

东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告 摘要

2017 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：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年三月三十一日

§ 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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 2017 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	东吴移动互联	
基金主代码	001323	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	231,768,714.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C
下属分级基金的交易代码：	001323	002170
报告期末下属分级基金的份额总额	231,767,715.75 份	999.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于移动互联主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	中证移动互联网指数 × 50% + 中债综合指数 × 50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	方琦
	联系电话	021-50509888-8308	0755-22168168
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95511 转 3
传真		021-50509888-8211	0755-82080387

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	2017 年	2016 年	2015 年 5 月 27 日(基金合
-------	--------	--------	---------------------

期间数据 和指标					同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	东吴移动互联混 合 A	东吴移动 互联混合 C	东吴移动互联混 合 A	东吴移 动互联 混合 C	东吴移动互联混 合 A	东吴移 动互联 混合 C
本期已 实现收 益	35,662,336.79	127.21	-12,695,309.48	6.68	1,369,684.67	-
本期利 润	36,482,473.63	112.82	-13,963,132.44	-23.89	-2,524,282.24	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.1329	0.1129	-0.0231	-0.0239	-0.0016	0.0000
本期基 金份额 净值增 长率	11.93%	11.57%	-2.97%	-2.59%	1.10%	0.00%
3.1.2 期末数 据和指 标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0976	0.0900	-0.0195	-0.0229	-0.0024	-
期末基 金资产 净值	254,390,771.55	1,088.93	334,491,841.78	976.11	940,290,472.30	-
期末基 金份额 净值	1.098	1.090	0.981	0.977	1.011	-

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

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

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

4、本基金于 2015 年 5 月 27 日成立。于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

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

东吴移动互联混合 A

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	-2.14%	0.75%	-1.58%	0.68%	-0.56%	0.07%
过去六个月	0.00%	0.69%	1.54%	0.59%	-1.54%	0.10%
过去一年	11.93%	0.66%	0.31%	0.53%	11.62%	0.13%
自基金合同生效起至今	9.80%	0.51%	-26.42%	1.15%	36.22%	-0.64%

东吴移动互联混合 C

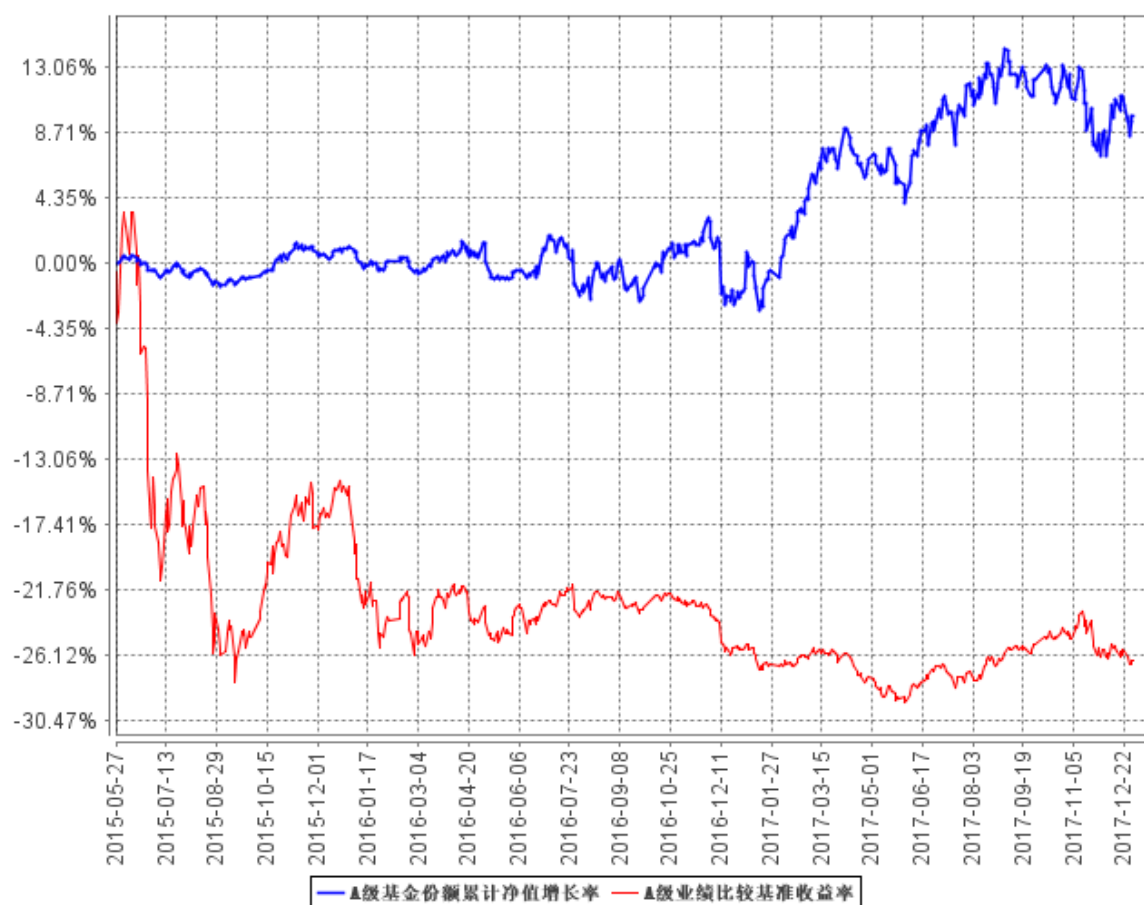
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-2.24%	0.76%	-1.58%	0.68%	-0.66%	0.08%
过去六个月	-0.27%	0.70%	1.54%	0.59%	-1.81%	0.11%
过去一年	11.57%	0.66%	0.31%	0.53%	11.26%	0.13%
自基金合同生效起至今	8.67%	0.57%	-16.16%	0.80%	24.83%	-0.23%

