

# 东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 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：二〇二三年三月三十一日

## § 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 2023 年 3 月 28 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 2022 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.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<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 .....	67
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>76</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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴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	172,589,930.07 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	陈军	谷澍
-------	----	----

注：基金管理人于 2023 年 2 月 3 日发布法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为陈军先生。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-36,469,172.45	112,801,179.93	104,908,541.73
本期利润	-79,833,432.59	89,229,038.19	151,556,305.28
加权平均基金份额本期利润	-0.4779	0.4101	0.4072
本期加权平均净值利润率	-41.81%	36.90%	54.78%
本期基金份额净值增长率	-33.21%	42.92%	71.61%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-8,882,725.95	64,464,558.61	-43,793,604.69
期末可供分配基金份额利润	-0.0515	0.3963	-0.1356
期末基金资产净值	163,707,204.12	230,982,771.04	320,918,254.94
期末基金份额净值	0.9485	1.4201	0.9936
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-5.15%	42.01%	-0.64%

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	-6.56%	1.95%	0.93%	0.83%	-7.49%	1.12%
过去六个月	-27.11%	1.83%	-8.85%	0.71%	-18.26%	1.12%
过去一年	-33.21%	2.14%	-13.88%	0.83%	-19.33%	1.31%
过去三年	63.82%	1.95%	-2.68%	0.84%	66.50%	1.11%
过去五年	39.69%	1.76%	0.54%	0.84%	39.15%	0.92%
自基金合同生效起至今	-5.15%	1.61%	-6.45%	0.90%	1.30%	0.71%

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

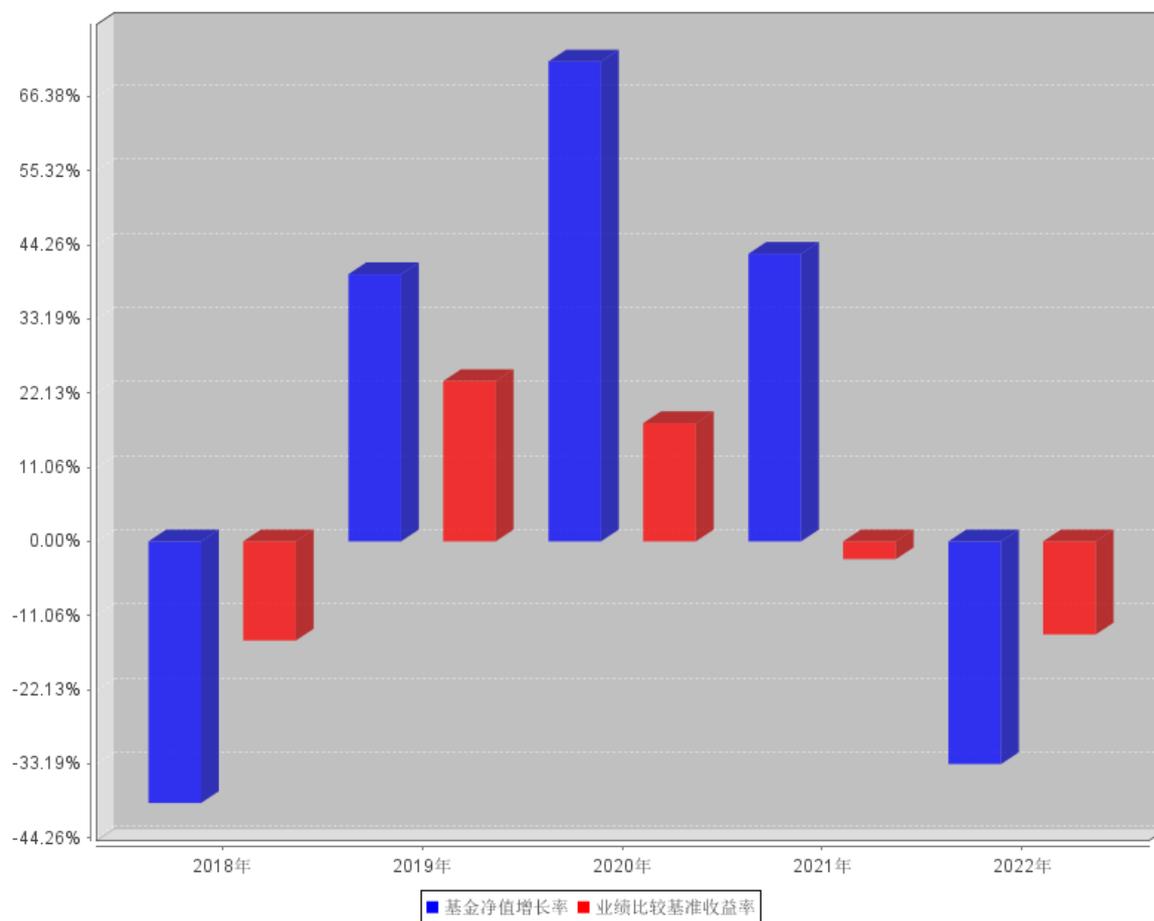
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、专户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 2022 年年末,公司整体资产管理规模为【268.19】亿元,其中公募基金【236.35】亿元,专户业务【31.84】亿元,子公司【2.48】亿元;旗下管理着【34】只公募基金(不含清盘中的基金),【19】只存续专户资产管理计划(不包含正在清盘中的专户),【8】项存续专项资产管理计划(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	2016 年 4 月 27 日	-	18 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，2020 年 4 月 1 日至 2022 年 12 月 30 日担任东吴价值成长双动力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，2022 年 1 月 25 日至今担任东吴新能源汽车股票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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。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

