

# 东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十一日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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 2021 年 01 月 01 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
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.....	12
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>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	62
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.....	62

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 .....	62
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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>64</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
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 .....	64
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>65</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 .....	66
11.4 基金投资策略的改变 .....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
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 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东吴新趋势价值线混合
基金主代码	001322
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	162,655,956.76 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于代表未来发展趋势的新能源、新技术、新生活产业中的优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，力争实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。
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	本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×65%+中国债券综合全价指数×35%
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。

为了更好地体现管理人与基金持有人利益一致的目的，基金管理人在基金管理中设置“价值线”作为管理费收取和风险控制的参考依据，从而更有效的发挥自身的专业研究与管理能力，最大程度实现基金持有人的财富保值增值目标。但本价值线增长轨迹并不代表基金净值增长曲线。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	秦一楠
	联系电话	021-50509888-8308	010-66060069
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-68121816
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	200120	100031
法定代表人	邓晖	谷澍

## 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
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

## § 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	112,801,179.93	104,908,541.73	62,361,842.21
本期利润	89,229,038.19	151,556,305.28	78,108,750.71
加权平均基金份额本期利润	0.4101	0.4072	0.1714
本期加权平均净值利润率	36.90%	54.78%	33.56%
本期基金份额净值增长率	42.92%	71.61%	39.86%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	64,464,558.61	-43,793,604.69	-174,950,373.72
期末可供分配基金份额利润	0.3963	-0.1356	-0.4216
期末基金资产净值	230,982,771.04	320,918,254.94	240,397,161.00
期末基金份额净值	1.4201	0.9936	0.5790
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	42.01%	-0.64%	-42.10%

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

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

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

### 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	11.13%	1.62%	1.20%	0.51%	9.93%	1.11%
过去六个月	22.85%	1.87%	-3.03%	0.66%	25.88%	1.21%
过去一年	42.92%	1.88%	-2.64%	0.76%	45.56%	1.12%
过去三年	243.02%	1.62%	42.84%	0.83%	200.18%	0.79%
过去五年	89.09%	1.53%	33.64%	0.78%	55.45%	0.75%
自基金合同生效起至今	42.01%	1.51%	8.89%	0.91%	33.12%	0.60%

注：基金业绩比较基准=沪深 300 指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

### 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

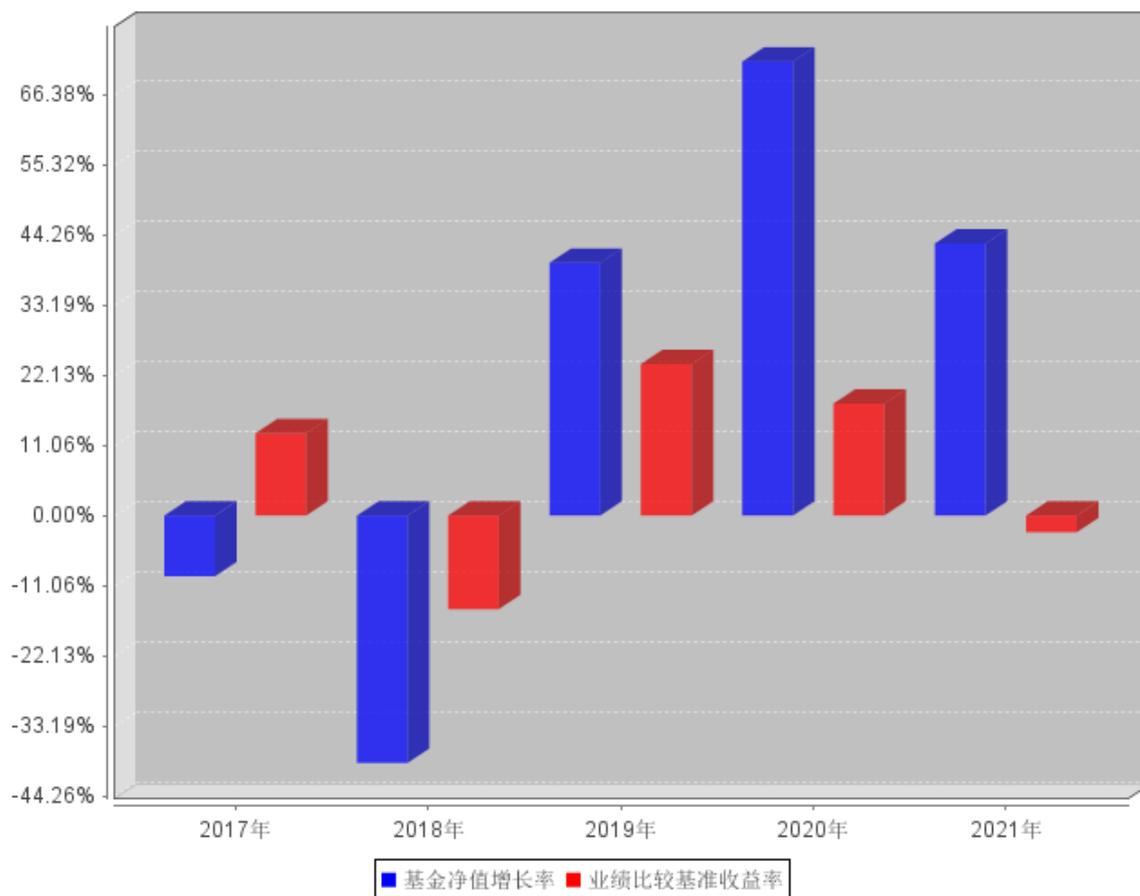
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金业绩比较基准=沪深 300 指数×65%+中国债券综合全价指数×35%

### 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



### 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银城路 117 号瑞明大厦 901、902 室。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、中国证监会许可的其他业务。