注：1、比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%

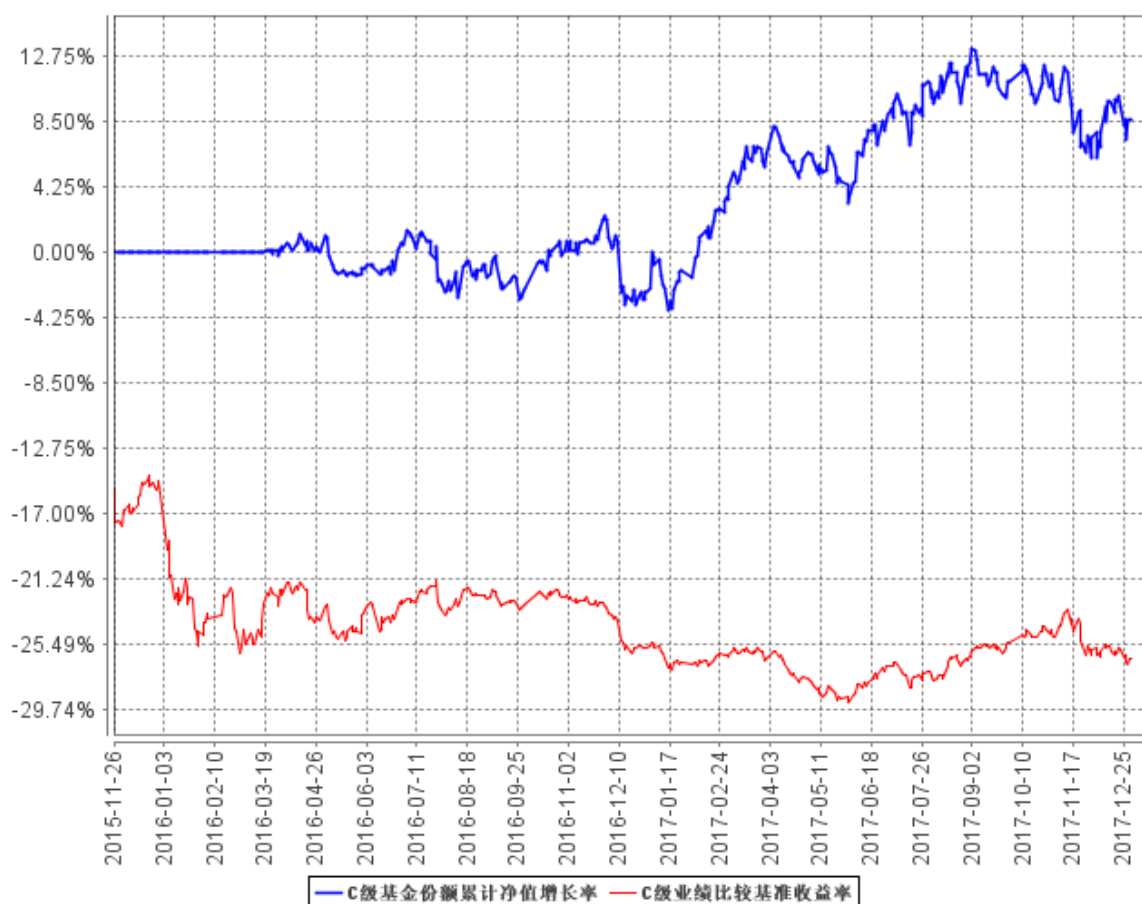
2、本基金于 2015 年 11 月 26 日开始分为 A、C 两类。

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

A级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



C级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

