

# 东吴新创业混合型证券投资基金 2016 年年 度报告 摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月二十七日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东吴新创业混合
场内简称	-
基金主代码	580007
交易代码	580007
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	2010 年 6 月 29 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	107,731,805.20 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，主要投资于市场中的中小盘股票，包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。通过精选具有合理价值的高成长中小盘股，追求超越市场的收益。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，动态调整股票、债券、现金等大类资产的配置。运用本公司自行开发的东吴 GARP 策略选股模型，精选具有成长优势与估值优势的创业型上市公司股票。
业绩比较基准	(标普中国 A 股 200 指数*50%+标普中国 A 股小盘 300 指数*50%)*75%+中证全债指数*25%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益较高的基金产品。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	郭明
	联系电话	021-50509888-8308	010-66105799
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95588
传真		021-50509888-8211	010-66105798

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

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

## § 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	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-1,348,585.16	22,298,074.51	15,184,184.55
本期利润	-3,534,586.46	19,566,020.71	13,225,744.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0393	0.8493	0.2311
本期基金份额净值增长率	-19.96%	46.11%	21.32%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0299	0.7465	0.1947
期末基金资产净值	110,948,025.66	23,249,798.54	44,994,270.45
期末基金份额净值	1.030	1.746	1.195

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

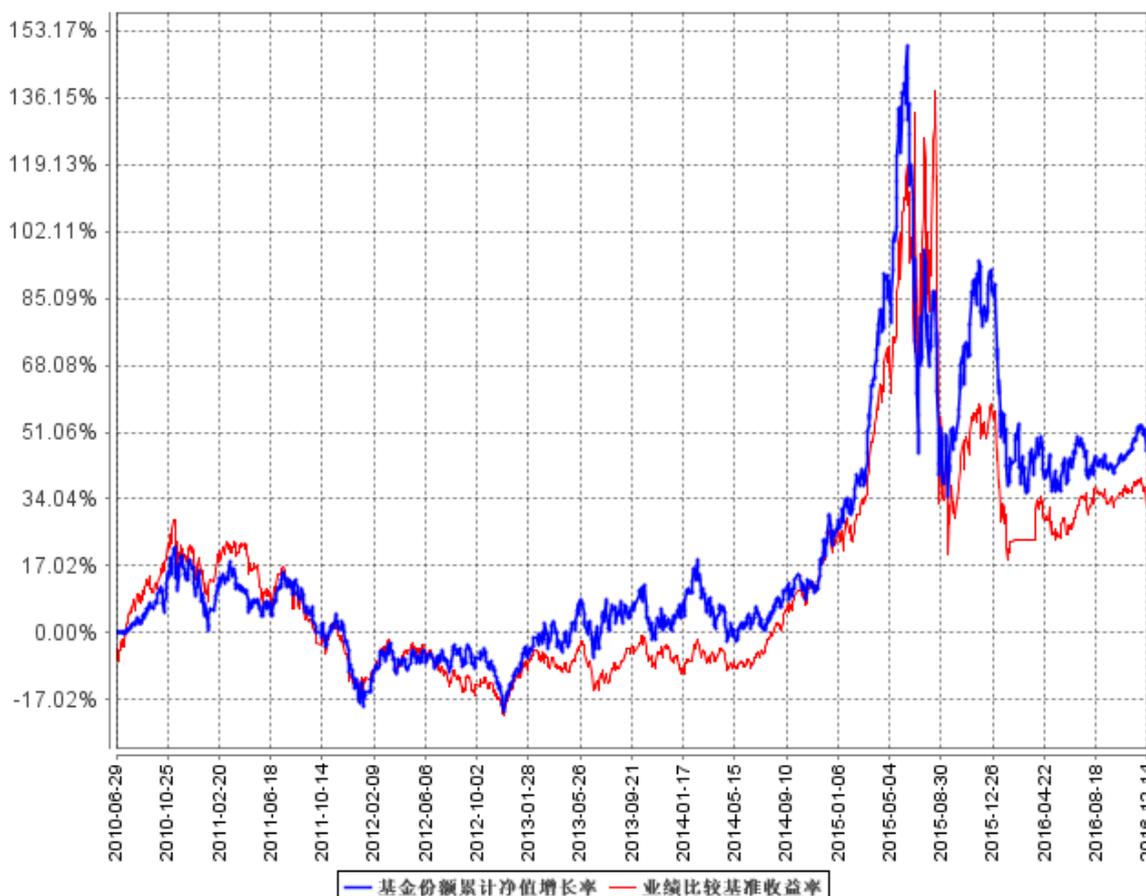
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	4.21%	0.56%	-0.66%	0.60%	4.87%	-0.04%
过去六个月	1.34%	0.72%	2.47%	0.67%	-1.13%	0.05%
过去一年	-19.96%	1.55%	-13.82%	1.38%	-6.14%	0.17%
过去三年	41.88%	1.93%	42.16%	1.56%	-0.28%	0.37%
过去五年	67.77%	1.72%	54.37%	1.38%	13.40%	0.34%
自基金合同生效起至今	47.56%	1.60%	32.44%	1.34%	15.12%	0.26%

