

# 东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月二十七日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

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 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）起至 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>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64

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 .....	64
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 .....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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 .....	66
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴安盈量化
场内简称	-
基金主代码	002270
交易代码	002270
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	447,272,411.62份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	陆志俊
	联系电话	021-50509888-8308	95559
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95559
传真		021-50509888-8211	021-62701216

注册地址	上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	上海浦东源深路 279 号	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200135	200120
法定代表人	王炯	牛锡明

注：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	证券时报、上海证券报
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	2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年	2014 年
本期已实现收益	3,289,060.68	-	-
本期利润	-3,292,977.50	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0141	-	-
本期加权平均净值利润率	-1.34%	-	-
本期基金份额净值增长率	4.90%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	22,073,408.34	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0494	-	-
期末基金资产净值	469,345,819.96	-	-
期末基金份额净值	1.049	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

基金份额累计净值增长率	4.90%	-	-
-------------	-------	---	---

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。

## 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

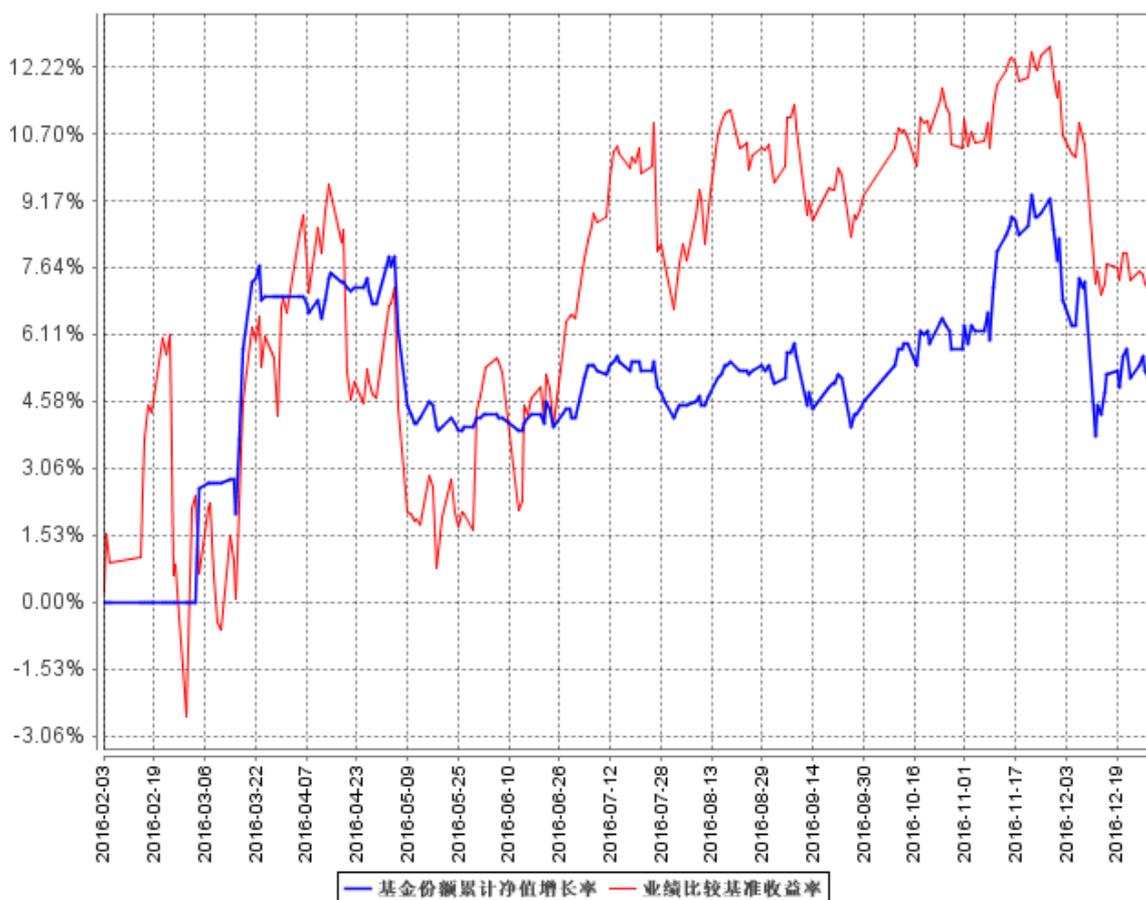
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.29%	0.62%	-1.47%	0.55%	1.76%	0.07%
过去六个月	0.67%	0.48%	0.99%	0.61%	-0.32%	-0.13%
自基金合同生效起至今	4.90%	0.49%	7.33%	0.99%	-2.43%	-0.50%

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

2、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立，本报告期末距基金合同生效不满一年；截至本报告期末已完成建仓，本基金各项资产配置比例符合合同规定，但报告期末距建仓结束不满一年。

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

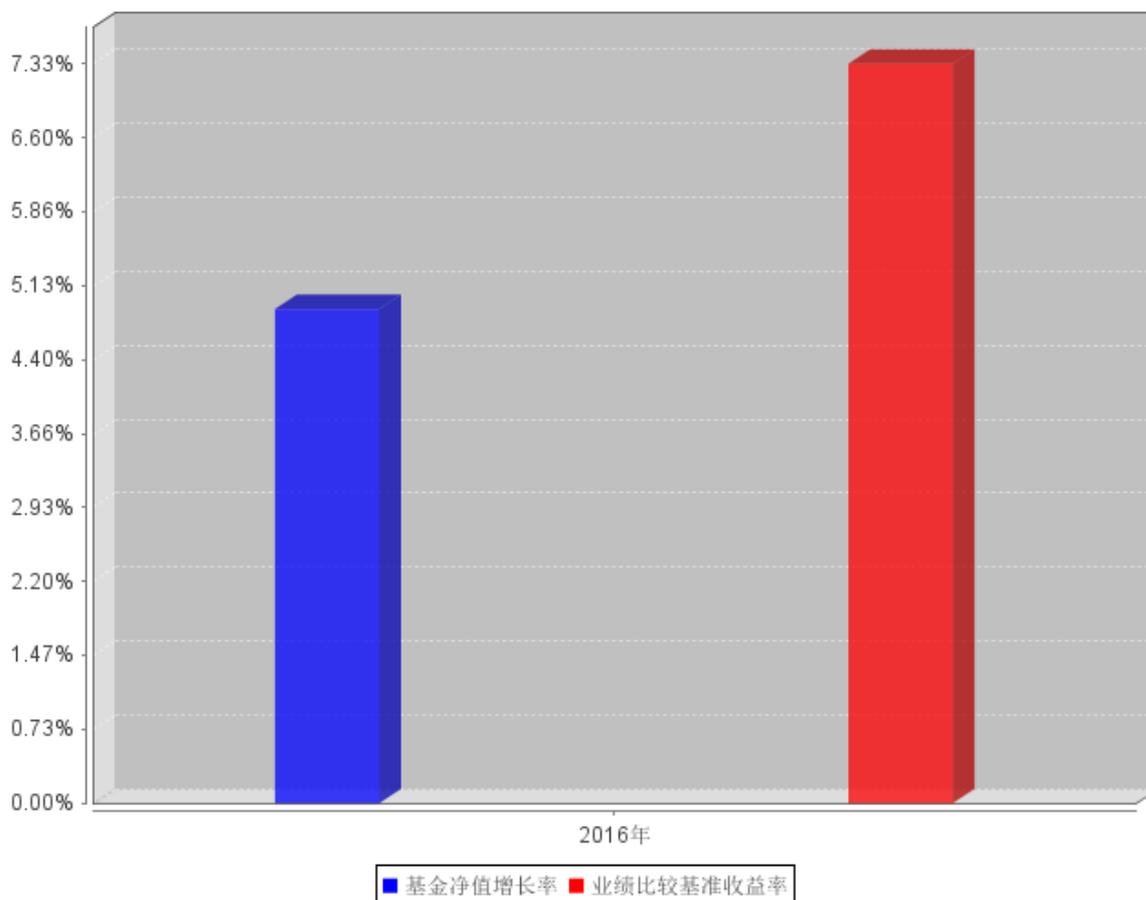
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、比较基准=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率。  
 2、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立，本报告期末距基金合同生效不满一年；截至本报告期末已完成建仓，本基金各项资产配置比例符合合同规定，但报告期末距建仓结束不满一年。

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

2、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立，本报告期末距基金合同生效不满一年；截至本报告期末已完成建仓，本基金各项资产配置比例符合合同规定，但报告期末距建仓结束不满一年。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年未进行过利润分配。

## § 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于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[2004]32 号开业批文，并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币，公司所在地为上海市浦东新区源深路 279 号，统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生（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，尤其在公募及专户领域大刀阔斧地进行了事业部制改革和平台化战略尝试，进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司整体资产管理规模为 631.46 亿元，其中公募基金 148.47 亿元，专户业务 101.51 亿元，子公司 381.48 亿元；旗下管理着 25 只公募基金，33 只存续专户资产管理计划，101 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。