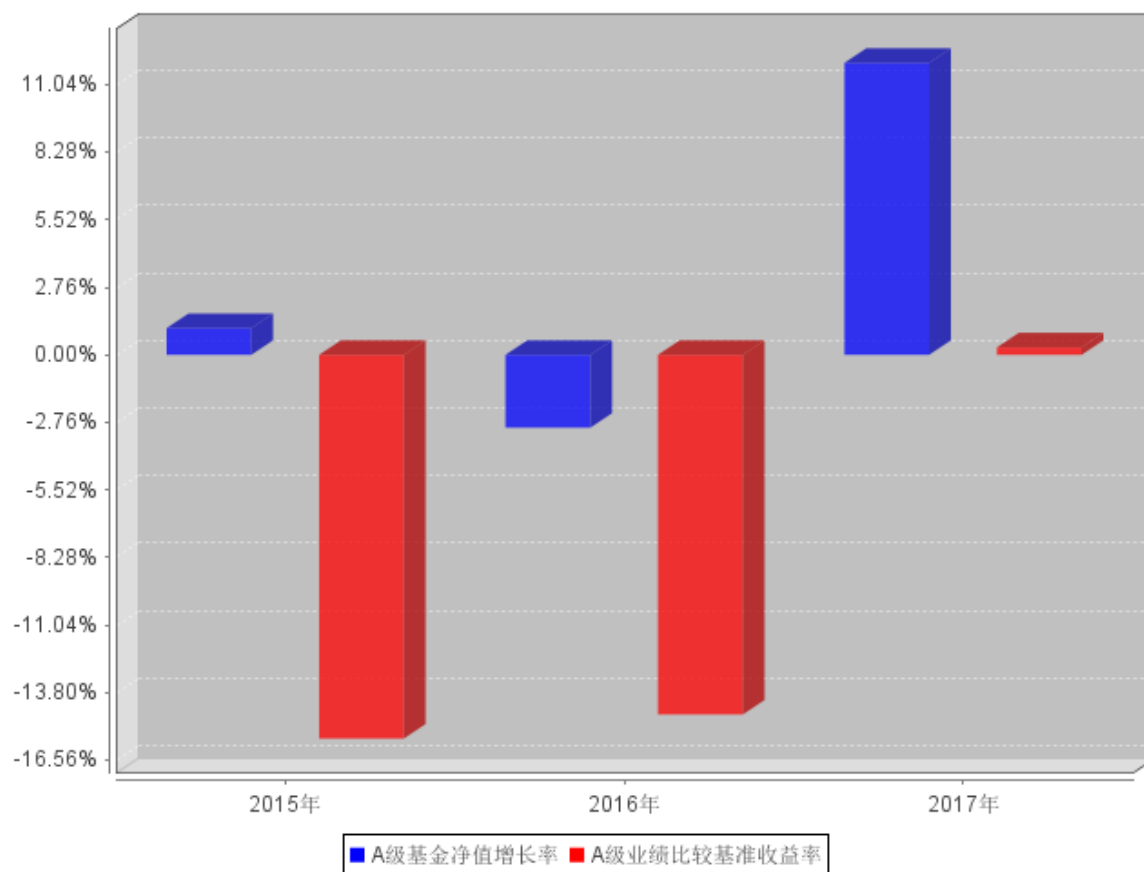


注：1、比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%

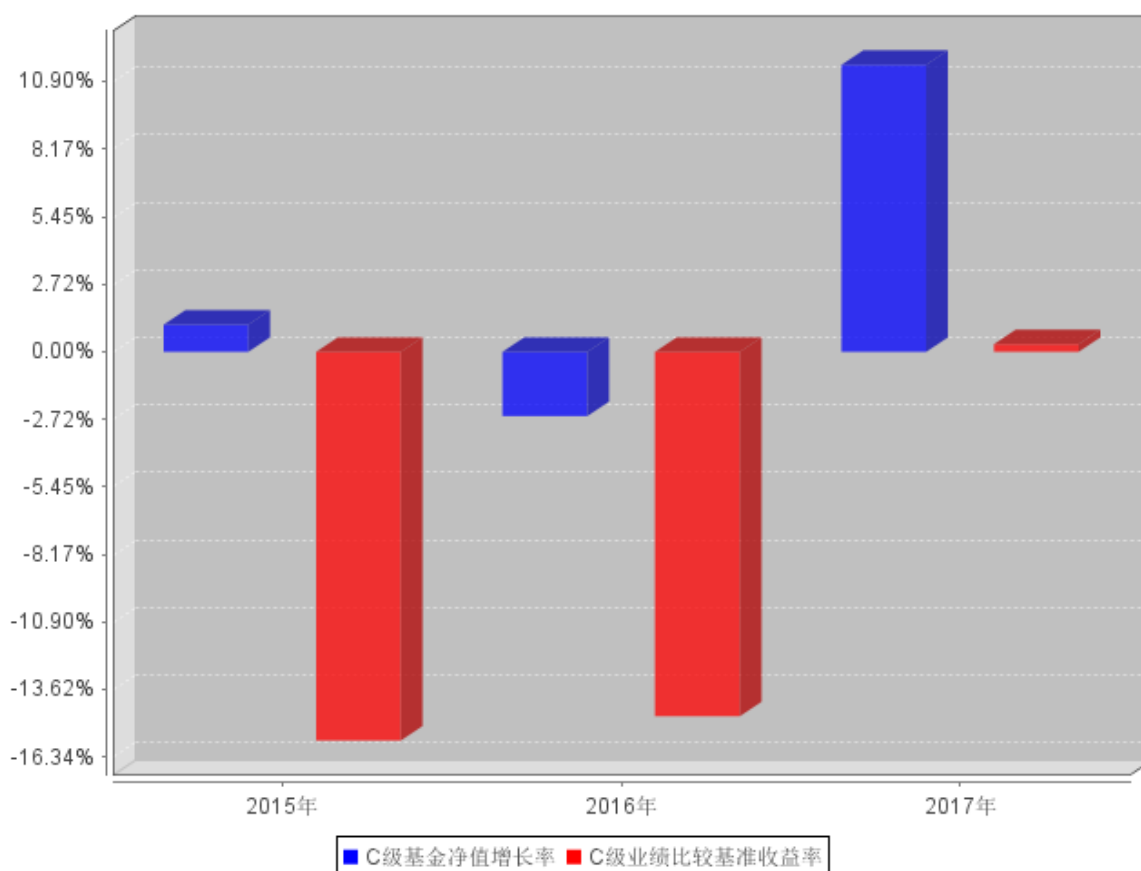
2、本基金于2015年11月26日分为A、C两类，具体内容详见本基金管理人于2015年11月24日刊登的《关于东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》。