注：比较基准=( 标普中国 A 股 200 指数\*50%+标普中国 A 股小盘 300 指数\*50% ) \*75%+中证全债指数\*25%

#### 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

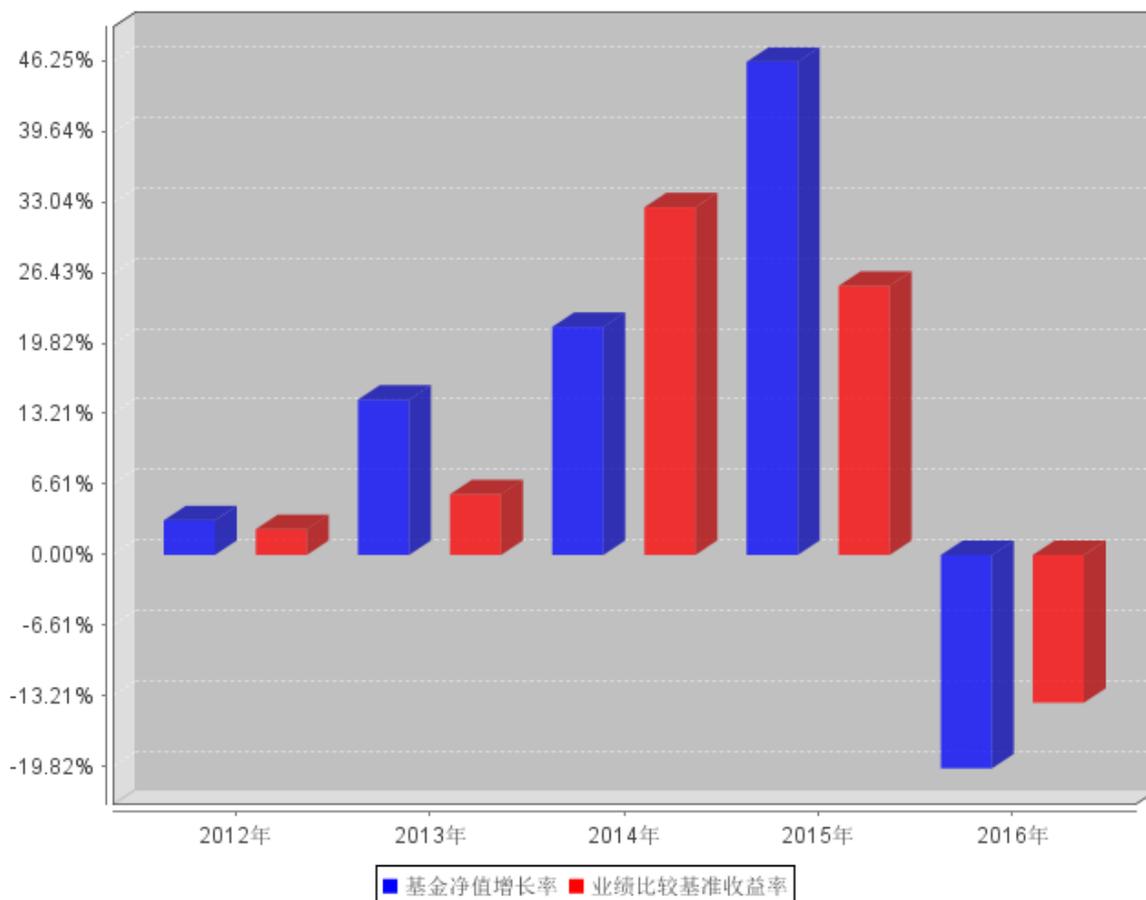


注：1. 东吴新创业基金于 2010 年 6 月 29 日成立。

2. 比较基准=( 标普中国 A 股 200 指数\*50%+标普中国 A 股小盘 300 指数\*50% ) \*75%+中证全债指数\*25%

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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：本基金于 2010 年 6 月 29 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	3.6000	1,534,505,740.07	1,721,685.62	1,536,227,425.69	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	3.6000	1,534,505,740.07	1,721,685.62	1,536,227,425.69	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地为上海市浦东新区源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生(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		
徐贲	本基金基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	6.5 年	硕士，香港中文大学毕业。2009 年 7 月至 2010 年 12 月就职于埃森哲咨询公司上海分公司任行业研究员，自 2011 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中 2015 年 5 月 12 日起担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理、2015 年 5 月 29 日起担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理、2015 年 5 月 29 日起担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

市场在过去的一年里呈现先下跌后反弹的态势。最终上证综指下跌 12%,创业板指下跌 27%。期间,周期股和蓝筹股整体走势好于中小市值公司。

东吴新创业基金在年初熔断期间表现相对较好,但在之后三月的创业板反弹时没有把握住小票反弹的机会。五六月份东吴新创业基金加仓新能源汽车和电子板块,获得较好收益,但下半年在市场偏好明显转向价值蓝筹时,虽也加强了 PPP 板块的配置,但仍布局较多成长股,导致业绩跑输上证综指。

#### 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 1.030 元，累计净值 1.450 元；本报告期份额净值增长率-19.96%，同期业绩比较基准收益率为-13.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2017 年 A 股市场走势可能呈现“两头高、中间低”的走势。

一季度 PPI 有望继续走高，市场预期中国经济将短暂企稳，上游和中游企业的业绩将同比大幅改善，从而刺激相关公司的股价走高。随着周期股和低估值蓝筹股的股价走强，整体较暖的市场环境也有望给中小市值公司股价带来阶段性反弹的机会。

二季度的宏观数据可能令投资者修正之前对中国经济较乐观的预期，从而制约周期股进一步上升的动力。市场可能呈现出阶段性温和调整的态势。而到四季度，经过两年的估值消化，一些优质的成长股可能会迎来新一轮上涨的序幕，而周期股在经过预期修正之后，可能也会出现新一波上涨。

我们认为今年 A 股的波动区间不会很大，但波动会比较频繁，因此我们将波段操作周期股，而在市场调整时买入被错杀的真成长个股，以期获得较好的收益。

#### 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、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、运营总监、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；运营总监、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；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

本基金合同约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配八次，基金

收益分配后每一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。

本基金于 2016 年 10 月 20 日发布分红公告，向截至 2016 年 10 月 24 日止在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人发放红利，每 10 份基金份额派发红利 3.6 元，共计分配利润为 1,536,227,425.69 元，符合基金合同的有关约定。

#### **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**

因赎回等原因，本基金持续出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，已上报中国证券监督管理委员会，公司正在拟定相关应对方案，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。

### **§ 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**

本报告期内，本基金托管人在对东吴创新创业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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**

本报告期内，东吴创新创业混合型证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴创新创业混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东吴创新创业混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴创新创业混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了

核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了天衡审字（2017）00524 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东吴新创业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	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	5,258,356.00	3,608,544.43
结算备付金	764,741.29	264,894.96
存出保证金	60,258.87	72,505.44
交易性金融资产	105,042,372.91	17,969,961.08
其中：股票投资	75,488,772.91	17,969,961.08
基金投资	-	-
债券投资	29,553,600.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,687,256.84
应收利息	544,215.13	807.55
应收股利	-	-
应收申购款	-	70,976.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	111,669,944.20	23,674,946.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	17,745.71	8,081.71
应付管理人报酬	142,495.91	30,037.92
应付托管费	23,749.31	5,006.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	407,870.30	152,000.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	130,057.31	230,021.76
负债合计	721,918.54	425,148.28
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	107,731,805.20	13,312,599.95
未分配利润	3,216,220.46	9,937,198.59
所有者权益合计	110,948,025.66	23,249,798.54
负债和所有者权益总计	111,669,944.20	23,674,946.82