2015 年以来，公司在成长股投资的传统优势基础上，进一步引入了量化投资策略，并在业内率先成立了绝对收益部，谋求穿越牛熊的正回报。目前已发行多只量化公募产品，其中东吴安盈量化基金、东吴安鑫量化基金为“量化策略+全市场选股”；东吴智慧医疗基金为“量化策略+热门主题”。从实战检验角度看，该系列基金经受住了市场反复震荡的考验，尤其在严控回撤、优化收益方面成效显著，初步实现了“下跌时回撤小，上涨时不掉队”的目标。

经过多年积累和布局，公司的公募业务已形成三大投研“特色”：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. 绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念，借助量化模型进行择时和选股；3. 固定收益以稳健为本，兼顾流动性与收益率，为大类资产配置提供基础性工具。

2016 年，公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券 2016 年基金公司固定收益投资能力排行榜显示，东吴基金固收团队以 3.81%的综合收益率，位列 85 家入选基金公司的第六位。

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 2016 年度最受欢迎债券类基金\*东吴鼎利债券基金 LOF（东方财富风云榜）、2015 年度十大风云基金公司（《大众证券报》）、2014 年度最佳投资风格\*金蝉奖（东吴新经济股票型基金，《华夏理财》杂志）、2014 年度新财富最智慧投资机构（《新财富》杂志）等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周健	本基金基金经理	2016 年 2 月 3 日	-	10 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

					<p>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，自 2016 年 8 月 11 日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，其中自 2012 年 10 月 27 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理。</p>
秦斌	本基金基金经理助理	2016 年 7 月 7 日	-	7.5 年	<p>硕士，2009 年 07 月至 2015 年 6 月就职于东吴证券股份有限公司，历任研究所金融工程分析师、投资总部数量化与衍生品交易研究员，2015 年 7 月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中自 2016 年 7 月 7 日起担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴安鑫量化灵活配置混合</p>

					型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 18 日起担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、周健为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；

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

2016 年证券市场以熔断开场，以股债汇共振下跌收官，1 月 A 股触发熔断，上证指数下跌 -12.31%，而创业板和中小板指数跌幅分别为 -27.71%、-22.89%，跌幅远超上证指数。从行业表现看，以白酒为代表的消费类行业以及以煤炭、钢铁、化工、建筑为代表的周期型行业表现要强于以 TMT、医疗服务为代表的成长股，申万 28 个一级行业仅食品饮料和建筑材料全年收涨，而传媒、计算机全年跌幅超 30%。

东吴安盈量化基金根据量化择时体系选择入场时机，因为发行档期躲过了 1 月份市场熔断的危险，但上半年仓位偏低，错过了市场反弹机会，下半年，随着择时体系重新进入风险收益比可观区域，逐步加大仓位，配置方向基于量化选股体系，按策略进行。

### 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 1.049 元，累计净值 1.049 元；本报告期份额净值增长率 4.90%，同期业绩比较基准收益率为 7.33%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年主要国家国债收益率上半年趋势下行，下半年由于主要经济体经济数据普遍好于预期，以及特朗普上台，国债收益率从 9 月开始逐步走高。大宗商品方面，金银价格先涨后跌，能源价格持续回升，布伦特原油全年涨幅为 51%，大宗金属价格普涨，锌价全年上涨 60%，铜、铝、铅、镍等金属全年震荡走高，涨幅均超 10%，受益于中国大宗商品需求回暖等原因，BDI 指数、CRB 指数 2016 年探底回升，全年分别上涨 101%、13.2%，预计大宗商品的回暖会持续到 2017 年上半年。量化宽松货币政策边际效果递减，延续压力递增，持续风险不断加大。全球不可避免迎来流动性拐点。2016 年中国为了稳增长加大杠杆，政府加社会融资总量达到 25 万亿，创造的 GDP 仅为 5-6 万亿，较 2007 年 7 万亿的融资产生了 5 万亿的 GDP，效率大打折扣。超发的货币推升大宗商品价格和房价，从一线二线城市往三四线蔓延。房价大涨、通胀反弹、汇率贬值，国内经济政策导向从以往的重视规模扩张转向结构和效益提升，财政与货币政策随之进入紧平衡状态，政治局会议和中央经济工作会议均把抑制资产泡沫和防范金融风险作为主要目标，货币政策已经从实际偏宽松转向稳健偏紧，2017 年政府加社会总融资增速趋降，年初应为全年融资增速高点，下半

年经济下行的风险远高于上半年。

展望 2017 年，由于短期盈利下拐点大概率形成，预计经济将在需求侧二次探底，但供给出清，政策从稳增长转向防风险和促改革。股市将很难再现资金推动的强趋势行情，但结构性机会将比较多，围绕业绩和改革两大主线展开。未来将呈现宏观羸弱，微观转好的转型格局。虽然宏观经济在需求端二次探底，但供给出清和行业集中度提升有助于改善企业效益，传统行业随着产能的持续出清，行业集中度提升，规模经济凸显，行业壁垒提高，这些行业正酝酿着新的机会。

经过三次股灾和近一年的调整，截至 2016 年底，中小板和创业板 2016 年动态 PE 分别为 37、46 倍，如果 2017 年中小板和创业板仍然能够维持 30%左右的增长，那么将会有一批成长股进入价值投资领域。事实上，当前时点已有一些成长股已进入可以战略配置阶段，预计持有全年会有不错的绝对收益。本基金将继续采用量化择时加量化选股投资体系，在获取收益前提下，严格控制回撤。

#### 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，建立健全内部风险控制体系，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。加强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，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，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 紧跟业务要求，完善风险控制手段。本基金管理人结合基金风险管理要求，事前做好系统风控设置，事中加强监控及跟踪提示，事后积极研究、探索风控手段的优化方案，规范流程，提升效率，构建多维度的风险管理层次，不断提升公司风险管理水平。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 梳理信批流程，促进信息披露规范化。本基金管理人持续关注最新出台的法律法规，根据产品的不同信息披露要求切实做好信息披露要点汇总、节点提示及对外披露等工作，加强流程化、日志化管理，保障了信息披露工作的及时性以及准确性。

(4) 提升合规氛围，推动合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求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。

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

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；公司副总经理、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控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，未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

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

## § 6 审计报告

### 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（2017）00509 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	东吴安盈量化灵活配置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安盈量化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东吴安盈量化”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、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东吴安盈量化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，东吴安盈量化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，公允反映了东吴安盈量化 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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	2017 年 2 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	55,035,900.82	-
结算备付金		1,950,291.98	-
存出保证金		440,400.08	-
交易性金融资产	7.4.7.2	314,551,959.01	-
其中：股票投资		314,551,959.01	-

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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	96,400,464.60	-
应收证券清算款		1,865,811.78	-
应收利息	7.4.7.5	42,572.76	-
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		470,287,401.03	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,502.10	-
应付管理人报酬		469,459.06	-
应付托管费		78,243.15	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	229,359.80	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,016.96	-
负债合计		941,581.07	-
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	447,272,411.62	-
未分配利润	7.4.7.10	22,073,408.34	-
所有者权益合计		469,345,819.96	-
负债和所有者权益总计		470,287,401.03	-

注：1、本基金于 2016 年 2 月 3 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

2、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.049 元，基金份额总额 447,272,411.62 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 2 月 3 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,840,333.33	-
1. 利息收入		2,509,776.76	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	693,209.50	-
债券利息收入		456,035.96	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,360,531.30	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,883,807.27	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,782,014.48	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-123,448.81	-
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	225,241.60	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,582,038.18	-
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	1,028,787.48	-
<b>减：二、费用</b>		6,133,310.83	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,329,156.07	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	554,859.35	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,961,765.61	-
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	287,529.80	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,292,977.50	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,292,977.50	-

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 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）	211,164,009.95	-	211,164,009.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,292,977.50	-3,292,977.50
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）	236,108,401.67	25,366,385.84	261,474,787.51
其中：1. 基金申购款	518,153,187.03	30,661,910.34	548,815,097.37
2. 基金赎回款	-282,044,785.36	-5,295,524.50	-287,340,309.86
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）	447,272,411.62	22,073,408.34	469,345,819.96
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金于 2016 年 2 月 3 日成立。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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

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

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

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

### 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》、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况及 2016 年度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。本报告期自 2016 年 2 月 3 日起至 12 月 31 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。

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

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

##### 2、金融负债的分类

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

#### 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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 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》、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。

### 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	55,035,900.82	-

定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	55,035,900.82	-

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	321,133,997.19	314,551,959.01	-6,582,038.18
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	321,133,997.19	314,551,959.01	-6,582,038.18
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	-	-	-

#### 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 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	96,400,464.60	-
合计	96,400,464.60	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

#### 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,872.70	-
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	877.60	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	16,624.26	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	198.20	-
合计	42,572.76	-

