 21 日
10	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石投资管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 21 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海联泰资产管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 21 日
12	东吴基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 1 月 21 日
13	东吴基金管理有限公司关于公司	中国证券报、上海证	2016 年 2 月 3 日

	法定代表人变更公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	
14	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 2 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 22 日
16	东吴基金管理有限公司关于参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 22 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 25 日
18	东吴基金管理有限公司关于参加珠海盈米财富管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 25 日
19	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 2015 年年度报告以及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 26 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 3 月 29 日
21	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 4 月 22 日
22	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 4 月 22 日

23	东吴基金管理有限公司关于公司副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 5 月 4 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国民生银行直销银行基金通系统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、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 5 月 17 日
25	东吴基金管理有限公司关于网上交易系统招商银行支付渠道费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 5 月 24 日
26	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 2 日
27	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 8 日
28	东吴基金管理有限公司关于参加上海利得基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 8 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 13 日
30	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金延迟参与开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 14 日
31	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 29 日

		网)	
32	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所 (巨潮资讯网)	2016 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站: <http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问, 可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 (021) 50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日