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、私募资产管理业务以及子公司业务协同发展,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,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 2021 年年末,公司整体资产管理规模为【399.99】亿元,其中公募基金【294.31】亿元,私募资产管理业务【105.68】亿元,子公司【4.74】亿元;旗下管理着【29】只公募基金(不含清盘中的基金),【35】只存续私募资产管理计划(不包含正在清盘中的资产管理计划),【9】项专项资产管理计划(子公司)。

#### 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	权益投资总部副总经理、基金经理	2019 年 4 月 29 日	-	17 年	刘元海先生,中国国籍,同济大学管理学博士,具备证券投资基金从业资格。曾任职东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理(2004 年 2 月-2015 年 6 月),期间担任东吴新产业精选股票型证券投资基金、东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)、东吴内需增长混合型证券投资基金、东吴行业轮动混合型证券投资基金的基

					金经理。2016年2月再次加入东吴基金管理有限公司，现任权益投资总部副总经理、基金经理。2017年2月9日至2020年1月9日担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理，2020年1月18日至2021年3月1日担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2016年4月27日至今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，2019年4月29日至今担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020年4月1日至今担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

### 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，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。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

### 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权限、研究管理、投资决策制度、投资备选库管理制度和集中交易制度，以保障各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会，并落实交易执行环节公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行交易指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，尽可能确保公平对待各投资组合，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对公司旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，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。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 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

2021 年，A 股市场跌宕起伏，市场风格分化剧烈。创业板指数表现要强于沪深 300，宁指数表现要强于茅指数。从行业表现看，新能源、军工、半导体以及周期性行业如煤炭、化工、钢铁等表现要强于医药、食品饮料等传统优势行业。

2021 年，本基金选择景气较好的行业包括：新能源汽车、电子（半导体、消费电子、军工电子）作为核心配置。虽然 1 季度核心资产和周期性股票表现比较好，但我们坚持认为，良好基本面势必会反应在股价上，只是时间早晚的问题。从 2 季度开始，市场风格偏向成长股，与本基金配置思路比较吻合。因此，从 2 季度开始至年底，本基金取得比较好的投资收益回报。

#### 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 1.4201 元；本报告期基金份额净值增长率为 42.92%，业绩比较基准收益率为-2.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，2022 年中国经济可能进入减速期。国内经济减速的苗头大约在 2021 年三季度就开始显现，2021 年的经济支撑力是“出口-制造业”链条，但综合考虑全球经济走势和基数效应，2022 年中国出口对经济的拉动力大概率减弱。经济减速背景下，国内稳增长需求提升，基建投资增速开年有望加速，以此实现对经济下滑的托底。此外，在稳增长政策指导下，地产投资边际上也有望改善，减轻对经济的下行压力。从节奏上看，2022 年上半年国内可能是典型的“经济退+政策宽”组合，2022 年下半年或之后国内经济有望有一定概率企稳，国内环境将逐步转向“经济稳+政策退”。

政策层面，2022 年上半年国内和海外可能呈现比较明显的分化，国内有望依然会维持宽松的货币政策环境。国内自 2021 年下半年以来开启降准降息，在稳增长的压力下，国内 2022 年上半年大概率继续实施货币宽松措施。在宽货币稳经济的推动下，国内信用环境也有望维持偏宽松的氛围。反观海外，在通胀压力下，主要经济体央行已进入紧缩周期。英国央行已经于 2021 年底率先启动加息，美联储正在逐步缩减 QE，并已将加息和缩表提上议程，2022 年上半年美联储有望开启加息周期。国内和海外货币政策之所以可能在 2022 年上半年会发生分化，原因之一是各自所处的环境不同。中国的通胀压力相对较小，但稳增长的压力相对较大；以美国为代表的海外发达国家，通胀的压力相对较大，而就业压力相对较小。2022 年下半年，中国的货币政策是否会向海外靠拢，存在一定不确定性，需要密切观察国内通胀和经济稳增长的情况。

A 股市场方面，我们认为 2022 年需要把握的核心脉络是经济衰退背景下的政策放松，虽然经济衰退背景下上市公司整体盈利增速可能下滑，但国内流动性宽松和盈利增速下行相对冲，A 股大概率呈现整体震荡市格局，新的结构性行情仍有望演绎。

2022 年我们将继续沿着高景气主线，在新能源、科技成长和消费成长领域，持续挖掘业绩增速与估值相匹配的公司作为重点关注对象。我们判断，2022 年新能源汽车电动化仍然有望存在投资机会，特别是近期调整之后新能源汽车电动化投资价值部分或已显现出来。汽车智能化有望是 2022 年重要关注方向，2022 年汽车智能化有望给相关公司带来新的业绩增长点，并且业绩弹性有望逐步显现出来。半导体国产化替代以及新的产业需求如新能源汽车等拉动，2022 年 A 股半导体行业投资机会或也值得关注。我们将持续跟踪元宇宙产业发展趋势，预计 2022 年元宇宙可能不断会有新的产业信息催化，投资机会值得密切关注。经过 2021 年调整，我们判断，2022 年医药生

物、食品饮料等消费类行业也有望存在投资机会。

本基金将继续以科技成长和消费成长为主，把握中长期投资机会，努力为投资者获取中长期绝对收益。

#### 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) 根据法规要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据《公募基金管理公司压力指引（试行）》及基金业协会的相关要求，结合公司旗下各公募基金的实际运作情况，对公司旗下公募基金开展了情景压力测试，形成压力测试分析报告，加强流动性风险管理。公司根据法规要求持续关注流动性法规执行情况，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，建立健全公司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。稽核内容覆盖了投资、研究、交易等多项业务领域，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) 加强宣传推介材料审核，保证合规推介。公司根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》等法规及相关监管要求，对拟对外发布的宣传材料发表初审及复审合规意见，包括不限于宣传单页、一页通、海报、PPT、视频、文章等。重点根据相关法规及监管要求对宣传材料中涉及到的业绩引用、基金评价引用、风险揭示等内容作出合规风险提示及意见。