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 107,731,805.20 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴新创业混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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>	-252,479.45	21,777,207.17
1. 利息收入	1,382,446.45	51,844.93
其中：存款利息收入	750,607.96	49,598.17
债券利息收入	89,101.03	2,246.76
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	542,737.46	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-4,826,819.27	24,380,555.03
其中：股票投资收益	-4,900,567.48	24,045,981.23
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	175,342.60
资产支持证券投资收益	-	-

贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	73,748.21	159,231.20
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-2,186,001.30	-2,732,053.80
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	5,377,894.67	76,861.01
<b>减：二、费用</b>	<b>3,282,107.01</b>	<b>2,211,186.46</b>
1.管理人报酬	1,710,899.14	544,302.56
2.托管费	285,149.84	90,717.13
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,118,085.07	1,267,500.42
5.利息支出	-	200.35
其中：卖出回购金融资产支出	-	200.35
6.其他费用	167,972.96	308,466.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-3,534,586.46</b>	<b>19,566,020.71</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-3,534,586.46</b>	<b>19,566,020.71</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东吴新创业混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1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)	13,312,599.95	9,937,198.59	23,249,798.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-3,534,586.46	-3,534,586.46
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)	94,419,205.25	1,533,041,034.02	1,627,460,239.27
其中：1.基金申购款	4,355,001,068.68	1,577,266,424.49	5,932,267,493.17
2.基金赎回款	-4,260,581,863.43	-44,225,390.47	-4,304,807,253.90

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）	-	-1,536,227,425.69	-1,536,227,425.69
五、期末所有者权益（基金净值）	107,731,805.20	3,216,220.46	110,948,025.66
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）	37,662,102.44	7,332,168.01	44,994,270.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	19,566,020.71	19,566,020.71
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）	-24,349,502.49	-16,960,990.13	-41,310,492.62
其中：1.基金申购款	42,469,336.20	16,955,393.53	59,424,729.73
2.基金赎回款	-66,818,838.69	-33,916,383.66	-100,735,222.35
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）	13,312,599.95	9,937,198.59	23,249,798.54

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

东吴新创业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[2010]568号《关于同意东吴新创业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于2010年6月29日正式生效，首次设立募集规模为434,036,741.03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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，东吴基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 7 日起，将“东吴创新创业股票型证券投资基金”更名为“东吴创新创业混合型证券投资基金”，基金类别“股票型基金”变更为“混合型基金”。

本基金为混合型基金，主要投资于市场中的创业型股票，包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。

本基金业绩比较基准（标普中国 A 股 200 指数\*50%+标普中国 A 股小盘 300 指数\*50%）\*75%+中证全债指数\*25%（该基金原业绩比较基准“中信标普 200 指数”及“中信标普小盘指数”自 2015 年 11 月 17 日变更为“标普中国 A 股 200 指数”和“标普中国 A 股小盘 300 指数”；该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自 2015 年 9 月 28 日变更为“中证全债指数”）

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴创新创业混合型证券投资基金基金合同》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

#### 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。

#### 7.4.4 本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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、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) 每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 投资者可以选择现金分红或红利再投资方式，以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；
- (3) 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- (4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (5) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (6) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配八次，至少分配一次，但若成立不满 3 个月可不进行收益分配；
- (7) 全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 50%；
- (8) 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计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基

金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 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 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	226,640,390.49	29.73%	-	-

##### 7.4.8.1.2 债券交易

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	24,698,400.96	100.00%	-	-

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1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	23,000,000.00	100.00%	-	-

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1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	211,070.01	14.88%	-	-
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 (%)
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-

注：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。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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

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 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管理费	1,710,899.14	544,302.56
其中：支付销售机构的客户维护费	-	208,562.28

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 × 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 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 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	285,149.84	90,717.13

注：支付基金托管人中国工商银行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 × 0.25% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有本基金份额。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	5,258,356.00	648,203.77	3,608,544.43	43,254.55

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002156	通富微电	2016年12月28日	重大资产重组	11.38	2017年1月4日	14.51	67,600	761,176.00	769,288.00	-
600303	曙光股份	2016年12月15日	重大事项	9.02	2017年1月17日	9.92	71,900	724,696.00	648,538.00	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大资产重组	7.48	2017年1月18日	6.73	37,200	262,260.00	278,256.00	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

## § 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	75,488,772.91	67.60
	其中：股票	75,488,772.91	67.60
2	固定收益投资	29,553,600.00	26.47
	其中：债券	29,553,600.00	26.47
	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	6,023,097.29	5.39
7	其他各项资产	604,474.00	0.54
8	合计	111,669,944.20	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	2,240,548.00	2.02
B	采矿业	751,803.00	0.68

C	制造业	46,363,030.63	41.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,522,997.46	4.08
E	建筑业	2,420,204.00	2.18
F	批发和零售业	4,542,430.50	4.09
G	交通运输、仓储和邮政业	2,301,243.00	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,124,362.00	2.82
J	金融业	278,256.00	0.25
K	房地产业	6,727,636.00	6.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,216,262.32	2.00
S	综合	-	-
	合计	75,488,772.91	68.04

### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600284	浦东建设	66,300	874,497.00	0.79
2	002600	江粉磁材	81,600	835,584.00	0.75
3	002232	启明信息	61,100	813,241.00	0.73
4	300041	回天新材	64,251	802,494.99	0.72
5	600309	万华化学	37,200	800,916.00	0.72

6	601965	中国汽研	75,200	800,880.00	0.72
7	002001	新和成	40,600	795,760.00	0.72
8	002615	哈尔斯	45,300	795,015.00	0.72
9	600305	恒顺醋业	68,000	794,240.00	0.72
10	600704	物产中大	76,800	793,344.00	0.72