#### 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	217,131.85	-
银行间市场应付交易费用	12,227.95	-
合计	229,359.80	-

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	16.96	-
预提信息披露费	100,000.00	-
预提审计费	60,000.00	-
合计	160,016.96	-

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	211,164,009.95	211,164,009.95
本期申购	518,153,187.03	518,153,187.03
本期赎回(以“-”号填列)	-282,044,785.36	-282,044,785.36
- 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	447,272,411.62	447,272,411.62

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,289,060.68	-6,582,038.18	-3,292,977.50
本期基金份额交易产生的变动数	32,489,622.29	-7,123,236.45	25,366,385.84
其中：基金申购款	38,825,872.81	-8,163,962.47	30,661,910.34
基金赎回款	-6,336,250.52	1,040,726.02	-5,295,524.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,778,682.97	-13,705,274.63	22,073,408.34

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效 日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
活期存款利息收入	468,661.52	-
定期存款利息收入	66,888.89	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	149,042.07	-
其他	8,617.02	-
合计	693,209.50	-

**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 2016年2月3日(基金合 同生效日)至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	1,149,350,474.92	-
减：卖出股票成本总额	1,143,568,460.44	-
买卖股票差价收入	5,782,014.48	-

**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 2016年2月3日(基金合 同生效日)至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1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	23,092,066.63	-
减：卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成本总额	22,125,495.87	-
减：应收利息总额	1,090,019.57	-
买卖债券差价收入	-123,448.81	-

**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**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年2月3日(基金合同生效 日)至2016年12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月1日至2015年12月31 日
股指期货-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 2016年2月3日(基金合同生 效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	225,241.60	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	225,241.60	-

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年2月3日(基金合 同生效日)至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-6,582,038.18	-
——股票投资	-6,582,038.18	-
——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	-6,582,038.18	-

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,028,787.44	-
其他	0.04	-
合计	1,028,787.48	-

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	1,961,765.61	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,961,765.61	-

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	-
信息披露费	200,000.00	-
其他费用	400.00	-
银行汇划费用	9,129.80	-
帐户维护费	18,000.00	-
合计	287,529.80	-

**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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
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 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	2,452,072,630.35	93.92%	-	-

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	27,788,358.42	100.00%	-	-

##### 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 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	5,233,500,000.00	100.00%	-	-

#### 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 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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	545,270.15	93.93%	181,919.74	83.78%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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

注：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。股票交易佣金为成交金额的 0.3%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。佣金的比率是公允的，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。

#### 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 2016年2月3日(基金合同生效 日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	3,329,156.07	-

其中：支付销售机构的客户维护费	68,522.01	-
-----------------	-----------	---

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	上年度可比期间
	2016 年 2 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	554,859.35	-

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

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 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		上年度可比期间	
	2016 年 2 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
活期存款利息收入	55,035,900.82	468,661.52	-	-

### 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（2016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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	1,538	35,620.08	35,620.08	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统	2016年	2017年	新股流	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-

	股份	12月29日	1月10日	通受限						
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

#### 7.4.12.2 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
600626	申达股份	2016年12月15日	重大资产重组停牌	13.69	-	-	180,900	2,217,125.61	2,476,521.00	-
600814	杭州解百	2016年12月26日	重大事项停牌	11.37	2017年1月9日	10.70	102,600	1,084,806.00	1,166,562.00	-
000903	云内动力	2016年12月22日	重大事项停牌	8.76	-	-	114,800	921,308.95	1,005,648.00	-
601168	西部矿业	2016年12月19日	重大资产重组停牌	7.83	-	-	83,200	653,063.14	651,456.00	-

000050	深天马 A	2016年9 月12日	重大资 产重组 停牌	18.82	-	-	31,200	582,660.00	587,184.00	-
600763	通策医 疗	2016年 12月19 日	重大事 项停牌	33.54	2017年1 月3日	34.80	16,167	541,857.81	542,241.18	-
002400	省广股 份	2016年 11月28 日	重大事 项停牌	13.79	-	-	37,200	499,111.00	512,988.00	-
300150	世纪瑞 尔	2016年 11月8 日	重大资 产重组 停牌	9.97	-	-	47,000	473,549.85	468,590.00	-
600973	宝胜股 份	2016年 11月28 日	重大资 产重组 停牌	8.05	2017年2 月22日	8.86	57,500	459,249.02	462,875.00	-
000560	昆百大 A	2016年9 月2日	重大资 产重组 停牌	10.40	-	-	40,200	401,335.00	418,080.00	-
002025	航天电 器	2016年9 月12日	重大资 产重组 停牌	25.20	-	-	15,800	383,274.00	398,160.00	-
600577	精达股 份	2016年5 月13日	重大资 产重组 停牌	4.18	2017年3 月2日	4.60	92,600	400,032.00	387,068.00	-
600655	豫园商 城	2016年 12月20 日	重大资 产重组 停牌	11.42	-	-	33,000	367,219.00	376,860.00	-
000540	中天城 投	2016年 11月28 日	重大资 产重组 停牌	6.93	2017年1 月3日	7.00	49,100	330,978.41	340,263.00	-
300212	易华录	2016年 11月30 日	重大资 产重组 停牌	34.00	-	-	8,800	304,068.00	299,200.00	-
600406	国电南 瑞	2016年 12月29 日	重大资 产重组 停牌	16.63	-	-	15,700	242,540.33	261,091.00	-
000887	中鼎股 份	2016年 11月18 日	重大资 产重组 停牌	25.94	2017年2 月15日	23.99	8,600	207,679.76	223,084.00	-

600859	王府井	2016年9月27日	重大资产重组停牌	16.28	-	-	13,500	230,565.38	219,780.00	-
002034	美欣达	2016年10月10日	重大资产重组停牌	36.33	2017年1月13日	39.96	6,000	207,950.37	217,980.00	-
002162	悦心健康	2016年12月22日	重大资产重组停牌	6.61	-	-	31,400	208,496.00	207,554.00	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项停牌	19.70	2017年2月21日	18.35	5,100	101,235.00	100,470.00	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大资产重组停牌	13.36	-	-	7,500	101,483.00	100,200.00	-
603308	应流股份	2016年11月24日	重大资产重组停牌	21.92	2017年2月14日	21.92	3,900	80,782.68	85,488.00	-
600552	凯盛科技	2016年9月8日	重大资产重组停牌	18.43	2017年2月13日	17.51	4,600	84,595.88	84,778.00	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大资产重组停牌	42.53	2017年1月12日	38.98	1,900	73,356.38	80,807.00	-
603111	康尼机电	2016年12月26日	重大资产重组停牌	14.70	-	-	4,800	71,481.45	70,560.00	-
000987	越秀金控	2016年8月29日	重大资产重组停牌	14.49	2017年1月9日	15.94	3,100	46,543.50	44,919.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项停牌	21.20	2017年1月5日	21.66	1,000	22,494.92	21,200.00	-
300189	神农基因	2016年12月12日	重大资产重组停牌	5.25	2017年2月28日	5.34	3,800	20,444.00	19,950.00	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大资产重组停牌	15.84	2017年1月23日	14.26	600	9,288.00	9,504.00	-

600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	重大事项停牌	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	600	9,280.00	8,430.00	-
600747	大连控股	2016 年 11 月 2 日	重大资产重组停牌	5.20	-	-	1,500	6,525.00	7,800.00	-

### 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

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

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

本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。

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。

#### 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。报告期内，本基金持有的金融资产均未发生逾期与减值的情况。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。本基金的银行存款存放于本基金的托管行—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合规风控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、组合在短期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 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	55,035,900.82	-	-	-	-	-	55,035,900.82
清算备付金	1,950,291.98	-	-	-	-	-	1,950,291.98
存出保证金	440,400.08	-	-	-	-	-	440,400.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	314,551,959.01	314,551,959.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	96,400,464.60	-	-	-	-	-	96,400,464.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,865,811.78	1,865,811.78
应收利息	-	-	-	-	-	42,572.76	42,572.76
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	153,827,057.48	-	-	-	-	316,460,343.55	470,287,401.03
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,502.10	4,502.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	469,459.06	469,459.06
应付托管费	-	-	-	-	-	78,243.15	78,243.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	229,359.80	229,359.80
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	160,016.96	160,016.96
负债总计	-	-	-	-	-	941,581.07	941,581.07
利率敏感度缺口	153,827,057.48	-	-	-	-	-315,518,762.48	469,345,819.96
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
负债							

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（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率上升 25 个基点	-	

#### 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。本基金管理人合规风控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 2016年12月31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	314,551,959.01	67.02	-	-
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	314,551,959.01	67.02	-	-

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

#### 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）	
分析		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
1. 业绩基准下跌 1%	-1,175,241.93	-	
2. 业绩基准下跌 5%	-5,876,209.67	-	
3. 业绩基准下跌 10%	-11,752,419.33	-	