本基金管理人根据《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

本基金管理人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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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

2022 年上证指数下跌 15.13%，沪深 300 下跌 21.63%，创业板指下跌 29.37%。与历史比较，2022 年 A 股市场属于跌幅较大的一个年份。2022 年 A 股市场大幅下跌的核心原因，我们归结有以下两个因素：一是 A 股上市公司盈利增速处在下行周期；二是作为全球风险定价锚的美联储利率处在超预期上升周期，利率上行对股票市场特别是对成长股股价冲击很大。

2022 年初在稳增长预期背景下，我们对 A 股市场春季躁动行情抱有希望，因此年初本基金维持较高仓位。但由于 1 季度 A 股市场风格偏向于稳增长风格，不利成长股风格，1 季度本基金是以新能源汽车电动化和智能化以及科技方向的成长股作为重点配置，所以 1 季度本基金净值出现一定幅度的回撤。但是 2 季度随着景气产业复苏，本基金持有的新能源汽车电动化和智能化以及

科技方向出现快速反弹，基金净值也出现明显回升。但是 3 季度以来 A 股市场回调幅度超出我们的预期，特别是本基金重点配置的新能源汽车以及科技方向出现较大幅度的回调，因此下半年本基金净值再次出现回调。但是临近年底，随着管控优化以及稳增长信号确立，我们认为，2023 年科技领域有望迎来新一轮产业周期，A 股市场科技领域可能存在较大投资机会。因此，22 年底本基金加大科技领域布局，包括电子半导体、计算机信创以及与智能驾驶等科技领域的布局。

#### 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 0.9485 元；本报告期基金份额净值增长率为-33.21%，业绩比较基准收益率为-13.88%。

#### 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，2023 年中国经济有望迎来一轮复苏。国内经济自 2021 年下半年呈现减速迹象，并在 2022 年受大环境影响因素冲击，国内 GDP 增速从 2022 年一季度的 4.8%降至 2022 年四季度的 2.9%。展望 2023 年，经济修复的确定性有望较高。2023 年与 2022 年相比，经济的驱动力可能发生明显切换，2022 年国内经济是靠出口和基建支撑，但受大环境因素和房住不炒调控政策影响，国内消费和地产承压。2023 年国内经济驱动力可能切换到国内消费和地产。当前，线下各类消费场景也逐步修复，2023 年消费对经济的作用也有望从拖累项转为驱动项。地产领域，此前在房住不炒的基调下，从房地产投融资到销售各方面限制颇多，后经历保交楼、房地产企业三支箭等政策拐点先后出现，预计 2023 年房地产情况有望优于 2022 年。整体来看，消费复苏叠加地产修复，大概率可以对冲出口下滑的影响，2023 年国内经济有望适度修复。但复苏的高度目前来看可能存在不确定性，综合考虑国内外环节，2023 年更有可能是弱复苏之年。