(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，升级业务系统并调整风控设置，保障基金投资符合监管要求。

本基金管理人自成立以来，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，成员由分管运营副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、固定收益部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

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。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；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，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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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的情形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

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

## § 6 审计报告

### 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	安永华明（2022）审字第 60469066_B04 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	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
其他信息	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营

	<p>或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评</p>

	价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈露	张亚旋
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2022年3月29日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,579,911.90	5,933,215.28
结算备付金		1,625,727.79	1,631,820.76
存出保证金		148,027.85	235,660.13
交易性金融资产	7.4.7.2	227,420,658.89	314,557,523.23
其中：股票投资		212,910,308.89	302,100,773.23
基金投资		-	-
债券投资		14,510,350.00	12,456,750.00
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	-	-
应收证券清算款		393,005.53	1,218,648.94
应收利息	7.4.7.5	285,065.71	108,043.03
应收股利		-	-
应收申购款		41,662.80	60,585.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		232,494,060.47	323,745,496.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	343,873.78
应付赎回款		383,990.19	1,322,076.25
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		49,241.69	65,616.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	888,772.30	905,857.04
应交税费		-	0.02
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,285.25	189,818.36
负债合计		1,511,289.43	2,827,241.49
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	162,655,956.76	322,969,542.11
未分配利润	7.4.7.10	68,326,814.28	-2,051,287.17
所有者权益合计		230,982,771.04	320,918,254.94
负债和所有者权益总计		232,494,060.47	323,745,496.43

报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4201 元，基金份额总额 162,655,956.76 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		95,338,086.59	159,095,396.30
1. 利息收入		348,019.86	354,360.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	51,749.96	249,697.61
债券利息收入		296,269.90	104,662.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		118,373,959.98	111,980,254.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	117,419,725.85	110,654,676.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	204,518.42	22,898.65
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	749,715.71	1,302,679.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-23,572,141.74	46,647,763.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	188,248.49	113,017.62
<b>减：二、费用</b>		6,109,048.40	7,539,091.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	605,114.41	689,482.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	5,279,191.20	6,611,849.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.17	0.04
7. 其他费用	7.4.7.19	224,742.62	237,758.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		89,229,038.19	151,556,305.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		89,229,038.19	151,556,305.28

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	322,969,542.11	-2,051,287.17	320,918,254.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,229,038.19	89,229,038.19
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）	-160,313,585.35	-18,850,936.74	-179,164,522.09
其中：1. 基金申购款	44,736,679.67	7,799,178.77	52,535,858.44
2. 基金赎回款	-205,050,265.02	-26,650,115.51	-231,700,380.53
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）	162,655,956.76	68,326,814.28	230,982,771.04
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	414,923,856.08	-174,526,695.08	240,397,161.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	151,556,305.28	151,556,305.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-91,954,313.97	20,919,102.63	-71,035,211.34
其中：1. 基金申购款	47,458,508.97	-9,760,275.28	37,698,233.69
2. 基金赎回款	-139,412,822.94	30,679,377.91	-108,733,445.03
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）	322,969,542.11	-2,051,287.17	320,918,254.94

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>          邓晖          </u>	<u>          徐明          </u>	<u>          骆银          </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

东吴新趋势价值线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]764号《关于准予东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于2015年7月1日正式生效，首次设立募集规模为1,509,002,981.31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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准=沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

## 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（以下合称“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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》、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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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和债券投资等；

## (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和债券等，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/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) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 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等费用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。

#### 7.4.5 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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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；

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4. 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。

#### 5. 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 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,579,911.90	5,933,215.28
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,579,911.90	5,933,215.28

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,374,964.64	212,910,308.89	29,535,344.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,502,940.90	4,501,350.00
	银行间市场	10,011,240.00	10,009,000.00
	合计	14,514,180.90	14,510,350.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	197,889,145.54	227,420,658.89	29,531,513.35
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	249,029,098.14	302,100,773.23	53,071,675.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,489,750.00	2,496,750.00
	银行间市场	9,935,020.00	9,960,000.00
	合计	12,424,770.00	12,456,750.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	261,453,868.14	314,557,523.23	53,103,655.09

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

**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**

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末均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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	654.36	1,466.42
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	731.60	734.30
应收债券利息	283,613.15	105,736.31
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	66.60	106.00
合计	285,065.71	108,043.03

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	888,422.30	905,507.04
银行间市场应付交易费用	350.00	350.00
合计	888,772.30	905,857.04

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	285.25	818.36
应付证券出借违约金	-	-
应付审计费	60,000.00	60,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	189,285.25	189,818.36

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	322,969,542.11	322,969,542.11
本期申购	44,736,679.67	44,736,679.67
本期赎回（以“-”号填列）	-205,050,265.02	-205,050,265.02
- 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	162,655,956.76	162,655,956.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-43,793,604.69	41,742,317.52	-2,051,287.17
本期利润	112,801,179.93	-23,572,141.74	89,229,038.19
本期基金份额交易产生的变动数	-4,543,016.63	-14,307,920.11	-18,850,936.74
其中：基金申购款	5,484,524.15	2,314,654.62	7,799,178.77
基金赎回款	-10,027,540.78	-16,622,574.73	-26,650,115.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,464,558.61	3,862,255.67	68,326,814.28

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
	活期存款利息收入	29,458.14
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	19,766.45	26,928.54
其他	2,525.37	4,157.60
合计	51,749.96	249,697.61

### 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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	1,806,835,666.51	2,194,684,037.03
减：卖出股票成本总额	1,689,415,940.66	2,084,029,360.89
买卖股票差价收入	117,419,725.85	110,654,676.14