注：报告期内，本基金 2016 年 beta 值为 0.25，安盈量化于 2016 年 2 月 3 日成立生效。

**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****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	314,551,959.01	66.89
	其中：股票	314,551,959.01	66.89
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	96,400,464.60	20.50
	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	56,986,192.80	12.12
7	其他各项资产	2,348,784.62	0.50
8	合计	470,287,401.03	100.00

**8.2 期末按行业分类的股票投资组合****8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,387,258.32	2.43
B	采矿业	17,104,427.00	3.64
C	制造业	174,837,038.66	37.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	259,164.62	0.06
E	建筑业	5,217,155.23	1.11
F	批发和零售业	33,008,784.65	7.03
G	交通运输、仓储和邮政业	20,222,115.28	4.31
H	住宿和餐饮业	1,223,982.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,499,028.74	3.52

J	金融业	12,785,903.20	2.72
K	房地产业	9,868,943.80	2.10
L	租赁和商务服务业	6,322,745.00	1.35
M	科学研究和技术服务业	1,486,772.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	82,803.03	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	717,345.76	0.15
Q	卫生和社会工作	554,103.18	0.12
R	文化、体育和娱乐业	178,712.54	0.04
S	综合	2,795,676.00	0.60
	合计	314,551,959.01	67.02

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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

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	600367	红星发展	331,928	4,454,473.76	0.95
2	600685	中船防务	149,825	4,449,802.50	0.95
3	600409	三友化工	417,300	3,918,447.00	0.83
4	600150	中国船舶	136,300	3,763,243.00	0.80
5	000901	航天科技	113,600	3,732,896.00	0.80
6	601857	中国石油	446,900	3,552,855.00	0.76
7	600737	中粮屯河	254,600	3,172,316.00	0.68
8	600298	安琪酵母	177,800	3,168,396.00	0.68
9	600679	上海凤凰	84,300	3,003,609.00	0.64
10	600433	冠豪高新	370,100	2,968,202.00	0.63
11	300114	中航电测	129,841	2,957,777.98	0.63
12	000158	常山股份	224,000	2,800,000.00	0.60
13	000911	南宁糖业	153,640	2,751,692.40	0.59
14	601989	中国重工	385,400	2,732,486.00	0.58
15	600987	航民股份	218,300	2,693,822.00	0.57

16	000733	振华科技	146,800	2,620,380.00	0.56
17	600235	民丰特纸	246,600	2,616,426.00	0.56
18	600251	冠农股份	322,600	2,616,286.00	0.56
19	600755	厦门国贸	316,600	2,596,120.00	0.55
20	600198	大唐电信	162,600	2,580,462.00	0.55
21	603000	人民网	143,200	2,528,912.00	0.54
22	002125	湘潭电化	172,260	2,497,770.00	0.53
23	600626	申达股份	180,900	2,476,521.00	0.53
24	000032	深桑达 A	163,205	2,438,282.70	0.52
25	600359	新农开发	247,800	2,326,842.00	0.50
26	600469	风神股份	194,150	2,310,385.00	0.49
27	000061	农产品	185,200	2,290,924.00	0.49
28	600108	亚盛集团	395,600	2,262,832.00	0.48
29	000930	中粮生化	168,000	2,257,920.00	0.48
30	601118	海南橡胶	320,200	2,228,592.00	0.47
31	000882	华联股份	480,600	2,196,342.00	0.47
32	002053	云南能投	112,000	2,149,280.00	0.46
33	600963	岳阳林纸	238,700	1,950,179.00	0.42
34	000599	青岛双星	237,800	1,888,132.00	0.40
35	600583	海油工程	253,000	1,867,140.00	0.40
36	600099	林海股份	97,620	1,847,946.60	0.39
37	002049	紫光国芯	55,800	1,838,052.00	0.39
38	600676	交运股份	200,900	1,802,073.00	0.38
39	601939	建设银行	320,900	1,745,696.00	0.37
40	600476	湘邮科技	54,600	1,724,268.00	0.37
41	000589	黔轮胎 A	287,800	1,718,166.00	0.37
42	600241	时代万恒	110,200	1,703,692.00	0.36
43	601808	中海油服	130,500	1,674,315.00	0.36
44	000698	沈阳化工	203,500	1,605,615.00	0.34
45	000885	同力水泥	83,600	1,591,744.00	0.34
46	002101	广东鸿图	68,286	1,587,649.50	0.34
47	600850	华东电脑	65,479	1,583,282.22	0.34
48	600688	上海石化	242,400	1,561,056.00	0.33
49	600028	中国石化	288,500	1,560,785.00	0.33
50	600118	中国卫星	49,800	1,555,752.00	0.33
51	600677	航天通信	90,300	1,551,354.00	0.33
52	600776	东方通信	181,200	1,551,072.00	0.33
53	600824	益民集团	213,200	1,543,568.00	0.33
54	000701	厦门信达	100,400	1,543,148.00	0.33

55	000922	佳电股份	120,055	1,534,302.90	0.33
56	600981	汇鸿集团	180,600	1,533,294.00	0.33
57	000619	海螺型材	126,600	1,529,328.00	0.33
58	600775	南京熊猫	108,100	1,502,590.00	0.32
59	002401	中海科技	95,200	1,491,784.00	0.32
60	600343	航天动力	70,300	1,477,706.00	0.31
61	600103	青山纸业	256,801	1,450,925.65	0.31
62	601718	际华集团	157,200	1,447,812.00	0.31
63	000998	隆平高科	66,600	1,427,238.00	0.30
64	600356	恒丰纸业	113,100	1,380,951.00	0.29
65	002544	杰赛科技	48,600	1,367,604.00	0.29
66	600668	尖峰集团	81,535	1,364,895.90	0.29
67	600881	亚泰集团	248,400	1,358,748.00	0.29
68	601398	工商银行	302,200	1,332,702.00	0.28
69	600510	黑牡丹	152,400	1,315,212.00	0.28
70	600097	开创国际	59,168	1,286,312.32	0.27
71	000151	中成股份	65,000	1,273,350.00	0.27
72	000705	浙江震元	95,600	1,249,492.00	0.27
73	601018	宁波港	246,500	1,247,290.00	0.27
74	000070	特发信息	48,300	1,221,507.00	0.26
75	600990	四创电子	16,600	1,206,820.00	0.26
76	600730	中国高科	97,300	1,205,547.00	0.26
77	600135	乐凯胶片	87,800	1,204,616.00	0.26
78	600415	小商品城	138,800	1,200,620.00	0.26
79	600705	中航资本	194,700	1,191,564.00	0.25
80	600184	光电股份	54,831	1,183,252.98	0.25
81	600562	国睿科技	38,400	1,168,128.00	0.25
82	600814	杭州解百	102,600	1,166,562.00	0.25
83	600073	上海梅林	101,700	1,164,465.00	0.25
84	600756	浪潮软件	50,389	1,162,978.12	0.25
85	600435	北方导航	88,600	1,155,344.00	0.25
86	000762	西藏矿业	67,500	1,149,525.00	0.24
87	000488	晨鸣纸业	110,600	1,145,816.00	0.24
88	002368	太极股份	37,260	1,140,528.60	0.24
89	600081	东风科技	75,700	1,139,285.00	0.24
90	600531	豫光金铅	130,700	1,121,406.00	0.24
91	002344	海宁皮城	98,800	1,118,416.00	0.24
92	601688	华泰证券	59,500	1,062,670.00	0.23
93	600667	太极实业	134,900	1,040,079.00	0.22

94	600838	上海九百	56,900	1,038,425.00	0.22
95	600449	宁夏建材	84,600	1,029,582.00	0.22
96	002678	珠江钢琴	68,900	1,025,232.00	0.22
97	002481	双塔食品	113,000	1,024,910.00	0.22
98	000663	永安林业	60,800	1,024,480.00	0.22
99	600790	轻纺城	141,900	1,021,680.00	0.22
100	600662	强生控股	92,000	1,020,280.00	0.22
101	600156	华升股份	85,300	1,018,482.00	0.22
102	603616	韩建河山	55,600	1,015,812.00	0.22
103	600279	重庆港九	140,600	1,015,132.00	0.22
104	002338	奥普光电	20,900	1,011,560.00	0.22
105	000759	中百集团	108,664	1,008,401.92	0.21
106	000903	云内动力	114,800	1,005,648.00	0.21
107	601992	金隅股份	220,300	982,538.00	0.21
108	600125	铁龙物流	121,100	978,488.00	0.21
109	601919	中远海控	186,600	977,784.00	0.21
110	601006	大秦铁路	138,100	977,748.00	0.21
111	600429	三元股份	124,200	974,970.00	0.21
112	000530	大冷股份	87,000	944,820.00	0.20
113	000761	本钢板材	173,700	934,506.00	0.20
114	600834	申通地铁	61,900	916,120.00	0.20
115	600291	西水股份	47,540	911,817.20	0.19
116	000895	双汇发展	43,350	907,315.50	0.19
117	600895	张江高科	50,900	901,948.00	0.19
118	000807	云铝股份	134,500	901,150.00	0.19
119	601333	广深铁路	175,900	891,813.00	0.19
120	000529	广弘控股	75,058	885,684.40	0.19
121	600624	复旦复华	102,800	884,080.00	0.19
122	600720	祁连山	108,100	883,177.00	0.19
123	600630	龙头股份	56,100	866,184.00	0.18
124	600639	浦东金桥	46,600	864,896.00	0.18
125	600489	中金黄金	71,500	864,435.00	0.18
126	600456	宝钛股份	51,400	849,642.00	0.18
127	000518	四环生物	93,200	827,616.00	0.18
128	600827	百联股份	57,500	825,700.00	0.18
129	600268	国电南自	90,700	818,114.00	0.17
130	000060	中金岭南	73,200	816,180.00	0.17
131	600115	东方航空	115,400	815,878.00	0.17
132	002561	徐家汇	42,100	809,583.00	0.17