政策层面，2022 年国内和海外呈现比较明显的分化，2023 年国内外货币政策可能由分歧逐渐走向一致。国内货币政策在 2022 年整体偏宽松，全年实施了两次降准，1 年期 LPR 利率从 3.8%降至 3.65%，5 年期 LPR 利率从 4.65%降至 4.3%。展望 2023 年，我们认为国内通胀压力可能相对较小，而海外通胀也已呈现明显的下行趋势，预计国内 2023 年大概率继续保持中性偏宽松的货币政策格局。信用传导方面，由于国内还是有稳经济的诉求，预计 2023 年国内信用环境也有望维持偏宽。海外方面，以美联储为代表的发达国家央行有望结束加息周期。美联储自 2022 年 3 月开启了一轮史无前例的快速加息周期，至 2023 年 2 月 1 日，不到一年的时间内加息 8 次，将基准利率上限从 0.25%加至 4.75%。美国通胀是美联储加息的核心影响因素，当前俄乌冲突对全球大宗商品的影响逐渐弱化，全球大宗价格进入下行区间，美国 CPI 从 22 年 6 月的 9.1%下行至 22 年 12 月的 6.5%，呈现通胀加速回落态势。美联储本轮加息周期有望在 2023 年上半年结束，甚至不排除 2023 年下半年美联储转而降息的可能性。

资本市场方面，我们认为 2023 年市场有望明显优于 2022 年，市场向上机会可能大于向下风险。2023 年的 A 股有望迎来基本面和流动性的双轮驱动。一是国内经济环比修复，企业盈利逐级修复。二是海外美联储有望在上半年结束加息，国内流动性有望继续维持中性偏宽，这对权益市场来说是个相对有利的组合。因此站在当前时点，我们认为，A 股市场中长期投资价值有望凸显。

从投资主线看，2023 年我们可能重点关注 A 股市场科技领域投资机会，认为 2023 年科技行业有望迎来新一轮产业周期，并重点关注以下三大方向：

(1) 电子半导体。2022 年 A 股市场电子和半导体行业跌幅居前，但我们认为 2023 年 A 股市场电子半导体行业投资机会或已渐行渐近。本轮我国半导体行业景气相对高点在 2021 年 3 季度，一般半导体行业下行周期在 1-2 年，我们预计本轮半导体下行周期相对底部可能在 2023 年年中左右。从历史经验看，半导体指数或者半导体公司股价往往领先半导体行业周期底部 1-2 季度，我们判断，当前电子 A 股半导体行业股价可能处于相对底部区域，我们关注未来 2-3 年 A 股电子半导体行业投资机会，特别是与汽车智能化相关的电子半导体投资机会。

(2) 计算机信创和智能驾驶。我们判断，2023 年及之后我国信创产业有望从 2019-2021 年培育期进入成长期，即进入 1-N 的过程，行业有望呈现快速增长趋势。我们认为，2023 年汽车智能化有望进入快速成长期，从而迎来业绩和估值戴维斯双击投资机会。2022 年国内具有 L2+ 以上智能化汽车渗透率有望超过 10% 以上，从新兴产业发展规律看，2023 年智能化汽车渗透率有望进一步提升，汽车智能化行业有望从培育期进入快速成长周期，并且单车智能化产品价值量显著提升，未来 3-5 年有望是 A 股汽车智能化产业链较好的关注时期。