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

A级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



C级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、本基金于 2015 年 5 月 27 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。

2、经中国证监会批准，本基金于 2015 年 11 月 26 日分为 A、C 两类。

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 日获证监基字[2004]32 号开业批文，并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币，公司所在地为上海市浦东新区源深路 279 号，统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和海澜集团有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理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、共享共赢”的东吴文化，追求为投资者奉献

可持续的长期回报。近年来，在泛资管大背景下，公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展，尤其在“战略性人才梯队建设、市场化体制机制改革”的经营策略指导下，公司各项业务快速发展，进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司管理的资产规模合计 752.89 亿元，其中，公募基金管理规模 266.41 亿元，专户资产管理规模 256.09 亿元，子公司专项资产管理规模 230.39 亿元；管理各类产品 156 只，其中，公募基金 27 只，专户产品 60 只，子公司资产计划 69 只，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。2017 年公司绝对收益策略基金，通过灵活调整，在上半年市场震荡中，规避了市场大幅回调的风险，业绩排名持续位列同类基金前列。2017 年，公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示，截至 2017 年年底，公司旗下的固定收益类基金以 8.29% 的净值增长率，位列最近两年 83 家入选基金公司的第二位。

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		
刘元海	绝对收益部总经理、本基金基金经理	2016 年 4 月 27 日	-	12 年	博士，同济大学毕业。2004 年 2 月至 2015 年 6 月就职于东吴基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理等职务，2016 年 2 月再次加入我司，现任绝对收益部总经理，其中自 2016 年 4 月 27 日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 9

					日起担任东吴优信稳健债券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------------

注：1、戴斌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、基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上证指数以 3103 点开盘，3307 点收盘，涨幅 6.56%，整体呈现窄幅震荡上行趋势。虽然 2017 年上证指数整体振幅空间有限，但是市场结构分化明显，以白马蓝筹股为代表的上证 50、沪深 300 指数分别上涨 25.08%、21.78%，中小板指数也上涨 16.73%，而以新兴产业为代表的高估值创业板指数却下跌 10.67%。2017 年 A 股市场形成冰火两重天的景象，80%多股票下跌，只有 20%不到的股票是上涨的。

2017 年 1 季度，本基金保持较高仓位并以涨价行业配置为主，如白酒、覆铜板产业链等，同时配置估值相对较低的真成长股，如苹果产业链中的白马股。1 季度，本基金把握住春季躁动行情投资机会，获得较好收益。在 4 月上旬考虑金融监管风险本基金逐步降低仓位，因此净值躲过了 4 月中下旬市场下跌的负面影响。5 月中下旬开始逐步提高仓位，加仓方向是传媒、新能源汽车、环保、保险等。上半年本基金基本把握住市场节奏，基金净值也创出新高。下半年，本基金行业配置上相对均衡，主要集中在业绩增长确定、估值安全边际相对较高的行业，如：传媒、白酒、先进制造、航空、新零售、医药、金融、环保等方向，但错失了电子、家电、新能源汽车等投资机会，下半年基金净值表现相对一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东吴移动互联 A 份额净值为 1.098 元，累计净值 1.098 元；本报告期份额净值增长率 11.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.31%；东吴东吴移动互联 C 份额净值为 1.090 元，累计净值 1.090 元；本报告期份额净值增长率 11.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年在金融去杠杆和稳健货币政策保持中性背景下，A 股市场仍然将是结构性行情，结构性热点将以业绩增长确定、估值相对合理的行业和个股为主导。2018 年，业绩增长稳定的消费股如食品饮料、医药等仍有投资机会，但 2018 年似乎要适当考虑择时因素，当这些行业估值修复到一定水平时，2018 年这些行业可能不会再像 2017 年那样走出单边上涨行情，震荡调整概率更大。随着供给侧结构性改革深入，许多行业集中度将会继续提升，具有核心竞争力行业龙头股投资机会仍然值得我们重视。

我们判断，未来供给侧结构性改革将从近两年旧经济做减法转向新经济做加法，即补短板，培育经济新增长点，并且近期媒体不断吹风鼓励新技术新业态等新产业中独角兽公司在 A 股上市。我们判断，2018 年新兴产业中优质成长股投资机会更大，相对看好战略性新兴产业（节能环保、新能源、新一代信息技术、半导体、人工智能等）、高端装备制造（风电、先进制造）、现代服务

业（文化传媒、医疗健康、航空）。

在金融去杠杆和货币收紧背景下，居民在去杠杆、政府在去杠杆，而且从目前态势看银监会去杠杆力度是很大的，信托贷款限制、委托贷款限制、消费贷清查等等，这些融资渠道限制对房地产销售和基建将会产生比较大负面影响，2018 年对周期型行业和房地产产业链相对谨慎。