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	204,518.42	22,898.65
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	204,518.42	22,898.65

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	23,610,874.81	13,383,473.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,968,690.00	13,079,860.00
减：应收利息总额	437,666.39	280,714.57
买卖债券差价收入	204,518.42	22,898.65

#### 7.4.7.13.3 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均无资产支持证券投资收益。

### 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均无衍生工具收益。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	749,715.71	1,302,679.96
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	749,715.71	1,302,679.96

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-23,572,141.74	46,647,763.55
——股票投资	-23,536,330.84	46,615,783.55
——债券投资	-35,810.90	31,980.00
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-23,572,141.74	46,647,763.55

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	187,212.21	112,423.92
转换费收入	1,036.28	530.80
其他收入	-	62.90
合计	188,248.49	113,017.62

### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	5,278,491.20	6,611,324.88
银行间市场交易费用	700.00	525.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	5,279,191.20	6,611,849.88

### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划费	7,498.62	11,558.38
账户维护费	36,000.00	45,000.00
其他费用	1,244.00	1,200.00
合计	224,742.62	237,758.38

## 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海澜集团有限公司	基金管理人的股东

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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	514,916,515.61	15.06%	-	-

**7.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	7,002,690.90	91.28%	-	-

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**7.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期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。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	471,280.84	14.99%	194,860.61	21.93%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	0.00	0.00
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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。在本基金单位资产净值低于价值线期间，基金管理人将对本基金全部资产暂停收取基金管理费；在经过基金管理人、基金托管人核对基金单位资产净值及价值线后，如果单位资产净值低于价值线，基金管理人将从下一日开始暂停收取基金管理费，直至单位资产净值不低于价值线。

##### 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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	605,114.41	689,482.72

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期未产生应支付给关联方的销售服务费。

#### 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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,579,911.90	29,458.14	5,933,215.28	218,611.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 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。

**7.4.10.8 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**

本基金本报告期未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2021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
688385	复旦微电	2021年7月27日	2022年2月7日	新股限售	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688789	宏华数科	2021年7月1日	2022年1月10日	新股限售	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688187	时代电气	2021年8月30日	2022年3月7日	新股限售	31.38	76.65	3,725	116,890.50	285,521.25	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年1月7日	新股未上市	22.98	22.98	6,331	145,486.38	145,486.38	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	1,962	82,364.76	82,364.76	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股限售	60.66	96.75	199	12,071.34	19,253.25	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股限售	22.04	56.28	287	6,325.48	16,152.36	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万	2021年11月	2022年6月	新股限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-

	年青	月 30 日	月 7 日	售							
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-	
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股限售	19.11	67.93	193	3,688.23	13,110.49	-	
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股限售	6.96	12.51	1,039	7,231.44	12,997.89	-	
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	新股限售	25.80	33.65	377	9,726.60	12,686.05	-	
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股限售	22.70	49.02	248	5,629.60	12,156.96	-	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股限售	26.91	43.36	267	7,184.97	11,577.12	-	
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 18 日	新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股限售	11.88	21.16	516	6,130.08	10,918.56	-	
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股限售	26.17	44.86	241	6,306.97	10,811.26	-	
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股限售	12.37	19.23	522	6,457.14	10,038.06	-	
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-	
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股限售	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-	
301087	可孚医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股限售	93.09	75.34	124	11,543.16	9,342.16	-	
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-	
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-	
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股限售	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-	
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 19 日	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股限售	27.81	31.14	262	7,286.22	8,158.68	-	
301166	优宁	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股限售	86.06	94.50	85	7,315.10	8,032.50	-	

	维										
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股限售	27.12	30.58	260	7,051.20	7,950.80	-	
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股限售	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-	
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股限售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股限售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股限售	66.18	56.62	121	8,007.78	6,851.02	-	
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-	
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-	
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-	
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股限售	27.85	27.46	233	6,489.05	6,398.18	-	
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股限售	29.28	32.00	194	5,680.32	6,208.00	-	
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-	
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-	
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股限售	43.99	50.77	110	4,838.90	5,584.70	-	
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-	
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-	
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股限售	79.60	78.53	65	5,174.00	5,104.45	-	
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-	

301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股限售	57.27	53.71	90	5,154.30	4,833.90	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股限售	36.31	35.52	136	4,938.16	4,830.72	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股限售	58.08	49.85	94	5,459.52	4,685.90	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股限售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金主要投资于代表未来发展趋势的新能源、新技术、新生活产业中的优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，力争实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。

基于该投资目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，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；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,510,350.00	12,456,750.00
合计	14,510,350.00	12,456,750.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	2,579,911.90	-	-	-	-	-	2,579,911.90
结算备付金	1,625,727.79	-	-	-	-	-	1,625,727.79
存出保证金	148,027.85	-	-	-	-	-	148,027.85
交易性金融资产	-	10,009,000.00	4,501,350.00	-	-	-212,910,308.89	227,420,658.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	393,005.53	393,005.53
应收利息	-	-	-	-	-	285,065.71	285,065.71
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	41,662.80	41,662.80
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,353,667.54	10,009,000.00	4,501,350.00	-	-	-213,630,042.93	232,494,060.47
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	383,990.19	383,990.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	49,241.69	49,241.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	888,772.30	888,772.30
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	189,285.25	189,285.25
负债总计	-	-	-	-	-	1,511,289.43	1,511,289.43
利率敏感度缺口	4,353,667.54	10,009,000.00	4,501,350.00	-	-	-212,118,753.50	230,982,771.04
上年度末 2020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	5,933,215.28	-	-	-	-	-	5,933,215.28
结算备付金	1,631,820.76	-	-	-	-	-	1,631,820.76
存出保证金	235,660.13	-	-	-	-	-	235,660.13
交易性金融资产	-	-	-12,456,750.00	-	-	-302,100,773.23	314,557,523.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,218,648.94	1,218,648.94
应收利息	-	-	-	-	-	108,043.03	108,043.03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	60,585.06	60,585.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,800,696.17	-	-12,456,750.00	-	-	-303,488,050.26	323,745,496.43
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购	-	-	-	-	-	-	-