133	600612	老凤祥	21,400	796,722.00	0.17
134	600774	汉商集团	35,141	792,429.55	0.17
135	002024	苏宁云商	69,100	791,195.00	0.17
136	600796	钱江生化	63,385	787,875.55	0.17
137	002038	双鹭药业	29,100	777,261.00	0.17
138	000786	北新建材	75,500	776,895.00	0.17
139	600362	江西铜业	45,600	762,888.00	0.16
140	600017	日照港	186,200	754,110.00	0.16
141	600497	驰宏锌锗	105,300	740,259.00	0.16
142	002116	中国海诚	54,700	732,980.00	0.16
143	600661	新南洋	25,232	717,345.76	0.15
144	601901	方正证券	94,300	716,680.00	0.15
145	002321	华英农业	66,800	715,428.00	0.15
146	601111	中国国航	97,000	698,400.00	0.15
147	600643	爱建集团	56,200	697,442.00	0.15
148	000417	合肥百货	80,300	692,989.00	0.15
149	601958	金钼股份	90,400	691,560.00	0.15
150	600841	上柴股份	43,400	685,286.00	0.15
151	002419	天虹商场	45,100	677,402.00	0.14
152	000099	中信海直	57,600	674,496.00	0.14
153	000721	西安饮食	73,100	673,982.00	0.14
154	600782	新钢股份	200,600	670,004.00	0.14
155	300255	常山药业	84,400	666,760.00	0.14
156	600399	抚顺特钢	96,400	662,268.00	0.14
157	600765	中航重机	46,200	662,046.00	0.14
158	601377	兴业证券	86,000	657,900.00	0.14
159	600739	辽宁成大	36,300	651,948.00	0.14
160	601168	西部矿业	83,200	651,456.00	0.14
161	601390	中国中铁	73,500	651,210.00	0.14
162	000751	锌业股份	113,800	647,522.00	0.14
163	000707	双环科技	71,800	641,892.00	0.14
164	601818	光大银行	162,200	634,202.00	0.14
165	600582	天地科技	125,500	623,735.00	0.13
166	000813	德展健康	43,100	621,933.00	0.13
167	002268	卫士通	19,600	615,832.00	0.13
168	600858	银座股份	65,700	614,952.00	0.13
169	000630	铜陵有色	198,800	612,304.00	0.13
170	600386	北巴传媒	45,700	610,095.00	0.13
171	000973	佛塑科技	81,000	607,500.00	0.13

172	600468	百利电气	46,642	607,278.84	0.13
173	000886	海南高速	116,900	604,373.00	0.13
174	601000	唐山港	150,300	602,703.00	0.13
175	601008	连云港	109,600	600,608.00	0.13
176	600522	中天科技	56,100	590,733.00	0.13
177	601880	大连港	210,400	589,120.00	0.13
178	000778	新兴铸管	113,900	588,863.00	0.13
179	000050	深天马 A	31,200	587,184.00	0.13
180	600597	光明乳业	44,500	581,170.00	0.12
181	000157	中联重科	127,700	579,758.00	0.12
182	600111	北方稀土	47,200	579,144.00	0.12
183	000096	广聚能源	38,800	574,240.00	0.12
184	601866	中远海发	138,500	565,080.00	0.12
185	600585	海螺水泥	33,100	561,376.00	0.12
186	000661	长春高新	5,000	559,250.00	0.12
187	000708	大冶特钢	43,800	558,012.00	0.12
188	600498	烽火通信	22,100	557,141.00	0.12
189	600500	中化国际	47,300	551,518.00	0.12
190	002186	全聚德	25,000	550,000.00	0.12
191	601899	紫金矿业	163,700	546,758.00	0.12
192	600820	隧道股份	49,400	543,894.00	0.12
193	600763	通策医疗	16,167	542,241.18	0.12
194	601998	中信银行	83,400	534,594.00	0.11
195	300315	掌趣科技	57,200	528,528.00	0.11
196	000932	华菱钢铁	86,300	522,978.00	0.11
197	600466	蓝光发展	53,600	518,312.00	0.11
198	002400	省广股份	37,200	512,988.00	0.11
199	600798	宁波海运	95,100	507,834.00	0.11
200	600287	江苏舜天	47,300	505,637.00	0.11
201	600018	上港集团	98,100	502,272.00	0.11
202	000001	平安银行	54,500	495,950.00	0.11
203	603567	珍宝岛	24,920	492,419.20	0.10
204	600050	中国联通	66,000	482,460.00	0.10
205	600199	金种子酒	52,543	482,344.74	0.10
206	300157	恒泰艾普	52,200	479,718.00	0.10
207	600170	上海建工	101,000	477,730.00	0.10
208	000825	太钢不锈	121,000	476,740.00	0.10
209	000877	天山股份	67,200	473,760.00	0.10
210	600262	北方股份	15,700	473,669.00	0.10

211	002030	达安基因	20,400	473,280.00	0.10
212	300150	世纪瑞尔	47,000	468,590.00	0.10
213	601628	中国人寿	19,300	464,937.00	0.10
214	600973	宝胜股份	57,500	462,875.00	0.10
215	600315	上海家化	17,036	461,845.96	0.10
216	601789	宁波建工	69,100	461,588.00	0.10
217	600683	京投发展	52,100	461,085.00	0.10
218	601069	西部黄金	20,600	460,616.00	0.10
219	000889	茂业通信	30,100	459,627.00	0.10
220	601601	中国太保	16,300	452,651.00	0.10
221	000839	中信国安	48,600	446,148.00	0.10
222	002302	西部建设	59,200	440,448.00	0.09
223	600975	新五丰	50,300	438,113.00	0.09
224	600495	晋西车轴	60,100	436,326.00	0.09
225	600192	长城电工	46,700	435,711.00	0.09
226	000948	南天信息	24,430	432,411.00	0.09
227	002679	福建金森	10,800	430,272.00	0.09
228	600221	海南航空	130,500	425,430.00	0.09
229	000022	深赤湾 A	22,000	418,660.00	0.09
230	000560	昆百大 A	40,200	418,080.00	0.09
231	600005	武钢股份	121,100	412,951.00	0.09
232	600094	大名城	46,300	412,070.00	0.09
233	603939	益丰药房	13,707	406,275.48	0.09
234	600020	中原高速	89,600	402,304.00	0.09
235	601668	中国建筑	45,400	402,244.00	0.09
236	601988	中国银行	116,900	402,136.00	0.09
237	002025	航天电器	15,800	398,160.00	0.08
238	600557	康缘药业	23,460	397,177.80	0.08
239	002540	亚太科技	50,500	396,425.00	0.08
240	600960	渤海活塞	44,100	390,726.00	0.08
241	600718	东软集团	19,800	389,268.00	0.08
242	600577	精达股份	92,600	387,068.00	0.08
243	600572	康恩贝	52,200	381,582.00	0.08
244	000507	珠海港	60,600	380,568.00	0.08
245	002105	信隆健康	26,353	380,010.26	0.08
246	600361	华联综超	53,500	378,780.00	0.08
247	600655	豫园商城	33,000	376,860.00	0.08
248	002467	二六三	35,800	376,616.00	0.08
249	601003	柳钢股份	78,900	375,564.00	0.08