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）紧跟流动性要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求持续关注流动性新规执行情况，从制度建设、系统控制、指标监测、部门间协作等方面，不断优化流动性管理工作流程，建立健全本基金管理人流动性风险管理内部控制体系。

（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）跟踪监管动态，及时落实新规。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求进行内部讨论，成立工作小组，制订落实方案。及时开展内部培训，修改相关制度与流程，升级业务系统并设置风控阈值，保障基金投资符合监管要求。

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，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

2017 年，基金托管人在东吴移动互联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

2017 年，东吴基金管理有限公司在东吴移动互联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

2017 年，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移动互联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

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了安永华明(2018)审字第 60469066_B18 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：东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	57,273,293.47	62,444,389.09
结算备付金	2,478,856.37	1,561,877.08
存出保证金	637,920.97	808,432.95
交易性金融资产	201,365,386.90	268,900,642.90
其中：股票投资	201,365,386.90	249,057,642.90
基金投资	-	-
债券投资	-	19,843,000.00
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	-	3,286,995.66
应收利息	15,030.43	332,483.34

应收股利	-	-
应收申购款	1,694.48	988.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	261,772,182.62	337,335,809.16
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,376,850.47	873,445.55
应付赎回款	340,281.09	410,535.96
应付管理人报酬	326,994.61	443,023.08
应付托管费	54,499.11	73,837.22
应付销售服务费	0.31	0.31
应付交易费用	1,221,696.55	861,377.48
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	60,000.00	180,771.67
负债合计	7,380,322.14	2,842,991.27
所有者权益：		
实收基金	231,768,714.75	341,134,743.35
未分配利润	22,623,145.73	-6,641,925.46
所有者权益合计	254,391,860.48	334,492,817.89
负债和所有者权益总计	261,772,182.62	337,335,809.16

注：本基金为分级基金，报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.098 元，份额总额为 231,768,714.75 份，其中东吴移动互联混合 A 基金份额净值 1.098 元，基金份额总额 231,767,715.75 份；东吴移动互联混合 C 基金份额净值 1.090 元，基金份额总额 999.00 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	48,727,920.82	1,845,408.32
1.利息收入	1,069,663.90	6,954,894.99
其中：存款利息收入	880,711.01	4,721,901.62
债券利息收入	127,071.50	29,824.41
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	61,881.39	2,203,168.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	46,750,982.21	-4,385,952.33
其中：股票投资收益	45,597,143.62	-5,365,440.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	33,638.74	133,045.03
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	1,120,199.85	846,443.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	820,122.45	-1,267,853.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	87,152.26	544,319.19
减：二、费用	12,245,334.37	15,808,564.65
1．管理人报酬	4,446,428.89	9,124,973.30
2．托管费	741,071.52	1,520,828.91
3．销售服务费	3.65	2.88
4．交易费用	6,860,930.31	4,946,759.56
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	196,900.00	216,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	36,482,586.45	-13,963,156.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	36,482,586.45	-13,963,156.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	341,134,743.35	-6,641,925.46	334,492,817.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,482,586.45	36,482,586.45
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）	-109,366,028.60	-7,217,515.26	-116,583,543.86
其中：1. 基金申购款	71,999,348.83	6,119,485.07	78,118,833.90
2. 基金赎回款	-181,365,377.43	-13,337,000.33	-194,702,377.76
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）	231,768,714.75	22,623,145.73	254,391,860.48
项目	上年度可比期间 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）	929,889,791.86	10,400,680.44	940,290,472.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,963,156.33	-13,963,156.33
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）	-588,755,048.51	-3,079,449.57	-591,834,498.08
其中：1. 基金申购款	1,719,057.22	-2,251.29	1,716,805.93
2. 基金赎回款	-590,474,105.73	-3,077,198.28	-593,551,304.01
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）	341,134,743.35	-6,641,925.46	334,492,817.89
-----------------	----------------	---------------	----------------

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：

_____ 王炯	_____ 吕晖	_____ 吴婷
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴移动互联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]795 号文《关于准予东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2015 年 5 月 27 日正式生效,首次设立募集规模为 2,403,079,202.08 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金业绩比较基准=中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财

务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允

价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

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,且该种法定权利现在是可执行的,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所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)股指期货/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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及销售服务等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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则按直线法计算。

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) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份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。

7.4.5 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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国平安银行股份有限公司	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
海澜集团有限公司	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：根据 2017 年 12 月 30 日《东吴基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》，经东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证监会证监许可[2017]1664 号文批复同意，本公司原股东上海兰生（集团）有限公司将其持有的本公司 30% 股权转让给海澜集团有限公司。截止财务报表批准日，该股权转让尚未完成工商变更登记。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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	1,229,470,224.52	27.25%	2,178,713,500.51	65.14%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	4,898,825.21	45.57%	30,212,587.15	96.35%

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	-	6,369,600,000.00	64.93%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	1,127,290.62	27.13%	334,831.20	27.41%
关联方名称	上年度可比期间 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	2,005,258.69	65.12%	631,962.07	73.41%

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

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	4,446,428.89	9,124,973.30
其中：支付销售机构的客 户维护费	1,511,343.79	3,605,598.12