金融资产款							
应付证券清算款						343,873.78	343,873.78
应付赎回款						1,322,076.25	1,322,076.25
应付管理人报酬							
应付托管费						65,616.04	65,616.04
应付销售服务费							
应付交易费用						905,857.04	905,857.04
应交税费						0.02	0.02
应付利息							
应付利润							
其他负债						189,818.36	189,818.36
负债总计						2,827,241.49	2,827,241.49
利率敏感度缺口	7,800,696.17		-12,456,750.00			-300,660,808.77	320,918,254.94

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	1、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。		
	2、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。		
	3、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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	基准利率减少 25 个基点	8,165.93	12,847.04
	基准利率增加 25 个基点	-8,156.34	-12,820.21

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

##### 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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	212,910,308.89	92.18	302,100,773.23	94.14
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	212,910,308.89	92.18	302,100,773.23	94.14

注：本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，投资于新趋势主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规；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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准	
	2. 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 12 月）

		31 日 )	31 日 )
	业绩基准下跌 1%	-3,487,839.84	-5,166,783.90
	业绩基准下跌 5%	-17,439,199.21	-25,833,919.52
	业绩基准下跌 10%	-34,878,398.43	-51,667,839.05

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 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 211,045,873.80 元，属于第二层次的余额为人民币 14,743,705.63 元，属于第三层次的余额为人民币 1,631,079.46 元。（于 2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 298,888,712.94 元，属于第二层次的余额为人民币 12,625,738.15 元，属于第三层次的余额为人民币 3,043,072.14 元。）

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，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证券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，确定相关证券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。

###### 7.4.14.1.2.3 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第三层次公允价值期末余额为人民币 1,631,079.46 元，期初余额为人民币 3,043,072.14 元，本期减少人民币 1,411,992.68 元。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

### 7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除此之外，截至资产负债表日，本基金无其他需要说明的其他重要事项。

### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	212,910,308.89	91.58
	其中：股票	212,910,308.89	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,510,350.00	6.24
	其中：债券	14,510,350.00	6.24
	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	4,205,639.69	1.81
8	其他各项资产	867,761.89	0.37
9	合计	232,494,060.47	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	203,573,000.77	88.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	31,279.56	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,238,368.02	4.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	29,454.63	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,992.19	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	16,891.92	0.01
S	综合	-	-
	合计	212,910,308.89	92.18

### 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	002241	歌尔股份	380,000	20,558,000.00	8.90
2	002460	赣锋锂业	130,000	18,570,500.00	8.04
3	603005	晶方科技	300,000	16,527,000.00	7.16
4	002920	德赛西威	110,000	15,566,100.00	6.74
5	603501	韦尔股份	50,000	15,538,500.00	6.73
6	603986	兆易创新	70,000	12,309,500.00	5.33
7	603659	璞泰来	71,000	11,403,310.00	4.94
8	002709	天赐材料	95,000	10,891,750.00	4.72
9	300750	宁德时代	18,000	10,584,000.00	4.58
10	002466	天齐锂业	90,000	9,630,000.00	4.17
11	002624	完美世界	450,000	9,139,500.00	3.96
12	002938	鹏鼎控股	180,000	7,637,400.00	3.31
13	002475	立讯精密	150,000	7,380,000.00	3.20
14	300223	北京君正	50,000	6,700,000.00	2.90
15	002049	紫光国微	28,000	6,300,000.00	2.73
16	600703	三安光电	150,000	5,634,000.00	2.44
17	002906	华阳集团	100,000	5,496,000.00	2.38
18	603305	旭升股份	110,000	5,486,800.00	2.38
19	603678	火炬电子	60,000	4,539,000.00	1.97
20	601689	拓普集团	80,000	4,240,000.00	1.84
21	002812	恩捷股份	15,000	3,756,000.00	1.63
22	002036	联创电子	130,000	3,153,800.00	1.37
23	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.19
24	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.16
25	688187	时代电气	3,725	285,521.25	0.12
26	688176	亚虹医药	6,331	145,486.38	0.06
27	688262	国芯科技	1,962	82,364.76	0.04

28	301029	怡合达	462	41,519.94	0.02
29	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
30	301155	海力风电	199	19,253.25	0.01
31	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
32	301035	润丰股份	287	16,152.36	0.01
33	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
34	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
35	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
36	301089	拓新药业	193	13,110.49	0.01
37	301039	中集车辆	1,039	12,997.89	0.01
38	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
39	301211	亨迪药业	377	12,686.05	0.01
40	301118	恒光股份	248	12,156.96	0.01
41	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
42	301101	明月镜片	267	11,577.12	0.01
43	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
44	301185	鸥玛软件	516	10,918.56	0.00
45	301138	华研精机	241	10,811.26	0.00
46	301126	达嘉维康	522	10,038.06	0.00
47	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
48	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
49	301087	可孚医疗	124	9,342.16	0.00
50	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
51	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
52	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
53	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
54	301100	风光股份	262	8,158.68	0.00
55	301166	优宁维	85	8,032.50	0.00
56	301182	凯旺科技	260	7,950.80	0.00
57	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
58	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
59	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
60	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
61	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
62	301189	奥尼电子	121	6,851.02	0.00
63	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
64	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
65	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
66	301190	善水科技	233	6,398.18	0.00