(3) AI 人工智能。从历史经验看，科技领域重大投资机会往往来自于杀手级产品的诞生，而 AI 人工智能发展有利于硬件和软件科技领域重大的突破，特别是近期比较火爆的 chatGPT 推出，有望加速 AI 人工智能应用落地，如元宇宙、人形机器人等人工智能场景的落地，从而有望驱动科技领域硬件和软件快速发展。在此过程，势必可能会诞生一批优秀公司。未来 3-5 年内，我们将持续跟踪 AI 人工智能产业发展趋势，积极把握其中投资机会。

我们认为，2023 年科技领域有望迎来新一轮产业周期，A 股市场科技领域可能存在较多投资机会，东吴新趋势将致力积极把握科技领域新一轮上行周期可能带来的投资机会，力争为投资者财富保值增值。

#### 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，成员由分管运营的公司常务副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部）负责人、合规风控部负

责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，分管运营的公司常务副总经理担任基金资产估值委员会主席，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。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；基金会计人员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。

#### **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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(2023)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	<p>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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p>
其他信息	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>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>

	<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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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	俞明吉
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	2023年3月30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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,316,178.84	2,579,911.90
结算备付金		816,387.81	1,625,727.79
存出保证金		111,355.65	148,027.85
交易性金融资产	7.4.7.2	153,041,685.17	227,420,658.89
其中：股票投资		153,041,685.17	212,910,308.89
基金投资		-	-
债券投资		-	14,510,350.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		158,086.95	393,005.53
应收股利		-	-
应收申购款		23,808.78	41,662.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	285,065.71
资产总计		164,467,503.20	232,494,060.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		92,625.76	383,990.19
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		36,433.39	49,241.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	631,239.93	1,078,057.55
负债合计		760,299.08	1,511,289.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	172,589,930.07	162,655,956.76
未分配利润	7.4.7.8	-8,882,725.95	68,326,814.28
净资产合计		163,707,204.12	230,982,771.04
负债和净资产总计		164,467,503.20	232,494,060.47

注：(1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9485 元，基金份额总额 172,589,930.07 份。

(2) 比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-79,142,101.50	95,338,086.59
1. 利息收入		54,001.44	348,019.86
其中：存款利息收入	7.4.7.9	54,001.44	51,749.96
债券利息收入		-	296,269.90
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）		-35,938,391.20	118,373,959.98
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-36,752,977.22	117,419,725.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	243,683.70	204,518.42
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-

股利收益	7.4.7.14	570,902.32	749,715.71
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-43,364,260.14	-23,572,141.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	106,548.40	188,248.49
<b>减：二、营业总支出</b>		691,331.09	6,109,048.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	478,009.21	605,114.41
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.29	0.17
8. 其他费用	7.4.7.18	213,321.59	5,503,933.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-79,833,432.59	89,229,038.19
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-79,833,432.59	89,229,038.19
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-79,833,432.59	89,229,038.19

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	162,655,956.76	68,326,814.28	230,982,771.04

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	162,655,956.76	68,326,814.28	230,982,771.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,933,973.31	-77,209,540.23	-67,275,566.92
（一）、综合收益总额	-	-79,833,432.59	-79,833,432.59
（二）、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）	9,933,973.31	2,623,892.36	12,557,865.67
其中：1.基金申购款	51,828,413.14	8,774,305.79	60,602,718.93
2.基金赎回款	-41,894,439.83	-6,150,413.43	-48,044,853.26
（三）、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）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	172,589,930.07	-8,882,725.95	163,707,204.12
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	322,969,542.11	-2,051,287.17	320,918,254.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	322,969,542.11	-2,051,287.17	320,918,254.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-160,313,585.35	70,378,101.45	-89,935,483.90
（一）、综合收益总额	-	89,229,038.19	89,229,038.19
（二）、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
（三）、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）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	162,655,956.76	68,326,814.28	230,982,771.04

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>陈军</u>	<u>陈军</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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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

##### 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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区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)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用,计入投资收益;