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

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	741,071.52	1,520,828.91

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	3.65	3.65
合计	-	3.65	3.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	2.88	2.88
合计	-	2.88	2.88

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。本基金 C 类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

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

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
中国平安银行股份有限公司	57,273,293.47	837,075.06	62,444,389.09	1,454,185.11

注：除上表列式的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年度获得的利息收入为人民币 30,275.98 元（2016 年度：人民币 100,528.45 元），2017 年末结算备付金余额为人民币 2,478,856.37 元（2016 年末：人民币 1,561,877.08 元）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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（2017 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

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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

		日	5 日							
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

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
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 201,216,878.70 元，属于第二层次的余额为人民币 148,508.20 元，无属于第三层次的余额。（于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 248,615,112.15 元，属于第二层次的余额为人

民币 20,285,530.75 元，无属于第三层次的余额。)

7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上年度末均未以第三层次公允价值计量。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 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	201,365,386.90	76.92
	其中：股票	201,365,386.90	76.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	59,752,149.84	22.83
8	其他各项资产	654,645.88	0.25
9	合计	261,772,182.62	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,737,723.99	34.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,589,000.00	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	14,786,942.76	5.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,416,892.55	6.06
J	金融业	16,510,000.00	6.49
K	房地产业	3,619,200.00	1.42
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	32,323.20	0.01

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	55,657,161.20	21.88
S	综合	-	-
	合计	201,365,386.90	79.16

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002343	慈文传媒	680,000	24,214,800.00	9.52
2	300336	新文化	1,912,860	21,844,861.20	8.59
3	600643	爱建集团	1,300,000	14,404,000.00	5.66
4	300054	鼎龙股份	809,934	9,241,346.94	3.63
5	600172	黄河旋风	1,000,000	8,770,000.00	3.45
6	000823	超声电子	550,000	7,452,500.00	2.93
7	603589	口子窖	160,000	7,368,000.00	2.90
8	300059	东方财富	550,000	7,122,500.00	2.80
9	600029	南方航空	550,000	6,556,000.00	2.58
10	000636	风华高科	500,000	5,940,000.00	2.33

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站

www.scfund.com.cn 的年度报告正文。

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	600068	葛洲坝	64,271,232.59	19.21
2	300059	东方财富	56,281,649.67	16.83
3	600110	诺德股份	51,450,877.51	15.38
4	601668	中国建筑	50,950,926.00	15.23
5	601336	新华保险	39,508,499.54	11.81
6	300070	碧水源	39,024,290.33	11.67
7	002739	万达电影	37,468,122.66	11.20

8	600183	生益科技	37,135,203.59	11.10
9	000776	广发证券	36,930,133.70	11.04
10	002340	格林美	36,926,950.54	11.04
11	601688	华泰证券	34,936,431.50	10.44
12	300336	新文化	34,175,062.41	10.22
13	600977	中国电影	33,738,567.35	10.09
14	000858	五粮液	31,874,718.09	9.53
15	000823	超声电子	30,310,537.17	9.06
16	600029	南方航空	29,735,199.42	8.89
17	600491	龙元建设	28,612,728.32	8.55
18	600030	中信证券	27,494,610.06	8.22
19	000423	东阿阿胶	26,841,393.31	8.02
20	601186	中国铁建	26,681,734.50	7.98
21	300203	聚光科技	26,424,111.32	7.90
22	002343	慈文传媒	26,371,541.34	7.88
23	002405	四维图新	26,283,909.89	7.86
24	601800	中国交建	26,136,378.98	7.81
25	300237	美晨科技	26,061,229.20	7.79
26	600446	金证股份	25,862,502.26	7.73
27	002185	华天科技	25,851,465.73	7.73
28	601599	鹿港文化	25,420,600.06	7.60
29	002624	完美世界	24,838,949.77	7.43
30	600570	恒生电子	24,723,253.46	7.39
31	000596	古井贡酒	23,484,944.45	7.02
32	600808	马钢股份	23,210,678.00	6.94
33	601111	中国国航	23,208,143.98	6.94
34	002310	东方园林	23,137,983.31	6.92
35	600884	杉杉股份	22,624,470.23	6.76
36	300054	鼎龙股份	22,080,609.77	6.60
37	000630	铜陵有色	21,554,000.00	6.44
38	300145	中金环境	21,343,372.77	6.38
39	601766	中国中车	21,227,871.00	6.35
40	000538	云南白药	20,991,986.17	6.28
41	600643	爱建集团	20,796,275.78	6.22
42	600837	海通证券	18,445,957.05	5.51
43	600115	东方航空	17,749,053.10	5.31