67	301199	迈赫股份	194	6,208.00	0.00
68	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
69	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
70	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
71	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
72	301179	泽宇智能	110	5,584.70	0.00
73	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
74	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
75	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
76	301096	百诚医药	65	5,104.45	0.00
77	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
78	301108	洁雅股份	90	4,833.90	0.00
79	301092	争光股份	136	4,830.72	0.00
80	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
81	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
82	301093	华兰股份	94	4,685.90	0.00
83	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
84	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
85	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
86	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
87	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	002624	完美世界	49,720,042.87	15.49
2	603267	鸿远电子	48,118,231.14	14.99
3	603678	火炬电子	47,489,478.33	14.80
4	002555	三七互娱	37,930,797.52	11.82
5	002460	赣锋锂业	36,314,072.55	11.32
6	603986	兆易创新	36,130,211.52	11.26
7	002709	天赐材料	35,236,558.30	10.98
8	600584	长电科技	35,170,581.59	10.96
9	002466	天齐锂业	33,157,343.18	10.33
10	603501	韦尔股份	30,979,299.70	9.65
11	300413	芒果超媒	29,373,515.48	9.15

12	300347	泰格医药	28,751,417.00	8.96
13	603005	晶方科技	28,463,086.57	8.87
14	002756	永兴材料	28,207,708.60	8.79
15	002497	雅化集团	27,869,326.48	8.68
16	002340	格林美	25,735,047.42	8.02
17	603259	药明康德	25,351,826.19	7.90
18	601012	隆基股份	24,240,507.46	7.55
19	601689	拓普集团	22,830,110.45	7.11
20	300274	阳光电源	21,619,686.03	6.74
21	600703	三安光电	21,486,209.55	6.70
22	002812	恩捷股份	21,351,895.00	6.65
23	000858	五粮液	20,720,379.10	6.46
24	688388	嘉元科技	20,279,348.93	6.32
25	300073	当升科技	19,744,460.09	6.15
26	000009	中国宝安	19,045,547.20	5.93
27	300037	新宙邦	18,661,758.58	5.82
28	603659	璞泰来	18,224,000.00	5.68
29	300661	圣邦股份	18,132,989.00	5.65
30	000733	振华科技	16,564,367.10	5.16
31	600183	生益科技	16,535,616.95	5.15
32	600110	诺德股份	16,113,298.00	5.02
33	002920	德赛西威	16,051,327.33	5.00
34	600893	航发动力	15,749,276.63	4.91
35	002475	立讯精密	15,714,046.48	4.90
36	300726	宏达电子	15,648,530.05	4.88
37	002938	鹏鼎控股	15,639,066.32	4.87
38	002185	华天科技	15,232,095.00	4.75
39	002371	北方华创	15,082,124.00	4.70
40	002439	启明星辰	15,031,474.00	4.68
41	002241	歌尔股份	14,780,457.77	4.61
42	300458	全志科技	14,002,803.83	4.36
43	688099	晶晨股份	13,722,872.96	4.28
44	002407	多氟多	13,563,042.12	4.23
45	300759	康龙化成	12,951,592.46	4.04
46	688396	华润微	12,638,697.81	3.94
47	300223	北京君正	12,526,234.26	3.90

48	000977	浪潮信息	12,428,058.33	3.87
49	002493	荣盛石化	12,415,656.34	3.87
50	300122	智飞生物	12,315,706.00	3.84
51	300015	爱尔眼科	12,102,874.73	3.77
52	000568	泸州老窖	12,077,779.00	3.76
53	002463	沪电股份	11,674,586.24	3.64
54	688005	容百科技	11,506,533.13	3.59
55	002049	紫光国微	11,364,869.00	3.54
56	603799	华友钴业	11,081,664.08	3.45
57	300659	中孚信息	10,613,126.62	3.31
58	002108	沧州明珠	10,397,272.63	3.24
59	605111	新洁能	10,386,411.37	3.24
60	300432	富临精工	9,848,015.00	3.07
61	002212	天融信	9,768,092.20	3.04
62	300390	天华超净	9,607,508.00	2.99
63	601318	中国平安	9,474,848.93	2.95
64	600309	万华化学	9,413,018.00	2.93
65	300782	卓胜微	8,653,710.28	2.70
66	600487	亨通光电	8,300,127.00	2.59
67	000661	长春高新	8,164,596.00	2.54
68	300760	迈瑞医疗	8,004,383.00	2.49
69	688187	时代电气	7,888,515.97	2.46
70	300450	先导智能	7,480,838.01	2.33
71	000762	西藏矿业	7,445,517.00	2.32
72	603305	旭升股份	7,316,159.00	2.28
73	002600	领益智造	7,173,840.00	2.24
74	002906	华阳集团	6,950,336.20	2.17
75	600104	上汽集团	6,949,017.00	2.17
76	600315	上海家化	6,734,228.00	2.10
77	601888	中国中免	6,676,948.00	2.08
78	002036	联创电子	6,646,513.00	2.07
79	688023	安恒信息	6,624,754.51	2.06