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601998	中信银行	9,356,068.00	40.24
2	600499	科达洁能	8,384,848.00	36.06
3	600050	中国联通	8,163,819.00	35.11
4	600036	招商银行	8,154,212.00	35.07
5	002358	森源电气	6,192,406.00	26.63
6	600666	奥瑞德	6,117,739.76	26.31
7	600519	贵州茅台	5,874,986.92	25.27
8	002458	益生股份	5,421,549.00	23.32
9	002475	立讯精密	4,899,983.00	21.08
10	300207	欣旺达	4,898,312.00	21.07
11	300203	聚光科技	4,796,621.03	20.63
12	600004	白云机场	4,762,763.35	20.49
13	000509	华塑控股	4,652,674.40	20.01
14	002041	登海种业	4,587,945.00	19.73
15	002488	金固股份	4,455,903.24	19.17
16	000400	许继电气	4,434,258.00	19.07
17	002217	合力泰	4,137,072.16	17.79
18	600517	置信电气	3,764,379.26	16.19
19	600745	中茵股份	3,524,605.97	15.16
20	603808	歌力思	3,263,436.00	14.04
21	002434	万里扬	3,024,938.00	13.01
22	002454	松芝股份	2,824,500.06	12.15
23	300031	宝通科技	2,534,148.79	10.90
24	002655	共达电声	2,497,006.75	10.74

25	603010	万盛股份	2,438,574.80	10.49
26	300261	雅本化学	2,131,857.00	9.17
27	600529	山东药玻	2,077,175.00	8.93
28	601028	玉龙股份	2,024,202.00	8.71
29	601199	江南水务	1,979,076.00	8.51
30	000060	中金岭南	1,834,911.00	7.89
31	002284	亚太股份	1,821,823.00	7.84
32	002439	启明星辰	1,809,583.00	7.78
33	002001	新和成	1,807,629.27	7.77
34	600236	桂冠电力	1,740,442.00	7.49
35	300073	当升科技	1,699,068.21	7.31
36	300032	金龙机电	1,684,636.98	7.25
37	000807	云铝股份	1,644,849.00	7.07
38	600348	阳泉煤业	1,628,709.00	7.01
39	600699	均胜电子	1,605,792.00	6.91
40	300347	泰格医药	1,585,996.00	6.82
41	300113	顺网科技	1,575,724.00	6.78
42	002467	二六三	1,505,366.49	6.47
43	002311	海大集团	1,500,927.00	6.46
44	002138	顺络电子	1,485,526.00	6.39
45	600869	智慧能源	1,472,936.00	6.34
46	002497	雅化集团	1,470,722.00	6.33
47	002203	海亮股份	1,462,390.00	6.29
48	300041	回天新材	1,459,696.15	6.28
49	002600	江粉磁材	1,458,663.99	6.27
50	300303	聚飞光电	1,456,911.00	6.27
51	002234	民和股份	1,456,556.00	6.26
52	600248	延长化建	1,456,096.00	6.26
53	300068	南都电源	1,454,717.00	6.26
54	300048	合康变频	1,454,434.00	6.26
55	002152	广电运通	1,451,660.00	6.24
56	000911	南宁糖业	1,420,231.00	6.11
57	000421	南京公用	1,348,132.00	5.80
58	600835	上海机电	1,334,314.05	5.74
59	000909	数源科技	1,312,842.00	5.65
60	600048	保利地产	1,307,655.00	5.62

61	600552	凯盛科技	1,282,837.48	5.52
62	600568	中珠医疗	1,257,720.00	5.41
63	600885	宏发股份	1,239,582.00	5.33
64	300084	海默科技	1,235,314.81	5.31
65	002378	章源钨业	1,226,661.00	5.28
66	300011	鼎汉技术	1,222,970.00	5.26
67	300054	鼎龙股份	1,213,114.00	5.22
68	002516	旷达科技	1,207,235.00	5.19
69	600057	象屿股份	1,194,523.00	5.14
70	600777	新潮能源	1,194,237.00	5.14
71	002060	粤水电	1,189,283.00	5.12
72	000983	西山煤电	1,189,277.60	5.12
73	600521	华海药业	1,185,297.00	5.10
74	600305	恒顺醋业	1,181,901.00	5.08
75	601628	中国人寿	1,179,829.00	5.07
76	002405	四维图新	1,176,238.50	5.06
77	300027	华谊兄弟	1,171,484.00	5.04
78	002590	万安科技	1,167,295.00	5.02
79	601677	明泰铝业	1,162,558.00	5.00
80	002156	通富微电	1,145,120.00	4.93
81	002589	瑞康医药	1,143,044.00	4.92
82	601857	中国石油	1,135,777.00	4.89
83	002394	联发股份	1,134,269.00	4.88
84	002078	太阳纸业	1,111,302.00	4.78
85	002236	大华股份	1,107,317.00	4.76
86	300133	华策影视	1,102,398.00	4.74
87	002502	骅威文化	1,102,272.58	4.74
88	300219	鸿利智汇	1,093,930.00	4.71
89	601699	潞安环能	1,087,409.80	4.68
90	300168	万达信息	1,077,764.00	4.64
91	002309	中利科技	1,044,051.44	4.49
92	000860	顺鑫农业	1,002,145.78	4.31
93	300389	艾比森	1,000,591.00	4.30
94	300369	绿盟科技	997,545.00	4.29
95	600584	长电科技	994,751.00	4.28
96	600562	国睿科技	983,033.00	4.23

97	300145	中金环境	981,221.00	4.22
98	600382	广东明珠	980,885.00	4.22
99	002247	帝龙文化	976,409.00	4.20
100	000563	陕国投 A	958,001.00	4.12
101	002232	启明信息	950,835.00	4.09
102	000078	海王生物	949,886.00	4.09
103	002244	滨江集团	946,316.00	4.07
104	600029	南方航空	943,129.00	4.06
105	002563	森马服饰	933,863.72	4.02
106	600303	曙光股份	921,581.00	3.96
107	601633	长城汽车	919,168.00	3.95
108	002554	惠博普	911,417.86	3.92
109	600074	保千里	908,122.00	3.91
110	002381	双箭股份	907,742.00	3.90
111	002466	天齐锂业	888,826.00	3.82
112	000567	海德股份	881,754.00	3.79
113	002097	山河智能	840,856.00	3.62
114	300232	洲明科技	832,094.00	3.58
115	002421	达实智能	822,761.00	3.54
116	002372	伟星新材	819,329.00	3.52
117	600206	有研新材	818,193.00	3.52
118	600216	浙江医药	816,421.00	3.51
119	600458	时代新材	811,676.00	3.49
120	002448	中原内配	809,693.00	3.48
121	002182	云海金属	809,634.00	3.48
122	002540	亚太科技	808,879.00	3.48
123	600261	阳光照明	808,628.08	3.48
124	600373	中文传媒	807,703.00	3.47
125	600755	厦门国贸	807,275.00	3.47
126	000030	富奥股份	806,184.22	3.47
127	000050	深天马 A	803,952.00	3.46
128	000813	德展健康	799,806.32	3.44
129	600894	广日股份	798,955.00	3.44
130	002689	远大智能	797,933.00	3.43
131	002477	雏鹰农牧	797,817.00	3.43
132	600612	老凤祥	797,176.00	3.43