250	600521	华海药业	16,944	373,276.32	0.08
251	600428	中远海特	60,800	372,096.00	0.08
252	002087	新野纺织	53,010	371,070.00	0.08
253	600628	新世界	26,200	370,206.00	0.08
254	300048	合康变频	44,900	369,078.00	0.08
255	002314	南山控股	48,000	365,760.00	0.08
256	601636	旗滨集团	92,000	356,960.00	0.08
257	600650	锦江投资	15,300	353,736.00	0.08
258	600149	廊坊发展	15,100	353,642.00	0.08
259	600123	兰花科创	43,800	352,152.00	0.08
260	000425	徐工机械	103,900	351,182.00	0.07
261	601608	中信重工	62,300	349,503.00	0.07
262	000758	中色股份	43,700	349,163.00	0.07
263	600815	厦工股份	53,500	344,540.00	0.07
264	000540	中天城投	49,100	340,263.00	0.07
265	600106	重庆路桥	47,800	335,078.00	0.07
266	300122	智飞生物	19,800	326,106.00	0.07
267	600992	贵绳股份	18,500	314,130.00	0.07
268	002294	信立泰	10,616	310,411.84	0.07
269	300212	易华录	8,800	299,200.00	0.06
270	600586	金晶科技	64,200	297,246.00	0.06
271	000582	北部湾港	18,600	295,740.00	0.06
272	000519	江南红箭	19,800	295,020.00	0.06
273	600692	亚通股份	17,448	282,483.12	0.06
274	601226	华电重工	34,300	281,603.00	0.06
275	600871	石化油服	68,000	278,800.00	0.06
276	600741	华域汽车	17,200	274,340.00	0.06
277	600604	市北高新	13,200	272,844.00	0.06
278	000552	靖远煤电	70,400	266,816.00	0.06
279	600249	两面针	29,000	265,350.00	0.06
280	600406	国电南瑞	15,700	261,091.00	0.06
281	000737	南风化工	35,000	260,400.00	0.06
282	600459	贵研铂业	11,300	258,770.00	0.06
283	300164	通源石油	24,900	257,466.00	0.05
284	601117	中国化学	37,900	256,583.00	0.05
285	600248	延长化建	35,900	254,531.00	0.05
286	002554	惠博普	31,100	254,087.00	0.05
287	000792	盐湖股份	13,300	253,631.00	0.05
288	600096	云天化	26,700	253,383.00	0.05

289	000928	中钢国际	14,400	252,432.00	0.05
290	002140	东华科技	18,600	251,472.00	0.05
291	300318	博晖创新	27,495	249,104.70	0.05
292	600426	华鲁恒升	18,800	249,100.00	0.05
293	000731	四川美丰	24,900	248,502.00	0.05
294	002142	宁波银行	14,900	247,936.00	0.05
295	002051	中工国际	10,800	247,536.00	0.05
296	603698	航天工程	8,900	245,551.00	0.05
297	000532	力合股份	13,000	242,840.00	0.05
298	600501	航天晨光	13,300	242,592.00	0.05
299	000830	鲁西化工	43,300	242,047.00	0.05
300	600970	中材国际	34,000	241,060.00	0.05
301	601618	中国中冶	51,700	240,922.00	0.05
302	600704	物产中大	23,200	239,656.00	0.05
303	300287	飞利信	20,100	239,190.00	0.05
304	002286	保龄宝	14,200	238,418.00	0.05
305	600064	南京高科	14,100	236,175.00	0.05
306	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.05
307	600491	龙元建设	19,800	228,492.00	0.05
308	600153	建发股份	21,200	226,840.00	0.05
309	000887	中鼎股份	8,600	223,084.00	0.05
310	000553	沙隆达 A	14,800	222,148.00	0.05
311	600859	王府井	13,500	219,780.00	0.05
312	601107	四川成渝	43,400	219,604.00	0.05
313	002034	美欣达	6,000	217,980.00	0.05
314	600329	中新药业	12,300	214,512.00	0.05
315	600658	电子城	16,100	212,681.00	0.05
316	600200	江苏吴中	11,000	212,410.00	0.05
317	600260	凯乐科技	13,700	212,076.00	0.05
318	600527	江南高纤	29,900	211,692.00	0.05
319	600030	中信证券	13,000	208,780.00	0.04
320	002162	悦心健康	31,400	207,554.00	0.04
321	002191	劲嘉股份	19,900	207,159.00	0.04
322	002381	双箭股份	17,400	203,058.00	0.04
323	002233	塔牌集团	21,600	201,960.00	0.04
324	600620	天宸股份	12,400	200,756.00	0.04
325	600651	飞乐音响	19,000	200,070.00	0.04
326	600231	凌钢股份	72,500	196,475.00	0.04
327	300022	吉峰农机	20,400	193,392.00	0.04

328	000993	闽东电力	13,400	190,414.00	0.04
329	600284	浦东建设	14,400	189,936.00	0.04
330	601336	新华保险	4,200	183,876.00	0.04
331	600865	百大集团	13,500	183,735.00	0.04
332	600482	中国动力	6,000	183,240.00	0.04
333	002258	利尔化学	14,500	180,235.00	0.04
334	300358	楚天科技	10,360	178,606.40	0.04
335	600068	葛洲坝	19,100	175,529.00	0.04
336	002437	誉衡药业	20,600	170,362.00	0.04
337	600682	南京新百	4,500	167,715.00	0.04
338	600019	宝钢股份	26,300	167,005.00	0.04
339	600395	盘江股份	20,300	163,821.00	0.03
340	002711	欧浦智网	10,800	162,000.00	0.03
341	601669	中国电建	21,400	155,364.00	0.03
342	002207	准油股份	7,700	155,001.00	0.03
343	600113	浙江东日	7,100	154,141.00	0.03
344	600369	西南证券	21,400	152,582.00	0.03
345	000783	长江证券	14,700	150,381.00	0.03
346	600717	天津港	14,900	150,192.00	0.03
347	600229	城市传媒	12,900	146,802.00	0.03
348	002356	赫美集团	5,903	142,852.60	0.03
349	002060	粤水电	18,200	140,140.00	0.03
350	002040	南京港	6,600	135,894.00	0.03
351	600313	农发种业	20,000	132,000.00	0.03
352	300008	天海防务	5,400	131,706.00	0.03
353	601890	亚星锚链	14,200	124,818.00	0.03
354	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.03
355	300142	沃森生物	11,200	122,080.00	0.03
356	002187	广百股份	8,600	121,432.00	0.03
357	603123	翠微股份	11,400	119,700.00	0.03
358	002004	华邦健康	12,400	112,468.00	0.02
359	300003	乐普医疗	6,200	111,166.00	0.02
360	300026	红日药业	19,900	108,057.00	0.02
361	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
362	601179	中国西电	19,100	106,578.00	0.02
363	600558	大西洋	18,400	105,800.00	0.02
364	601369	陕鼓动力	15,300	104,805.00	0.02
365	600529	山东药玻	4,900	104,174.00	0.02
366	002236	大华股份	7,600	103,968.00	0.02

367	600565	迪马股份	14,000	103,880.00	0.02
368	000030	富奥股份	12,200	103,700.00	0.02
369	600716	凤凰股份	13,400	102,778.00	0.02
370	002285	世联行	13,400	101,840.00	0.02
371	600601	方正科技	22,100	101,660.00	0.02
372	600748	上实发展	12,300	100,737.00	0.02
373	002396	星网锐捷	5,100	100,470.00	0.02
374	603169	兰石重装	7,500	100,200.00	0.02
375	600223	鲁商置业	18,400	100,096.00	0.02
376	002528	英飞拓	13,500	99,360.00	0.02
377	000656	金科股份	18,900	99,036.00	0.02
378	002177	御银股份	12,900	98,814.00	0.02
379	600507	方大特钢	14,500	98,165.00	0.02
380	603766	隆鑫通用	4,700	97,666.00	0.02
381	000898	鞍钢股份	19,200	96,768.00	0.02
382	002016	世荣兆业	10,100	96,657.00	0.02
383	600511	国药股份	3,200	96,320.00	0.02
384	002738	中矿资源	3,600	94,932.00	0.02
385	601717	郑煤机	13,400	94,202.00	0.02
386	600729	重庆百货	4,000	93,720.00	0.02
387	002416	爱施德	6,100	89,853.00	0.02
388	600197	伊力特	6,200	89,838.00	0.02
389	603979	金诚信	5,000	89,150.00	0.02
390	000785	武汉中商	6,200	88,412.00	0.02
391	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
392	603308	应流股份	3,900	85,488.00	0.02
393	600998	九州通	4,100	85,034.00	0.02
394	600648	外高桥	4,300	84,882.00	0.02
395	600552	凯盛科技	4,600	84,778.00	0.02
396	600350	山东高速	12,700	82,296.00	0.02
397	600039	四川路桥	17,200	81,528.00	0.02
398	002462	嘉事堂	1,900	80,807.00	0.02
399	600036	招商银行	4,400	77,440.00	0.02
400	002261	拓维信息	6,430	76,645.60	0.02
401	000400	许继电气	4,200	76,230.00	0.02
402	002383	合众思壮	1,500	74,250.00	0.02
403	601800	中国交建	4,800	72,912.00	0.02
404	002527	新时达	5,400	72,414.00	0.02
405	300155	安居宝	5,700	71,763.00	0.02