债券投资和资产支持证券投资持有期间,按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益,在证券实际持有期内逐日计提;

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认,并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账,同时转出已确认的公允价值变动收益;

(3)股利收益于除息日确认,并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账;

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认,并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账,同时转出已确认的公允价值变动收益;

(5)买入返售金融资产收入,按实际利率法确认利息收入,在回购期内逐日计提;

(6)公允价值变动收益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;

(7)其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金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予以确认。

#### 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 等费用按照权责发生制原则,在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,579,911.90 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 654.36 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,580,566.26 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,625,727.79 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 731.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,626,459.39 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 148,027.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 66.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 148,094.45 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 285,065.71 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 654.36 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 731.60 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 66.60 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 283,613.15 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 227,420,658.89 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 283,613.15 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 227,704,272.04 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基

金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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	10,316,178.84	2,579,911.90
等于：本金	10,314,235.54	2,579,911.90
加：应计利息	1,943.30	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	10,316,178.84	2,579,911.90

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	166,874,431.96	-	153,041,685.17	-13,832,746.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	166,874,431.96	-	153,041,685.17	-13,832,746.79

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	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	-1,590.90
	银行间市场	10,011,240.00	-	10,009,000.00	-2,240.00
	合计	14,514,180.90	-	14,510,350.00	-3,830.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	197,889,145.54	-	227,420,658.89	29,531,513.35	

#### 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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	285,065.71
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	285,065.71

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	145.25	285.25
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	452,094.68	888,772.30
其中：交易所市场	452,094.68	888,422.30

银行间市场	-	350.00
应付利息	-	-
应付审计费	50,000.00	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	631,239.93	1,078,057.55

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,655,956.76	162,655,956.76
本期申购	51,828,413.14	51,828,413.14
本期赎回（以“-”号填列）	-41,894,439.83	-41,894,439.83
- 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	172,589,930.07	172,589,930.07

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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
本期期初	64,464,558.61	3,862,255.67	68,326,814.28
本期利润	-36,469,172.45	-43,364,260.14	-79,833,432.59
本期基金份额交易产生的变动数	3,096,746.07	-472,853.71	2,623,892.36
其中：基金申购款	17,383,938.07	-8,609,632.28	8,774,305.79
基金赎回款	-14,287,192.00	8,136,778.57	-6,150,413.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,092,132.23	-39,974,858.18	-8,882,725.95

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
	活期存款利息收入	41,002.17

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	11,425.40	19,766.45
其他	1,573.87	2,525.37
合计	54,001.44	51,749.96

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
卖出股票成交总额	904,849,701.59	1,806,835,666.51
减：卖出股票成本总额	938,849,186.17	1,689,415,940.66
减：交易费用	2,753,492.64	-
买卖股票差价收入	-36,752,977.22	117,419,725.85

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	166,766.67	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	76,917.03	204,518.42
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	243,683.70	204,518.42

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	25,364,827.71	23,610,874.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	24,836,280.90	22,968,690.00
减：应计利息总额	451,446.00	437,666.39
减：交易费用	183.78	-

买卖债券差价收入	76,917.03	204,518.42
----------	-----------	------------

#### 7.4.7.12 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。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

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 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	570,902.32	749,715.71
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	570,902.32	749,715.71

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-43,364,260.14	-23,572,141.74
——股票投资	-43,368,091.04	-23,536,330.84
——债券投资	3,830.90	-35,810.90
——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	-43,364,260.14	-23,572,141.74

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	105,805.15	187,212.21
基金转换费收入	743.25	1,036.28

其他收入	-	-
合计	106,548.40	188,248.49

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划费	6,075.59	7,498.62
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,246.00	1,244.00
交易费用	-	5,279,191.20
合计	213,321.59	5,503,933.82

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	275,441,038.11	15.17%	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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	335,161.30	16.67%	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 2022年1月1日至2022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	255,911.95	15.26%	105,902.55	23.42%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	478,009.21	605,114.41