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	603267	鸿远电子	51,761,849.00	16.13
2	603678	火炬电子	50,844,613.39	15.84
3	002624	完美世界	42,505,961.99	13.25
4	300037	新宙邦	35,133,970.11	10.95
5	002460	赣锋锂业	34,914,776.02	10.88
6	002555	三七互娱	34,545,696.45	10.76
7	002466	天齐锂业	34,393,080.70	10.72
8	600584	长电科技	34,070,840.98	10.62
9	603259	药明康德	33,050,983.20	10.30
10	603986	兆易创新	33,002,283.95	10.28
11	300073	当升科技	31,051,897.22	9.68
12	002756	永兴材料	30,080,382.10	9.37
13	002497	雅化集团	29,961,805.30	9.34
14	601012	隆基股份	29,889,757.20	9.31
15	300347	泰格医药	29,433,711.50	9.17
16	688388	嘉元科技	29,159,774.89	9.09
17	002709	天赐材料	29,012,523.19	9.04
18	300413	芒果超媒	28,749,826.00	8.96
19	002340	格林美	28,010,205.46	8.73
20	002812	恩捷股份	26,081,850.00	8.13
21	688396	华润微	24,783,894.97	7.72
22	002371	北方华创	23,026,012.20	7.18
23	300274	阳光电源	21,218,476.00	6.61
24	000733	振华科技	20,434,433.10	6.37
25	000858	五粮液	20,174,218.60	6.29
26	600893	航发动力	20,012,247.53	6.24
27	000009	中国宝安	19,733,007.60	6.15
28	002475	立讯精密	19,650,869.10	6.12
29	002938	鹏鼎控股	19,545,110.34	6.09
30	300759	康龙化成	18,948,701.32	5.90
31	300661	圣邦股份	18,905,893.68	5.89
32	601689	拓普集团	18,543,868.65	5.78
33	603005	晶方科技	18,325,133.64	5.71
34	300015	爱尔眼科	17,931,224.65	5.59

35	603501	韦尔股份	17,823,063.75	5.55
36	300433	蓝思科技	17,516,619.75	5.46
37	600110	诺德股份	17,502,528.28	5.45
38	002600	领益智造	16,429,569.49	5.12
39	600183	生益科技	16,338,001.57	5.09
40	000661	长春高新	16,281,299.00	5.07
41	300458	全志科技	15,937,612.64	4.97
42	300726	宏达电子	15,777,238.62	4.92
43	600703	三安光电	15,693,513.97	4.89
44	601888	中国中免	15,245,174.00	4.75
45	603348	文灿股份	14,980,894.10	4.67
46	002185	华天科技	14,822,896.13	4.62
47	002439	启明星辰	14,698,742.00	4.58
48	300782	卓胜微	14,177,106.80	4.42
49	300769	德方纳米	14,105,218.00	4.40
50	300122	智飞生物	14,028,400.51	4.37
51	000568	泸州老窖	13,711,675.00	4.27
52	002407	多氟多	13,639,231.79	4.25
53	688099	晶晨股份	13,217,799.35	4.12
54	300750	宁德时代	12,920,966.00	4.03
55	000977	浪潮信息	12,683,611.06	3.95
56	300059	东方财富	12,110,818.80	3.77
57	002241	歌尔股份	11,961,024.00	3.73
58	002493	荣盛石化	11,901,238.00	3.71
59	002463	沪电股份	11,830,310.66	3.69
60	688005	容百科技	11,122,593.36	3.47
61	300659	中孚信息	10,911,608.44	3.40
62	600276	恒瑞医药	10,905,643.12	3.40
63	300033	同花顺	10,774,642.00	3.36
64	605111	新洁能	10,624,852.40	3.31
65	603799	华友钴业	10,285,187.00	3.20
66	002108	沧州明珠	10,260,376.00	3.20
67	300390	天华超净	10,218,356.00	3.18
68	300432	富临精工	9,755,927.00	3.04
69	600600	青岛啤酒	9,603,505.20	2.99
70	600309	万华化学	9,517,358.00	2.97
71	002212	天融信	9,454,850.14	2.95
72	601318	中国平安	9,240,867.00	2.88

73	000725	京东方 A	9,096,000.00	2.83
74	300776	帝尔激光	8,664,108.00	2.70
75	300760	迈瑞医疗	8,401,191.00	2.62
76	600487	亨通光电	8,134,252.00	2.53
77	600570	恒生电子	8,032,723.11	2.50
78	002049	紫光国微	8,000,298.00	2.49
79	603659	璞泰来	7,864,340.00	2.45
80	600519	贵州茅台	7,664,147.00	2.39
81	688187	时代电气	7,637,880.35	2.38
82	300450	先导智能	7,396,248.00	2.30
83	002920	德赛西威	7,213,827.20	2.25
84	000301	东方盛虹	7,040,217.00	2.19
85	600104	上汽集团	6,915,343.00	2.15
86	000762	西藏矿业	6,797,436.00	2.12
87	688608	恒玄科技	6,771,129.03	2.11
88	002179	中航光电	6,683,500.00	2.08
89	002202	金风科技	6,619,605.00	2.06
90	600315	上海家化	6,589,216.00	2.05
91	688023	安恒信息	6,577,177.29	2.05

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	1,623,761,807.16
卖出股票收入（成交）总额	1,806,835,666.51

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	4,501,350.00	1.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,009,000.00	4.33
	其中：政策性金融债	10,009,000.00	4.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,510,350.00	6.28

### 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	210301	21 进出 01	100,000	10,009,000.00	4.33
2	019654	21 国债 06	45,000	4,501,350.00	1.95

### 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受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券中“21 进出 01（证券代码：210301）”的发行主体具有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对上述证券的投资决策程序

符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	148,027.85
2	应收证券清算款	393,005.53
3	应收股利	-
4	应收利息	285,065.71
5	应收申购款	41,662.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	867,761.89

### 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
4,764	34,142.73	494,895.41	0.30%	162,161,061.35	99.70%

### 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	7.46	0.0000%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月1日）基金份额总额	1,509,002,981.31
本报告期期初基金份额总额	322,969,542.11
本报告期基金总申购份额	44,736,679.67
减:本报告期基金总赎回份额	205,050,265.02
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	162,655,956.76

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人发生以下人事变动：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

### 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，本报告期内应支付审计费 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	
兴业证券	1	576,349,804.85	16.85%	536,751.62	17.08%	-
东吴证券	2	514,916,515.61	15.06%	471,280.84	14.99%	-
广发证券	1	401,429,597.23	11.74%	365,822.84	11.64%	-