406	600141	兴发集团	4,700	71,487.00	0.02
407	603111	康尼机电	4,800	70,560.00	0.02
408	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
409	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
410	601166	兴业银行	4,300	69,402.00	0.01
411	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
412	002598	山东章鼓	4,800	68,352.00	0.01
413	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
414	601318	中国平安	1,900	67,317.00	0.01
415	601211	国泰君安	3,600	66,924.00	0.01
416	600056	中国医药	3,500	66,605.00	0.01
417	000066	长城电脑	5,300	65,932.00	0.01
418	600898	三联商社	3,800	65,132.00	0.01
419	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
420	300191	潜能恒信	1,800	61,920.00	0.01
421	300482	万孚生物	800	59,392.00	0.01
422	600060	海信电器	3,400	58,208.00	0.01
423	002014	永新股份	3,500	56,000.00	0.01
424	300197	铁汉生态	4,300	54,524.00	0.01
425	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
426	000636	风华高科	5,500	53,680.00	0.01
427	600085	同仁堂	1,700	53,346.00	0.01
428	600967	北方创业	3,900	52,923.00	0.01
429	600985	雷鸣科化	3,500	52,185.00	0.01
430	000919	金陵药业	3,800	51,414.00	0.01
431	002403	爱仕达	3,500	51,170.00	0.01
432	601137	博威合金	3,900	50,973.00	0.01
433	600523	贵航股份	2,200	50,468.00	0.01
434	300040	九洲电气	4,300	49,278.00	0.01
435	000925	众合科技	2,000	49,140.00	0.01
436	300171	东富龙	3,300	49,137.00	0.01
437	601798	蓝科高新	3,600	48,744.00	0.01
438	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
439	601009	南京银行	4,400	47,696.00	0.01
440	002093	国脉科技	4,300	47,601.00	0.01
441	000017	深中华 A	3,600	45,360.00	0.01
442	000987	越秀金控	3,100	44,919.00	0.01
443	600502	安徽水利	4,500	44,910.00	0.01
444	002110	三钢闽光	3,300	43,560.00	0.01

445	600745	中茵股份	2,000	42,800.00	0.01
446	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
447	002390	信邦制药	4,300	42,527.00	0.01
448	600351	亚宝药业	4,300	42,484.00	0.01
449	002149	西部材料	1,500	42,075.00	0.01
450	002022	科华生物	2,100	42,000.00	0.01
451	002393	力生制药	1,000	41,300.00	0.01
452	002020	京新药业	3,600	40,752.00	0.01
453	601766	中国中车	4,100	40,057.00	0.01
454	300038	梅泰诺	900	39,366.00	0.01
455	600835	上海机电	2,000	39,040.00	0.01
456	300161	华中数控	1,500	39,000.00	0.01
457	300330	华虹计通	2,000	38,500.00	0.01
458	600536	中国软件	1,600	38,496.00	0.01
459	300417	南华仪器	700	38,402.00	0.01
460	300338	开元仪器	1,500	38,400.00	0.01
461	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
462	300306	远方光电	1,600	37,840.00	0.01
463	600663	陆家嘴	1,700	37,621.00	0.01
464	601968	宝钢包装	3,900	37,323.00	0.01
465	300024	机器人	1,700	36,346.00	0.01
466	300397	天和防务	1,400	36,092.00	0.01
467	600332	白云山	1,500	35,970.00	0.01
468	603228	景旺电子	1,538	35,620.08	0.01
469	600048	保利地产	3,900	35,607.00	0.01
470	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
471	300007	汉威电子	1,800	34,866.00	0.01
472	600837	海通证券	2,200	34,650.00	0.01
473	603886	元祖股份	1,954	34,585.80	0.01
474	002658	雪迪龙	2,000	34,400.00	0.01
475	600958	东方证券	2,200	34,166.00	0.01
476	300216	千山药机	1,000	33,930.00	0.01
477	600271	航天信息	1,700	33,915.00	0.01
478	600272	开开实业	1,700	32,742.00	0.01
479	002756	永兴特钢	1,100	32,428.00	0.01
480	000906	物产中拓	2,200	32,252.00	0.01
481	000666	经纬纺机	1,500	32,055.00	0.01
482	300250	初灵信息	1,000	32,050.00	0.01
483	603703	盛洋科技	900	32,040.00	0.01

484	600697	欧亚集团	1,000	32,030.00	0.01
485	600487	亨通光电	1,700	31,722.00	0.01
486	300205	天喻信息	2,200	31,548.00	0.01
487	300371	汇中股份	800	31,424.00	0.01
488	603227	雪峰科技	3,800	31,388.00	0.01
489	002114	罗平锌电	1,400	31,024.00	0.01
490	600354	敦煌种业	3,400	30,974.00	0.01
491	300416	苏试试验	900	30,915.00	0.01
492	600486	扬农化工	800	30,296.00	0.01
493	600845	宝信软件	1,700	29,988.00	0.01
494	603077	和邦生物	5,800	29,696.00	0.01
495	000970	中科三环	2,200	29,370.00	0.01
496	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
497	300298	三诺生物	1,600	29,024.00	0.01
498	600325	华发股份	2,200	28,160.00	0.01
499	002243	通产丽星	2,000	27,280.00	0.01
500	600420	现代制药	800	26,496.00	0.01
501	300396	迪瑞医疗	700	26,481.00	0.01
502	600889	南京化纤	2,000	26,300.00	0.01
503	600706	曲江文旅	1,300	25,792.00	0.01
504	300445	康斯特	900	25,740.00	0.01
505	300314	戴维医疗	1,200	25,512.00	0.01
506	000610	西安旅游	1,700	25,313.00	0.01
507	300070	碧水源	1,400	24,528.00	0.01
508	600879	航天电子	1,600	24,384.00	0.01
509	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
510	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
511	300101	振芯科技	1,300	24,102.00	0.01
512	600640	号百控股	1,200	23,976.00	0.01
513	002019	亿帆医药	1,500	22,935.00	0.00
514	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
515	600764	中电广通	800	22,648.00	0.00
516	002603	以岭药业	1,300	22,412.00	0.00
517	600378	天科股份	1,500	22,365.00	0.00
518	600526	菲达环保	1,800	22,122.00	0.00
519	603899	晨光文具	1,200	21,840.00	0.00
520	600594	益佰制药	1,300	21,645.00	0.00
521	000566	海南海药	1,700	21,607.00	0.00
522	002727	一心堂	1,000	21,200.00	0.00

523	601933	永辉超市	4,300	21,113.00	0.00
524	002317	众生药业	1,700	20,995.00	0.00
525	002442	龙星化工	1,500	20,940.00	0.00
526	600618	氯碱化工	1,400	20,426.00	0.00
527	601058	赛轮金宇	5,000	20,350.00	0.00
528	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
529	000795	英洛华	3,200	20,256.00	0.00
530	300189	神农基因	3,800	19,950.00	0.00
531	300087	荃银高科	1,500	19,845.00	0.00
532	600371	万向德农	1,200	19,596.00	0.00
533	000936	华西股份	2,000	19,580.00	0.00
534	002671	龙泉股份	1,600	19,216.00	0.00
535	600761	安徽合力	1,500	19,080.00	0.00
536	000958	东方能源	1,300	18,889.00	0.00
537	002254	泰和新材	1,500	18,540.00	0.00
538	600831	广电网络	1,400	18,284.00	0.00
539	300032	金龙机电	1,100	17,699.00	0.00
540	600549	厦门钨业	800	17,616.00	0.00
541	300144	宋城演艺	841	17,610.54	0.00
542	603100	川仪股份	1,100	17,160.00	0.00
543	000523	广州浪奇	1,500	17,040.00	0.00
544	601169	北京银行	1,700	16,592.00	0.00
545	002247	帝龙文化	900	16,281.00	0.00
546	600470	六国化工	1,900	16,188.00	0.00
547	600877	中国嘉陵	1,700	15,912.00	0.00
548	601607	上海医药	800	15,648.00	0.00
549	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
550	000683	远兴能源	4,800	15,264.00	0.00
551	002041	登海种业	800	15,104.00	0.00
552	000893	东凌国际	1,300	15,067.00	0.00
553	000429	粤高速 A	2,200	15,048.00	0.00
554	600540	新赛股份	1,900	15,029.00	0.00
555	600281	太化股份	2,000	14,960.00	0.00
556	600317	营口港	4,300	14,921.00	0.00
557	002220	天宝股份	1,100	14,839.00	0.00
558	601101	昊华能源	2,200	14,696.00	0.00
559	002648	卫星石化	1,200	14,664.00	0.00
560	600127	金健米业	2,200	14,630.00	0.00
561	300138	晨光生物	800	14,584.00	0.00