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

本基金本报告期及上年度可比区间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。

#### 7.4.10.5.3 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	10,316,178.84	41,002.17	2,579,911.90	29,458.14

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2022 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	受限期	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
688506	百利天恒	2022 年 12 月 28 日	6 个月	新股流通受限	24.70	24.70	4,798	118,510.60	118,510.60	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.93	25.28	3,707	81,294.51	93,712.96	-
688141	杰华特	2022 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	38.26	43.89	2,038	77,973.88	89,447.82	-
688410	山外山	2022 年 12 月 19 日	6 个月	新股流通受限	32.30	23.79	1,860	60,078.00	44,249.40	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	180	5,884.20	15,829.20	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	69.68	226	7,604.90	15,747.68	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	6.01	2,070	7,907.40	12,440.70	-
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股流通受限	58.00	86.49	138	8,004.00	11,935.62	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股流通受限	237.50	176.97	61	14,487.50	10,795.17	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	8.48	12.99	795	6,741.60	10,327.05	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	7.53	1,341	6,705.00	10,097.73	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	119.88	175.78	51	6,113.88	8,964.78	-
301308	江波龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新股流通受限	55.67	56.72	151	8,406.17	8,564.72	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股流通受限	50.88	66.20	128	6,512.64	8,473.60	-
301330	熵基科技	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股流通受限	43.32	31.31	240	10,396.80	7,514.40	-
301363	美好医疗	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新股流通受限	30.66	37.85	194	5,948.04	7,342.90	-

301152	天力 锂能	2022年8月 19日	6个 月	新股流 通受限	57.00	46.64	154	8,778.00	7,182.56	-
301338	凯格 精机	2022年8月 8日	6个 月	新股流 通受限	46.33	48.99	142	6,578.86	6,956.58	-
301361	众智 科技	2022年11 月8日	6个 月	新股流 通受限	26.44	20.96	316	8,355.04	6,623.36	-
301121	紫建 电子	2022年8月 1日	6个 月	新股流 通受限	61.07	49.77	131	8,000.17	6,519.87	-
301283	聚胶 股份	2022年8月 26日	6个 月	新股流 通受限	52.69	51.41	123	6,480.87	6,323.43	-
301396	宏景 科技	2022年11 月4日	6个 月	新股流 通受限	40.13	31.90	191	7,664.83	6,092.90	-
301328	维峰 电子	2022年8月 30日	6个 月	新股流 通受限	78.80	76.96	77	6,067.60	5,925.92	-
301306	西测 测试	2022年7月 19日	6个 月	新股流 通受限	43.23	42.29	135	5,836.05	5,709.15	-
301227	森鹰 窗业	2022年9月 16日	6个 月	新股流 通受限	38.25	29.49	190	7,267.50	5,603.10	-
301171	易点 天下	2022年8月 10日	6个 月	新股流 通受限	18.18	17.72	315	5,726.70	5,581.80	-
301398	星源 卓镁	2022年12 月8日	6个 月	新股流 通受限	34.40	28.94	192	6,604.80	5,556.48	-
301270	汉仪 股份	2022年8月 19日	6个 月	新股流 通受限	25.68	28.37	195	5,007.60	5,532.15	-
301132	满坤 科技	2022年8月 3日	6个 月	新股流 通受限	26.80	24.48	222	5,949.60	5,434.56	-
301313	凡拓 数创	2022年9月 22日	6个 月	新股流 通受限	25.25	29.14	186	4,696.50	5,420.04	-
301290	东星 医疗	2022年11 月23日	6个 月	新股流 通受限	44.09	35.13	154	6,789.86	5,410.02	-
301197	工大 科雅	2022年7月 29日	6个 月	新股流 通受限	25.50	20.08	266	6,783.00	5,341.28	-
301139	元道 通信	2022年6月 30日	6个 月	新股流 通受限	38.46	25.31	210	8,076.60	5,315.10	-
301326	捷邦 科技	2022年9月 9日	6个 月	新股流 通受限	51.72	36.62	145	7,499.40	5,309.90	-
301335	天元 宠物	2022年11 月11日	6个 月	新股流 通受限	49.98	33.82	157	7,846.86	5,309.74	-
301233	盛帮 股份	2022年6月 24日	6个 月	新股流 通受限	41.52	34.30	154	6,394.08	5,282.20	-
301231	荣信 文化	2022年8月 31日	6个 月	新股流 通受限	25.49	20.38	255	6,499.95	5,196.90	-
301277	新天	2022年11	6个	新股流	27.00	25.78	200	5,400.00	5,156.00	-