44	002555	三七互娱	17,711,685.39	5.30
45	600584	长电科技	17,369,467.11	5.19
46	002174	游族网络	17,163,133.89	5.13
47	601601	中国太保	16,465,646.95	4.92
48	000568	泸州老窖	16,373,302.44	4.89
49	601628	中国人寿	16,257,331.53	4.86
50	000892	欢瑞世纪	15,599,774.36	4.66
51	300383	光环新网	15,553,500.59	4.65
52	000567	海德股份	15,323,838.37	4.58
53	600028	中国石化	15,322,000.00	4.58
54	002573	清新环境	14,769,473.88	4.42
55	002518	科士达	14,753,666.54	4.41
56	000976	华铁股份	14,559,929.79	4.35
57	002636	金安国纪	14,063,775.65	4.20
58	000799	酒鬼酒	13,905,385.00	4.16
59	002439	启明星辰	13,442,604.62	4.02
60	000651	格力电器	13,399,438.03	4.01
61	300476	胜宏科技	12,980,303.91	3.88
62	600015	华夏银行	12,949,151.00	3.87
63	601377	兴业证券	12,933,207.40	3.87
64	000997	新大陆	12,913,674.23	3.86
65	600019	宝钢股份	12,686,858.12	3.79
66	300183	东软载波	12,569,280.60	3.76
67	600104	上汽集团	12,235,034.00	3.66
68	300316	晶盛机电	11,974,411.65	3.58
69	002368	太极股份	11,635,512.65	3.48
70	603328	依顿电子	11,420,621.54	3.41
71	002466	天齐锂业	11,401,006.67	3.41
72	300355	蒙草生态	11,323,876.38	3.39
73	600261	阳光照明	11,272,948.04	3.37
74	603589	口子窖	11,179,038.68	3.34
75	002273	水晶光电	11,137,939.57	3.33
76	600172	黄河旋风	11,127,208.89	3.33
77	300251	光线传媒	11,124,615.40	3.33
78	603799	华友钴业	11,000,065.20	3.29
79	000898	鞍钢股份	10,656,040.87	3.19

80	601390	中国中铁	10,649,929.00	3.18
81	600031	三一重工	10,621,785.72	3.18
82	603588	高能环境	10,236,697.44	3.06
83	000636	风华高科	9,691,560.00	2.90
84	600305	恒顺醋业	9,662,408.00	2.89
85	002195	二三四五	9,625,008.19	2.88
86	300244	迪安诊断	8,937,933.10	2.67
87	300422	博世科	8,727,021.12	2.61
88	600259	广晟有色	8,677,459.00	2.59
89	300033	同花顺	8,542,325.62	2.55
90	600999	招商证券	8,448,894.00	2.53
91	002531	天顺风能	8,287,606.73	2.48
92	600562	国睿科技	8,239,825.35	2.46
93	000501	鄂武商 A	7,905,345.12	2.36
94	600122	宏图高科	7,855,968.98	2.35
95	000783	长江证券	7,773,474.00	2.32
96	603368	柳州医药	7,316,600.30	2.19
97	002460	赣锋锂业	7,294,097.18	2.18
98	000826	启迪桑德	6,967,391.38	2.08
99	002236	大华股份	6,881,397.28	2.06
100	300078	思创医惠	6,745,585.28	2.02

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

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	600183	生益科技	71,236,259.25	21.30
2	600068	葛洲坝	64,805,269.00	19.37
3	600110	诺德股份	60,101,905.70	17.97
4	601668	中国建筑	50,605,775.00	15.13
5	300059	东方财富	48,300,406.99	14.44
6	000858	五粮液	46,334,394.76	13.85
7	601688	华泰证券	39,434,395.92	11.79
8	601336	新华保险	38,527,205.77	11.52
9	300070	碧水源	38,029,129.97	11.37

10	000776	广发证券	37,420,142.43	11.19
11	002739	万达电影	37,088,247.95	11.09
12	002340	格林美	36,912,938.70	11.04
13	000823	超声电子	34,648,669.54	10.36
14	300203	聚光科技	33,845,779.67	10.12
15	000568	泸州老窖	29,947,371.32	8.95
16	600977	中国电影	28,693,504.63	8.58
17	600030	中信证券	27,795,535.49	8.31
18	000630	铜陵有色	27,008,730.58	8.07
19	600491	龙元建设	26,848,941.18	8.03
20	601186	中国铁建	26,694,933.21	7.98
21	000423	东阿阿胶	26,648,802.09	7.97
22	300237	美晨科技	26,196,472.78	7.83
23	600446	金证股份	26,155,039.39	7.82
24	002185	华天科技	26,127,372.62	7.81
25	600570	恒生电子	25,886,524.04	7.74
26	002368	太极股份	25,766,966.89	7.70
27	601800	中国交建	25,760,489.00	7.70
28	600884	杉杉股份	24,871,943.56	7.44
29	300183	东软载波	24,740,620.78	7.40
30	002310	东方园林	24,621,366.00	7.36
31	600029	南方航空	24,025,095.22	7.18
32	000596	古井贡酒	23,684,644.35	7.08
33	002405	四维图新	23,683,153.50	7.08
34	002636	金安国纪	23,416,112.65	7.00
35	600808	马钢股份	23,172,077.44	6.93
36	601766	中国中车	22,251,891.27	6.65
37	002624	完美世界	21,536,101.58	6.44
38	300145	中金环境	21,212,807.49	6.34
39	601599	鹿港文化	20,315,665.72	6.07
40	300033	同花顺	19,939,891.13	5.96
41	002439	启明星辰	19,881,329.58	5.94
42	601377	兴业证券	19,545,324.36	5.84
43	601111	中国国航	19,142,661.04	5.72
44	000538	云南白药	18,943,857.35	5.66
45	600999	招商证券	18,662,908.00	5.58
46	600837	海通证券	18,349,703.00	5.49
47	002555	三七互娱	17,439,111.30	5.21