562	002772	众兴菌业	700	14,399.00	0.00
563	300027	华谊兄弟	1,300	14,300.00	0.00
564	600162	香江控股	3,600	14,292.00	0.00
565	600208	新湖中宝	3,400	14,144.00	0.00
566	300320	海达股份	800	14,048.00	0.00
567	600016	民生银行	1,500	13,620.00	0.00
568	002224	三力士	900	13,536.00	0.00
569	300175	朗源股份	1,000	13,300.00	0.00
570	002251	步步高	800	13,160.00	0.00
571	002697	红旗连锁	1,600	12,928.00	0.00
572	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
573	002044	美年健康	900	11,862.00	0.00
574	000039	中集集团	800	11,696.00	0.00
575	002096	南岭民爆	800	11,560.00	0.00
576	300259	新天科技	1,100	11,396.00	0.00
577	000863	三湘印象	1,300	11,037.00	0.00
578	002320	海峡股份	700	10,927.00	0.00
579	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
580	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
581	600787	中储股份	1,100	9,977.00	0.00
582	000880	潍柴重机	700	9,807.00	0.00
583	000561	烽火电子	800	9,752.00	0.00
584	002176	江特电机	800	9,544.00	0.00
585	300098	高新兴	600	9,504.00	0.00
586	000718	苏宁环球	1,100	9,493.00	0.00
587	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
588	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
589	600171	上海贝岭	600	8,430.00	0.00
590	000536	华映科技	550	8,398.50	0.00
591	600747	大连控股	1,500	7,800.00	0.00
592	600461	洪城水业	1,020	7,762.20	0.00
593	600190	锦州港	1,800	7,488.00	0.00
594	000667	美好置业	2,000	7,380.00	0.00
595	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
596	000801	四川九洲	681	7,239.03	0.00
597	002059	云南旅游	599	7,170.03	0.00
598	600360	华微电子	800	7,088.00	0.00
599	601288	农业银行	2,200	6,820.00	0.00
600	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

601	002325	洪涛股份	800	6,408.00	0.00
602	600580	卧龙电气	700	6,370.00	0.00
603	002504	弘高创意	800	6,328.00	0.00
604	000545	金浦钛业	1,000	5,810.00	0.00
605	600010	包钢股份	2,000	5,580.00	0.00
606	000018	神州长城	500	5,350.00	0.00
607	000592	平潭发展	700	4,732.00	0.00
608	002523	天桥起重	700	4,690.00	0.00
609	000598	兴蓉环境	726	4,181.76	0.00
610	000725	京东方 A	1,300	3,718.00	0.00
611	600561	江西长运	71	985.48	0.00
612	002077	大港股份	35	625.80	0.00

## 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	600685	中船防务	9,791,555.00	2.09
2	600150	中国船舶	8,963,282.74	1.91
3	600679	上海凤凰	8,777,712.00	1.87
4	002186	全聚德	8,331,060.90	1.78
5	600367	红星发展	8,073,070.05	1.72
6	000733	振华科技	7,463,291.73	1.59
7	000721	西安饮食	7,098,528.91	1.51
8	601857	中国石油	7,064,096.00	1.51
9	600409	三友化工	7,004,578.08	1.49
10	600099	林海股份	6,331,236.02	1.35
11	601989	中国重工	6,113,395.53	1.30
12	600677	航天通信	5,875,673.00	1.25
13	600343	航天动力	5,856,244.00	1.25
14	600118	中国卫星	5,853,058.50	1.25
15	002125	湘潭电化	5,709,181.64	1.22
16	000901	航天科技	5,640,937.00	1.20
17	000701	厦门信达	5,471,172.78	1.17
18	002049	紫光国芯	5,241,924.60	1.12

19	600433	冠豪高新	5,107,664.29	1.09
20	300114	中航电测	5,015,554.05	1.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002186	全聚德	7,724,349.16	1.65
2	000721	西安饮食	6,759,018.42	1.44
3	600679	上海凤凰	6,446,288.26	1.37
4	600150	中国船舶	5,443,696.28	1.16
5	600685	中船防务	5,420,281.06	1.15
6	600099	林海股份	4,984,402.77	1.06
7	000039	中集集团	4,701,114.76	1.00
8	000733	振华科技	4,599,718.14	0.98
9	600992	贵绳股份	4,237,997.55	0.90
10	600677	航天通信	4,236,292.43	0.90
11	600343	航天动力	4,210,014.36	0.90
12	600118	中国卫星	4,203,525.00	0.90
13	002179	中航光电	4,093,691.75	0.87
14	600558	大西洋	3,855,789.06	0.82
15	000701	厦门信达	3,833,280.00	0.82
16	000707	双环科技	3,765,745.20	0.80
17	600635	大众公用	3,697,235.00	0.79
18	600612	老凤祥	3,683,128.24	0.78
19	601857	中国石油	3,627,528.00	0.77
20	000885	同力水泥	3,474,277.52	0.74

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	1,464,702,457.63
卖出股票收入（成交）总额	1,149,350,474.92

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

本基金报告期末未投资债券。

## 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

本基金报告期末未投资债券。

## 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 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	440,400.08
2	应收证券清算款	1,865,811.78
3	应收股利	-
4	应收利息	42,572.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,348,784.62

### 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

### 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
181	2,471,118.30	440,183,882.63	98.42%	7,088,528.99	1.58%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	4,627.73	0.0010%
------------------	----------	---------

### 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（2016年2月3日）基金份额总额	211,164,009.95
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	518,153,187.03
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	282,044,785.36
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	447,272,411.62

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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2016年1月13日，任少华先生不再担任公司董事一职，由范力、冯玉泉担任公司第二届董事会董事；

2、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。

3、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。

4、2016年5月4日，吕晖先生担任公司副总经理。

5、2016年12月28日，全卓伟女士不再担任公司董事一职，由倪雪梅女士担任公司第二届

董事会董事。

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。

### 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

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 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），该事务所自本基金成立起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 60000 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

本报告期内，基金管理人、基金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

#### 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	
东吴证券		22,452,072,630.35	93.92%	545,270.15	93.93%	-
招商证券	2	158,677,996.41	6.08%	35,212.11	6.07%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

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

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

#### 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期退租 1 个交易单元：华创证券。新增 3 个交易单元：广发证券 1 个、招商证券 2

个。

### 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
东吴证券	27,788,358.42	100.00%	5,233,500,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月6日
2	东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年1月16日
3	东吴基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年1月16日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月18日
5	东吴基金管理有限公司关于东吴	上海证券报、证券时	2016年1月21日

	安盈量化灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告	报、公司网站	
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石投资管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海联泰资产管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
9	东吴基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
10	东吴基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 2 月 3 日
11	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 4 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中经北证（北京）资产管理有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 2 月 19 日
13	东吴基金管理有限公司关于参加	中国证券报、上海证	2016 年 2 月 19 日

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

20	东吴基金管理有限公司关于参加珠海盈米财富管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年3月25日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金参加东吴证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016年4月13日
22	东吴基金管理有限公司关于公司副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年5月4日
23	东吴基金管理有限公司关于网上交易系统招商银行支付渠道费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年5月24日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年6月1日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年6月2日
26	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2016年6月8日

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

		网)	
33	东吴基金管理有限公司管理的基金 2016 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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 7 月 1 日
34	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 7 日
35	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 20 日
36	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京晟视天下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 8 月 10 日
37	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告以及摘要	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
38	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 9 月 14 日
39	东吴基金管理有限公司关于旗下基金上海万得投资顾问有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 9 月 14 日
40	东吴基金管理有限公司关于参加上海万得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	2016 年 9 月 14 日
41	东吴基金管理有限公司更正公告	中国证券报、上海证	2016 年 9 月 19 日

		券报、证券时报、证券日报、公司网站	
42	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	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 9 月 20 日
43	东吴基金管理有限公司关于参加诺亚正行（上海）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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 9 月 23 日
44	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 9 月 28 日
45	东吴基金管理有限公司关于参加上海基煜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	2016 年 9 月 28 日
46	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增一路财富（北京）信息科技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 10 月 14 日
47	东吴基金管理有限公司关于参加一路财富（北京）信息科技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 10 月 14 日

48	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 10 月 24 日
49	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 10 月 26 日
50	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 10 月 28 日
51	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京汇成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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 11 月 14 日
52	东吴基金管理有限公司关于参加北京汇成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 11 月 14 日
53	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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 11 月 21 日
54	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2016 年 11 月 29 日

	及定期定额投资手续费率优惠的公告	深交所（巨潮资讯网）	
55	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增杭州科地瑞富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、深交所（巨潮资讯网）	2016年12月7日
56	东吴基金管理有限公司关于参加杭州科地瑞富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12月7日
57	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京恒天明泽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、深交所（巨潮资讯网）	2016年12月7日
58	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京微动利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	2016年12月16日
59	东吴基金管理有限公司关于参加北京微动利投资管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年12月16日
60	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	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12月22日

61	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行股份有限公司申购及定期定额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	2016 年 12 月 28 日
62	东吴基金管理有限公司管理的基金 2016 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 12 月 31 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安盈量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 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  
2017 年 3 月 27 日