133	600287	江苏舜天	795,428.50	3.42
134	002245	澳洋顺昌	795,228.52	3.42
135	600037	歌华有线	793,843.00	3.41
136	002324	普利特	788,319.00	3.39
137	002285	世联行	786,205.00	3.38
138	601928	凤凰传媒	783,354.00	3.37
139	600704	物产中大	782,921.00	3.37
140	600031	三一重工	782,340.00	3.36
141	600300	维维股份	779,012.11	3.35
142	600312	平高电气	778,876.00	3.35
143	600648	外高桥	778,869.41	3.35
144	002496	辉丰股份	777,514.00	3.34
145	300128	锦富新材	775,730.00	3.34
146	600284	浦东建设	775,477.00	3.34
147	600309	万华化学	773,433.00	3.33
148	600279	重庆港九	773,148.00	3.33
149	002042	华孚色纺	772,800.50	3.32
150	002511	中顺洁柔	772,701.00	3.32
151	600033	福建高速	772,186.00	3.32
152	601965	中国汽研	769,158.00	3.31
153	601058	赛轮金宇	768,078.00	3.30
154	002615	哈尔斯	767,426.50	3.30
155	601139	深圳燃气	766,508.44	3.30
156	600716	凤凰股份	765,961.00	3.29
157	002521	齐峰新材	764,811.08	3.29
158	600748	上实发展	762,416.10	3.28
159	600597	光明乳业	762,400.00	3.28
160	600208	新湖中宝	762,372.67	3.28
161	601636	旗滨集团	761,482.00	3.28
162	601515	东风股份	761,062.00	3.27
163	600323	瀚蓝环境	761,029.97	3.27
164	002666	德联集团	760,867.00	3.27
165	601992	金隅股份	760,130.00	3.27
166	000789	万年青	759,751.78	3.27
167	600729	重庆百货	758,532.00	3.26
168	002238	天威视讯	758,393.00	3.26

169	600162	香江控股	757,581.00	3.26
170	002208	合肥城建	756,971.00	3.26
171	002029	七匹狼	756,871.05	3.26
172	603198	迎驾贡酒	756,712.00	3.25
173	603188	亚邦股份	754,067.03	3.24
174	600635	大众公用	753,691.23	3.24
175	002674	兴业科技	753,500.00	3.24
176	000665	湖北广电	753,279.10	3.24
177	600657	信达地产	752,333.00	3.24
178	600185	格力地产	751,860.00	3.23
179	002004	华邦健康	751,018.00	3.23
180	002527	新时达	749,556.00	3.22
181	300079	数码视讯	749,079.62	3.22
182	002249	大洋电机	749,072.00	3.22
183	600405	动力源	748,503.10	3.22
184	002641	永高股份	746,302.00	3.21
185	600563	法拉电子	745,422.00	3.21
186	600126	杭钢股份	739,867.00	3.18
187	002188	巴士在线	732,502.74	3.15
188	002542	中化岩土	731,449.00	3.15
189	600986	科达股份	730,072.00	3.14
190	600183	生益科技	727,325.00	3.13
191	300059	东方财富	725,132.00	3.12
192	002197	证通电子	725,116.00	3.12
193	600289	亿阳信通	724,848.86	3.12
194	300259	新天科技	722,596.00	3.11
195	002626	金达威	720,019.00	3.10
196	300302	同有科技	719,952.00	3.10
197	600736	苏州高新	719,875.00	3.10
198	002414	高德红外	719,767.00	3.10
199	601222	林洋能源	719,071.00	3.09
200	000910	大亚圣象	718,791.60	3.09
201	002367	康力电梯	717,891.00	3.09
202	000541	佛山照明	716,198.00	3.08
203	603699	纽威股份	715,756.00	3.08
204	600335	国机汽车	714,856.60	3.07

205	300252	金信诺	713,791.00	3.07
206	600819	耀皮玻璃	713,739.00	3.07
207	600180	瑞茂通	713,211.00	3.07
208	603008	喜临门	712,650.15	3.07
209	002375	亚厦股份	711,804.00	3.06
210	600073	上海梅林	711,798.00	3.06
211	600006	东风汽车	711,434.52	3.06
212	002426	胜利精密	711,367.00	3.06
213	000810	创维数字	710,835.00	3.06
214	300221	银禧科技	709,920.00	3.05
215	002252	上海莱士	709,304.40	3.05
216	600388	龙净环保	709,135.00	3.05
217	000861	海印股份	708,575.00	3.05
218	601777	力帆股份	708,495.00	3.05
219	002385	大北农	708,384.00	3.05
220	300015	爱尔眼科	708,058.00	3.05
221	600055	万东医疗	707,703.00	3.04
222	002653	海思科	707,253.84	3.04
223	600572	康恩贝	707,130.00	3.04
224	600195	中牧股份	706,015.00	3.04
225	002031	巨轮智能	705,809.00	3.04
226	601369	陕鼓动力	705,659.00	3.04
227	600965	福成股份	705,562.98	3.03
228	000973	佛塑科技	704,838.00	3.03
229	002276	万马股份	704,335.00	3.03
230	002292	奥飞娱乐	704,299.00	3.03
231	600372	中航电子	703,924.00	3.03
232	600317	营口港	703,812.00	3.03
233	300187	永清环保	703,691.28	3.03
234	600580	卧龙电气	703,310.00	3.03
235	002010	传化智联	702,806.00	3.02
236	002036	联创电子	702,203.00	3.02
237	600400	红豆股份	701,759.00	3.02
238	002665	首航节能	701,683.00	3.02
239	600776	东方通信	701,666.00	3.02
240	600594	益佰制药	701,082.00	3.02