48	600115	东方航空	17,266,691.56	5.16
49	002174	游族网络	16,771,957.58	5.01
50	601601	中国太保	16,263,351.93	4.86
51	601628	中国人寿	16,162,317.27	4.83
52	300383	光环新网	16,026,986.14	4.79
53	600643	爱建集团	15,625,987.28	4.67
54	600028	中国石化	15,334,000.00	4.58
55	002518	科士达	15,194,393.63	4.54
56	000799	酒鬼酒	14,939,657.51	4.47
57	300476	胜宏科技	14,752,326.59	4.41
58	002573	清新环境	14,746,034.25	4.41
59	600584	长电科技	14,435,415.17	4.32
60	000976	华铁股份	14,396,466.04	4.30
61	002475	立讯精密	14,309,155.88	4.28
62	600519	贵州茅台	14,270,327.49	4.27
63	300054	鼎龙股份	13,812,651.60	4.13
64	000997	新大陆	13,721,084.20	4.10
65	600109	国金证券	13,327,746.00	3.98
66	000651	格力电器	13,256,737.64	3.96
67	000892	欢瑞世纪	12,967,422.07	3.88
68	600015	华夏银行	12,914,647.00	3.86
69	600104	上汽集团	12,389,626.00	3.70
70	603799	华友钴业	12,371,690.44	3.70
71	600019	宝钢股份	12,096,282.36	3.62
72	300355	蒙草生态	12,020,626.01	3.59
73	603328	依顿电子	11,720,235.15	3.50
74	002466	天齐锂业	11,337,072.41	3.39
75	600261	阳光照明	11,300,670.85	3.38
76	000898	鞍钢股份	10,946,296.00	3.27
77	002241	歌尔股份	10,781,708.98	3.22
78	601390	中国中铁	10,594,975.40	3.17
79	000567	海德股份	10,134,780.00	3.03
80	603588	高能环境	10,051,844.27	3.01
81	002531	天顺风能	9,812,566.20	2.93
82	300078	思创医惠	9,394,140.25	2.81
83	600820	隧道股份	9,247,487.02	2.76
84	300244	迪安诊断	8,981,826.55	2.69
85	600305	恒顺醋业	8,804,838.00	2.63

86	300316	晶盛机电	8,673,195.94	2.59
87	600562	国睿科技	8,593,209.09	2.57
88	002195	二三四五	8,495,908.72	2.54
89	600259	广晟有色	8,371,854.45	2.50
90	000028	国药一致	8,267,996.42	2.47
91	300422	博世科	8,031,078.70	2.40
92	000783	长江证券	7,919,847.00	2.37
93	300207	欣旺达	7,797,282.36	2.33
94	600122	宏图高科	7,777,279.00	2.33
95	002236	大华股份	7,708,261.03	2.30
96	300336	新文化	7,463,434.00	2.23
97	603368	柳州医药	7,461,994.55	2.23
98	002273	水晶光电	7,345,370.51	2.20
99	002460	赣锋锂业	7,202,168.00	2.15

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	2,211,483,768.14
卖出股票收入（成交）总额	2,305,622,486.54

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	637,920.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,030.43
5	应收申购款	1,694.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	654,645.88

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

份额 级别	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
东 吴 移 动 互 联 混 合 A	2,504	92,558.99	60,070,132.04	25.92%	171,697,583.71	74.08%
东 吴 移 动 互 联 混 合 C	1	999.00	0.00	0.00%	999.00	100.00%
合计	2,505	92,522.44	60,070,132.04	25.92%	171,698,582.71	74.08%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	东吴移动互联混合 A	2,902.93	0.0013%
	东吴移动互联混合 C	999.00	100.0000%
	合计	3,901.93	0.0017%

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

项目	东吴移动互联混合 A	东吴移动互联混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 27 日）基金份额总额	2,403,079,202.08	-
本报告期期初基金份额总额	341,133,744.35	999.00
本报告期基金总申购份额	71,999,348.83	-
减:本报告期基金总赎回份额	181,365,377.43	-
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	231,767,715.75	999.00

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、2017 年 4 月 10 日，冯玉泉不再担任公司董事一职，由陈建国担任公司董事会董事。
- 2、2017 年 12 月 27 日，陈辉峰、陈如奇、倪雪梅、贝政新不再担任公司董事一职，由汤勇、周虹、张婉苏、方志刚担任公司董事会董事。

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2017 年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	
天风证券	2	2,178,902,508.86	48.30%	2,009,516.59	48.37%	-
东吴证券	2	1,229,470,224.52	27.25%	1,127,290.62	27.13%	-
华创证券	1	574,962,298.99	12.74%	535,459.18	12.89%	-
光大证券	1	467,228,209.22	10.36%	425,785.94	10.25%	-
国信证券	1	60,877,285.06	1.35%	56,694.74	1.36%	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期增加 2 个交易单元，其中华信证券 1 个、华创证券 1 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
天风证券	536,850.30	4.99%	-	-	-	-
东吴证券	4,898,825.21	45.57%	-	-	-	-
华创证券	486,137.30	4.52%	-	-	-	-
光大证券	4,827,520.66	44.91%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

华信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

东吴基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日