长江证券	1	328,258,045.92	9.60%	299,141.17	9.52%	-
东方证券	3	320,233,724.53	9.36%	292,093.68	9.29%	-
中泰证券	2	256,412,877.11	7.50%	235,524.37	7.49%	-
天风证券	2	214,306,944.17	6.27%	199,583.41	6.35%	-
国信证券	2	200,897,731.47	5.87%	187,095.61	5.95%	-
申港证券	1	150,590,100.67	4.40%	137,233.26	4.37%	-
安信证券	1	93,943,100.96	2.75%	85,610.27	2.72%	-
世纪证券	1	91,672,450.00	2.68%	83,541.37	2.66%	-
中金公司	2	78,481,280.41	2.29%	71,780.50	2.28%	-
光大证券	2	70,972,206.96	2.08%	64,833.82	2.06%	-
申银万国	1	62,687,395.37	1.83%	58,379.67	1.86%	-
国元证券	1	58,572,699.90	1.71%	54,549.30	1.74%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证 券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证 券	2	-	-	-	-	-

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

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

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金新增交易单元 7 个，分别为东方证券、粤开证券、世纪证券和东亚前海证券交易单元；退租交易单元 2 个，分别为为国都证券和申港证券交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	7,002,690.90	91.28%	-	-	-	-
广发证券	580,587.63	7.57%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	88,660.75	1.16%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

申港证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证	-	-	-	-	-	-

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管理的基金 2020 年年度资产净值公告	公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 6 日
3	东吴基金管理有限公司关于参加平安银行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、中证信息网站	2021 年 1 月 8 日
4	东吴基金管理有限公司关于参加华宝证券有限责任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、中证信息网站	2021 年 1 月 12 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 15 日
6	东吴基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 20 日
7	东吴基金管理有限公司旗下基金 2020 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 1 月 21 日

		报、公司网站、中证信息网站	
8	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 22 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 23 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在北京植信基金销售有限公司的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、中证信息网站	2021 年 1 月 26 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在华瑞保险销售有限公司的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、中证信息网站	2021 年 1 月 26 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金海九州基金销售有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 27 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在光大证券股份有限公司的定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 27 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构、部分代	上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网	2021 年 2 月 3 日

	销机构开通转换业务的公告	站	
15	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 3 日
16	东吴基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 5 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 26 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金新增民生证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 2 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增弘业期货股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 10 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东方财富证券股份有限公司的定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 17 日

21	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 23 日
22	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 31 日
23	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 31 日
24	东吴基金管理有限公司关于暂停中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 1 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 2 日
26	东吴基金管理有限公司关于暂停上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 10 日
27	东吴基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 19 日
28	东吴基金管理有限公司旗下基金	中国证券报、上海证券	2021 年 4 月 21 日

	2021 年 1 季度报告提示性公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
29	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 21 日
30	东吴基金管理有限公司关于提升东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金价值线数值的公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 3 日
31	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 11 日
32	东吴基金管理有限公司旗下基金招募说明书更新的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 11 日
33	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 11 日
34	东吴基金管理有限公司关于恢复使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 16 日
35	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台恢复农行网银直连支付开户与签约业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信	2021 年 6 月 16 日

		息网站	
36	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年6月19日
37	东吴基金关于在公司直销开展赎回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、中证信息网站	2021年6月25日
38	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示	公司网站、中证信息网站	2021年6月25日
39	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构、开通定期定额业务的公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2021年6月26日
40	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、中证信息网站	2021年6月30日
41	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在深圳市金海九州基金销售有限公司的定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年6月30日
42	东吴基金管理有限公司管理的基金 2021 年半年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2021年7月1日
43	东吴基金管理有限公司关于终止	中国证券报、上海证券	2021年7月3日

	东吴基金手机 APP 服务及微信服务号交易功能的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
44	东吴基金管理有限公司关于在直销网上交易平台开展转换业务申购补差费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 5 日
45	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书及基金产品资料概要的补充提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 12 日
46	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 14 日
47	东吴基金管理有限公司关于参加鼎信汇金（北京）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、中证信息网站	2021 年 7 月 16 日
48	东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 年 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 20 日
49	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 20 日
50	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华融证券股份有限	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2021 年 7 月 22 日

	公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	报、公司网站、中证信息网站	
51	东吴基金管理有限公司关于参加国金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、中证信息网站	2021 年 7 月 24 日
52	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 27 日
53	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 27 日
54	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 27 日
55	东吴基金管理有限公司关于参加招商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、中证信息网站	2021 年 7 月 28 日
56	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	公司网站、中证信息网站	2021 年 7 月 30 日
57	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 8 月 9 日
58	东吴基金管理有限公司关于参加中国工商银行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、中证信息网站	2021 年 8 月 25 日

		息网站	
59	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 8 月 27 日
60	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	公司网站、中证信息网站	2021 年 8 月 27 日
61	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 10 月 27 日
62	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司网站、中证信息网站	2021 年 10 月 27 日
63	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 10 月 30 日
64	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华林证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 11 月 1 日
65	东吴基金管理有限公司关于参加国信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、中证信息网站	2021 年 11 月 24 日

66	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在渤海证券股份有限公司的定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年11月24日
67	东吴基金管理有限公司关于提升东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金价值线数值的公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2021年11月30日
68	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年12月7日
69	东吴基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年12月10日
70	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年12月20日
71	东吴基金管理有限公司关于平安银行股份有限公司申购补差费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年12月21日
72	东吴基金管理有限公司关于暂停杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021年12月24日

73	东吴基金管理有限公司关于参加交通银行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、中证信息网站	2021 年 12 月 31 日
----	---------------------------------	-----------------------------------	------------------

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20210108-20211231	60,992,329.56	0.00	200,000.00	60,792,329.56	37.37%

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 12.2 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新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴新趋势价值线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、报告期内东吴新趋势价值线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

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

### 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

2022 年 3 月 31 日