241	600845	宝信软件	700,177.00	3.01
242	600587	新华医疗	699,638.00	3.01
243	600270	外运发展	699,403.00	3.01
244	002550	千红制药	699,232.00	3.01
245	601158	重庆水务	699,170.00	3.01
246	600496	精工钢构	698,296.00	3.00
247	600680	上海普天	697,851.00	3.00
248	002250	联化科技	697,587.00	3.00
249	002241	歌尔股份	697,500.00	3.00
250	600337	美克家居	696,262.00	2.99
251	601588	北辰实业	694,770.00	2.99
252	600557	康缘药业	693,884.00	2.98
253	600409	三友化工	693,724.00	2.98
254	600867	通化东宝	693,030.60	2.98
255	000401	冀东水泥	692,117.00	2.98
256	002221	东华能源	691,847.00	2.98
257	002572	索菲亚	690,480.00	2.97
258	300501	海顺新材	689,097.00	2.96
259	002116	中国海诚	689,055.00	2.96
260	300296	利亚德	686,633.00	2.95
261	600547	山东黄金	685,559.56	2.95
262	600007	中国国贸	666,623.00	2.87
263	600343	航天动力	659,228.66	2.84
264	002286	保龄宝	649,599.00	2.79
265	601799	星宇股份	633,768.00	2.73
266	601069	西部黄金	624,885.20	2.69
267	000750	国海证券	617,104.00	2.65
268	600386	北巴传媒	614,099.30	2.64
269	000554	泰山石油	612,407.00	2.63
270	002583	海能达	612,095.00	2.63
271	600170	上海建工	610,515.00	2.63
272	600730	中国高科	606,522.00	2.61
273	000903	云内动力	603,370.00	2.60
274	300251	光线传媒	602,674.00	2.59
275	300449	汉邦高科	597,051.00	2.57
276	300230	永利股份	588,729.00	2.53

277	000957	中通客车	587,852.00	2.53
278	002108	沧州明珠	586,675.92	2.52
279	002508	老板电器	585,391.00	2.52
280	300014	亿纬锂能	579,703.00	2.49
281	300381	溢多利	577,078.80	2.48
282	002177	御银股份	574,659.00	2.47
283	000599	青岛双星	568,281.00	2.44
284	600651	飞乐音响	564,111.46	2.43
285	600518	康美药业	556,514.00	2.39
286	002131	利欧股份	552,943.00	2.38
287	600028	中国石化	550,000.00	2.37
288	600820	隧道股份	538,653.00	2.32
289	600787	中储股份	536,472.00	2.31
290	300241	瑞丰光电	516,041.00	2.22
291	002597	金禾实业	515,700.83	2.22
292	300231	银信科技	515,592.00	2.22
293	002230	科大讯飞	514,114.00	2.21
294	600688	上海石化	512,825.00	2.21
295	600054	黄山旅游	512,096.00	2.20
296	002313	日海通讯	510,565.00	2.20
297	002299	圣农发展	506,082.00	2.18
298	600581	*ST 八钢	504,143.62	2.17
299	600662	强生控股	503,467.00	2.17
300	600362	江西铜业	502,834.00	2.16
301	000732	泰禾集团	499,085.00	2.15
302	000028	国药一致	497,635.00	2.14
303	000333	美的集团	495,979.00	2.13
304	300255	常山药业	495,038.00	2.13
305	002053	云南能投	492,995.00	2.12
306	300033	同花顺	483,991.00	2.08
307	300197	铁汉生态	483,771.75	2.08
308	600491	龙元建设	482,424.00	2.07
309	002699	美盛文化	466,767.00	2.01
310	300507	苏奥传感	465,977.00	2.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600499	科达洁能	9,796,395.59	42.14
2	601998	中信银行	9,278,001.39	39.91
3	600050	中国联通	8,147,980.00	35.05
4	600036	招商银行	8,093,140.14	34.81
5	600666	奥瑞德	6,818,503.38	29.33
6	002358	森源电气	6,326,368.00	27.21
7	600519	贵州茅台	5,872,970.33	25.26
8	002475	立讯精密	5,054,610.60	21.74
9	300207	欣旺达	4,855,782.51	20.89
10	300203	聚光科技	4,796,892.09	20.63
11	002458	益生股份	4,763,595.62	20.49
12	002041	登海种业	4,733,057.80	20.36
13	002488	金固股份	4,648,410.91	19.99
14	002217	合力泰	4,570,703.01	19.66
15	000509	华塑控股	4,549,191.80	19.57
16	000400	许继电气	4,507,314.39	19.39
17	600745	中茵股份	4,116,178.42	17.70
18	600004	白云机场	3,943,189.00	16.96
19	600517	置信电气	3,812,929.73	16.40
20	603808	歌力思	3,246,380.20	13.96
21	002434	万里扬	3,228,419.80	13.89
22	603010	万盛股份	2,623,791.19	11.29
23	300031	宝通科技	2,472,073.01	10.63
24	002655	共达电声	2,373,250.87	10.21
25	601028	玉龙股份	2,344,375.38	10.08
26	002284	亚太股份	2,263,435.77	9.74
27	300073	当升科技	2,215,894.10	9.53
28	600529	山东药玻	2,099,830.20	9.03
29	300261	雅本化学	2,078,962.80	8.94
30	002454	松芝股份	1,885,005.90	8.11
31	002439	启明星辰	1,812,273.00	7.79
32	000807	云铝股份	1,697,873.14	7.30
33	000060	中金岭南	1,688,966.60	7.26
34	300068	南都电源	1,675,286.12	7.21
35	600699	均胜电子	1,650,421.11	7.10

36	300032	金龙机电	1,629,787.15	7.01
37	600348	阳泉煤业	1,543,950.11	6.64
38	002138	顺络电子	1,542,868.97	6.64
39	300113	顺网科技	1,536,891.92	6.61
40	300347	泰格医药	1,528,119.77	6.57
41	002311	海大集团	1,520,912.26	6.54
42	601628	中国人寿	1,491,040.96	6.41
43	300145	中金环境	1,468,212.04	6.31
44	000911	南宁糖业	1,420,756.23	6.11
45	002467	二六三	1,387,550.00	5.97
46	002381	双箭股份	1,374,513.46	5.91
47	600568	中珠医疗	1,364,686.00	5.87
48	600777	新潮能源	1,296,792.63	5.58
49	000909	数源科技	1,291,270.92	5.55
50	300084	海默科技	1,287,943.03	5.54
51	600048	保利地产	1,279,644.38	5.50
52	600885	宏发股份	1,245,470.00	5.36
53	300168	万达信息	1,241,239.32	5.34
54	000983	西山煤电	1,213,865.46	5.22
55	300011	鼎汉技术	1,208,705.15	5.20
56	002313	日海通讯	1,208,499.43	5.20
57	600552	凯盛科技	1,197,157.91	5.15
58	600521	华海药业	1,186,323.18	5.10
59	002378	章源钨业	1,183,999.40	5.09
60	600057	象屿股份	1,178,094.02	5.07
61	601199	江南水务	1,162,161.97	5.00
62	002590	万安科技	1,155,643.43	4.97
63	601857	中国石油	1,144,624.45	4.92
64	002078	太阳纸业	1,143,060.67	4.92
65	300027	华谊兄弟	1,132,344.34	4.87
66	002589	瑞康医药	1,118,640.86	4.81
67	002405	四维图新	1,110,593.04	4.78
68	601699	潞安环能	1,104,894.46	4.75
69	300133	华策影视	1,098,308.10	4.72
70	002245	澳洋顺昌	1,097,693.08	4.72
71	300219	鸿利智汇	1,084,089.57	4.66
72	600584	长电科技	1,078,662.03	4.64
73	002236	大华股份	1,057,183.12	4.55

74	300389	艾比森	1,055,753.66	4.54
75	002502	骅威文化	1,043,214.56	4.49
76	000860	顺鑫农业	1,022,375.91	4.40
77	300054	鼎龙股份	995,555.69	4.28
78	002554	惠博普	995,410.00	4.28
79	600382	广东明珠	993,885.00	4.27
80	002247	帝龙文化	975,287.86	4.19
81	600236	桂冠电力	973,224.00	4.19
82	300369	绿盟科技	950,078.37	4.09
83	002001	新和成	917,379.06	3.95
84	300232	洲明科技	906,285.50	3.90
85	002214	大立科技	905,620.75	3.90
86	601633	长城汽车	896,734.00	3.86
87	002466	天齐锂业	896,530.00	3.86
88	000750	国海证券	895,838.84	3.85
89	600074	保千里	894,729.00	3.85
90	000563	陕国投 A	877,851.73	3.78
91	600029	南方航空	871,618.88	3.75
92	600306	*ST 商城	861,112.67	3.70
93	600819	耀皮玻璃	851,402.00	3.66
94	000567	海德股份	848,540.11	3.65
95	600031	三一重工	804,241.47	3.46
96	002097	山河智能	795,649.55	3.42
97	600409	三友化工	775,585.00	3.34
98	600563	法拉电子	761,395.06	3.27
99	002250	联化科技	746,546.00	3.21
100	000050	深天马 A	744,661.00	3.20
101	300296	利亚德	741,094.23	3.19
102	300059	东方财富	737,430.42	3.17
103	600400	红豆股份	736,866.00	3.17
104	300501	海顺新材	734,298.75	3.16
105	600337	美克家居	731,565.00	3.15
106	300252	金信诺	724,651.00	3.12
107	600572	康恩贝	724,436.00	3.12
108	600965	福成股份	724,242.32	3.12
109	600594	益佰制药	722,960.00	3.11
110	002036	联创电子	721,564.66	3.10
111	601158	重庆水务	720,162.00	3.10

112	000910	大亚圣象	716,077.44	3.08
113	002542	中化岩土	714,784.00	3.07
114	600195	中牧股份	711,280.00	3.06
115	002572	索菲亚	711,102.00	3.06
116	002600	江粉磁材	710,685.00	3.06
117	002385	大北农	710,268.00	3.05
118	300303	聚飞光电	709,313.00	3.05
119	300041	回天新材	708,365.00	3.05
120	002497	雅化集团	707,910.00	3.04
121	000903	云内动力	707,236.00	3.04
122	002252	上海莱士	707,203.00	3.04
123	300187	永清环保	703,537.00	3.03
124	002188	巴士在线	703,059.00	3.02
125	600073	上海梅林	702,940.98	3.02
126	600248	延长化建	701,750.29	3.02
127	002234	民和股份	701,433.00	3.02
128	600372	中航电子	700,537.00	3.01
129	600496	精工钢构	700,291.80	3.01
130	601588	北辰实业	698,220.00	3.00
131	000401	冀东水泥	698,141.00	3.00
132	600867	通化东宝	696,402.00	3.00
133	300048	合康变频	696,004.00	2.99
134	002665	首航节能	694,411.60	2.99
135	600587	新华医疗	694,246.98	2.99
136	600386	北巴传媒	694,101.64	2.99
137	002152	广电运通	693,917.00	2.98
138	600845	宝信软件	693,561.00	2.98
139	600557	康缘药业	693,457.00	2.98
140	300160	秀强股份	691,966.57	2.98
141	600736	苏州高新	691,964.00	2.98
142	002221	东华能源	690,464.00	2.97
143	600270	外运发展	689,721.00	2.97
144	600986	科达股份	689,503.00	2.97
145	002010	传化智联	687,939.00	2.96
146	600547	山东黄金	687,795.00	2.96
147	300251	光线传媒	685,063.10	2.95
148	600869	智慧能源	683,928.00	2.94
149	601369	陕鼓动力	683,815.65	2.94

150	000861	海印股份	683,200.00	2.94
151	002550	千红制药	682,773.00	2.94
152	000541	佛山照明	680,175.00	2.93
153	600317	营口港	680,088.00	2.93
154	000002	万科 A	679,870.27	2.92
155	002203	海亮股份	679,808.00	2.92
156	002367	康力电梯	679,534.00	2.92
157	600491	龙元建设	679,438.26	2.92
158	300128	锦富新材	679,044.00	2.92
159	600335	国机汽车	678,791.28	2.92
160	600388	龙净环保	678,371.00	2.92
161	002653	海思科	678,190.48	2.92
162	601222	林洋能源	676,324.00	2.91
163	002116	中国海诚	675,874.00	2.91
164	601777	力帆股份	675,409.00	2.91
165	600006	东风汽车	670,600.00	2.88
166	002031	巨轮智能	667,876.00	2.87
167	002108	沧州明珠	667,804.94	2.87
168	603699	纽威股份	667,658.00	2.87
169	002626	金达威	666,903.00	2.87
170	002241	歌尔股份	666,894.95	2.87
171	600776	东方通信	664,780.00	2.86
172	000973	佛塑科技	664,756.00	2.86
173	603008	喜临门	663,166.00	2.85
174	600183	生益科技	662,949.00	2.85
175	600580	卧龙电气	661,848.00	2.85
176	600180	瑞茂通	661,107.00	2.84
177	300221	银禧科技	660,640.00	2.84
178	600055	万东医疗	659,645.00	2.84
179	002375	亚厦股份	659,639.19	2.84
180	600289	亿阳信通	654,008.00	2.81
181	002197	证通电子	653,755.51	2.81
182	600007	中国国贸	653,445.00	2.81
183	300015	爱尔眼科	652,960.00	2.81
184	300259	新天科技	650,549.00	2.80
185	002202	金风科技	636,550.00	2.74
186	000810	创维数字	634,649.00	2.73
187	000421	南京公用	633,715.00	2.73

188	002276	万马股份	632,802.00	2.72
189	002426	胜利精密	629,733.00	2.71
190	300449	汉邦高科	627,414.00	2.70
191	600680	上海普天	625,847.72	2.69
192	002414	高德红外	623,964.07	2.68
193	600170	上海建工	623,254.00	2.68
194	300230	永利股份	621,087.32	2.67
195	002292	奥飞娱乐	618,616.00	2.66
196	002508	老板电器	609,018.00	2.62
197	002286	保龄宝	601,631.01	2.59
198	300302	同有科技	601,100.43	2.59
199	002449	国星光电	595,063.06	2.56
200	000554	泰山石油	589,883.97	2.54
201	002583	海能达	588,351.52	2.53
202	600343	航天动力	586,207.85	2.52
203	601069	西部黄金	585,554.00	2.52
204	600835	上海机电	582,807.56	2.51
205	300197	铁汉生态	577,913.88	2.49
206	002597	金禾实业	576,992.24	2.48
207	300014	亿纬锂能	569,123.50	2.45
208	300146	汤臣倍健	567,495.36	2.44
209	600820	隧道股份	563,400.00	2.42
210	600651	飞乐音响	561,362.57	2.41
211	002177	御银股份	559,584.00	2.41
212	300381	溢多利	556,054.30	2.39
213	600730	中国高科	552,463.00	2.38
214	600518	康美药业	551,552.00	2.37
215	601799	星宇股份	550,038.00	2.37
216	600028	中国石化	550,000.00	2.37
217	300241	瑞丰光电	541,869.84	2.33
218	600054	黄山旅游	525,212.00	2.26
219	600662	强生控股	525,002.00	2.26
220	000028	国药一致	510,681.57	2.20
221	002299	圣农发展	508,036.00	2.19
222	000333	美的集团	503,947.00	2.17
223	002230	科大讯飞	502,248.00	2.16
224	300231	银信科技	501,462.39	2.16
225	002402	和而泰	499,250.30	2.15

226	000639	西王食品	497,078.16	2.14
227	000957	中通客车	496,801.00	2.14
228	300255	常山药业	496,490.71	2.14
229	600688	上海石化	496,212.30	2.13
230	603066	音飞储存	486,180.36	2.09
231	000732	泰禾集团	480,840.52	2.07
232	002053	云南能投	478,329.90	2.06
233	002131	利欧股份	475,698.82	2.05
234	300507	苏奥传感	475,593.84	2.05
235	600787	中储股份	471,575.81	2.03
236	002407	多氟多	468,981.38	2.02
237	603989	艾华集团	468,518.00	2.02
238	600362	江西铜业	467,040.45	2.01

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

#### 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	413,363,051.20
卖出股票收入（成交）总额	348,934,838.95

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,800,000.00	5.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	18,730,600.00	16.88
5	企业短期融资券	5,023,000.00	4.53
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,553,600.00	26.64

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019533	16 国债 05	58,000	5,800,000.00	5.23
2	041667004	16 信威通信 CP001	50,000	5,023,000.00	4.53
3	112094	11 中利债	50,000	5,015,000.00	4.52
4	122186	12 力帆 02	48,000	4,876,800.00	4.40
5	122212	12 京江河	48,000	4,816,800.00	4.34

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

本基金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	60,258.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	544,215.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	604,474.00

### 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
2,416	44,590.98	93,895,774.65	87.16%	13,836,030.55	12.84%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

### 9.4 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

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（2010年6月29日）基金份额总额	434,036,741.03
本报告期期初基金份额总额	13,312,599.95
本报告期基金总申购份额	4,355,001,068.68
减：本报告期基金总赎回份额	4,260,581,863.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	107,731,805.20

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 2012 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 50000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 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	2	226,640,390.49	29.73%	211,070.01	30.10%	-
海通证券	1	165,336,986.29	21.69%	150,741.50	21.50%	-
方正证券	1	104,835,148.79	13.75%	95,535.98	13.62%	-
长江证券	1	80,512,645.82	10.56%	73,371.25	10.46%	-
国金证券	1	74,668,195.41	9.80%	69,538.68	9.92%	-
中信建投	1	66,232,928.31	8.69%	60,358.19	8.61%	-
兴业证券	1	23,454,385.54	3.08%	21,374.04	3.05%	-
国信证券	1	14,672,779.27	1.92%	13,664.72	1.95%	-
申银万国	1	5,944,430.23	0.78%	5,536.09	0.79%	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	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

本基金本报告期新增东方财富证券交易单元，退租广发证券和海通证券的 2 个交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	24,698,400.96	100.00%	23,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

东吴基金管理有限公司  
2017 年 3 月 27 日