	地	月 9 日	月	通受限						
301316	慧博 云通	2022 年 9 月 29 日	6 个 月	新股流 通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301280	珠城 科技	2022 年 12 月 19 日	6 个 月	新股流 通受限	67.40	44.80	112	7,548.80	5,017.60	-
301339	通行 宝	2022 年 9 月 2 日	6 个 月	新股流 通受限	18.78	15.59	321	6,028.38	5,004.39	-
301356	天振 股份	2022 年 11 月 3 日	6 个 月	新股流 通受限	63.00	43.33	111	6,993.00	4,809.63	-
301319	唯特 偶	2022 年 9 月 22 日	6 个 月	新股流 通受限	47.75	53.27	87	4,154.25	4,634.49	-
301368	丰立 智能	2022 年 12 月 7 日	6 个 月	新股流 通受限	22.33	18.52	247	5,515.51	4,574.44	-
301365	矩阵 股份	2022 年 11 月 14 日	6 个 月	新股流 通受限	34.72	23.87	191	6,631.52	4,559.17	-
301349	信德 新材	2022 年 8 月 30 日	6 个 月	新股流 通受限	138.88	103.52	40	5,555.20	4,140.80	-
301265	华新 环保	2022 年 12 月 8 日	6 个 月	新股流 通受限	13.28	11.40	328	4,355.84	3,739.20	-
301388	欣灵 电气	2022 年 10 月 26 日	6 个 月	新股流 通受限	25.88	21.60	172	4,451.36	3,715.20	-
301276	嘉曼 服饰	2022 年 9 月 1 日	6 个 月	新股流 通受限	40.66	22.61	144	5,855.04	3,255.84	-
301309	万得 凯	2022 年 9 月 8 日	6 个 月	新股流 通受限	39.00	24.46	110	4,290.00	2,690.60	-

#### 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 2022 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 2022 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 2022 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	0.00
A-1 以下	-	0.00
未评级	-	14,510,350.00
合计	-	14,510,350.00

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 2022 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	10,316,178.84	-	-	-	-	-	10,316,178.84
结算备付金	816,387.81	-	-	-	-	-	816,387.81
存出保证金	111,355.65	-	-	-	-	-	111,355.65
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	153,041,685.17	153,041,685.17
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	158,086.95	158,086.95
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	23,808.78	23,808.78
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,243,922.30	-	-	-	-	153,223,580.90	164,467,503.20
负债							
卖出回购金	-	-	-	-	-	-	-

融资产款							
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	92,625.76	92,625.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	36,433.39	36,433.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	631,239.93	631,239.93
负债总计	-	-	-	-	-	760,299.08	760,299.08
利率敏感度缺口	11,243,922.30	-	-	-	-	-152,463,281.82	163,707,204.12
上年度末 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	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	393,005.53	393,005.53
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	41,662.80	41,662.80
其他资产	-	-	-	-	-	285,065.71	285,065.71
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	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	1,078,057.55	1,078,057.55
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

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	-	8,165.93
	基准利率增加 25 个基点	-	-8,156.34

注：本报告期末本基金未持有交易性债券投资，计息资产仅包括银行活期存款、结算备付金、存出保证金，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	153,041,685.17	93.49	212,910,308.89	92.18
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	153,041,685.17	93.49	212,910,308.89	92.18

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	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-2,946,729.67	-3,487,839.84
	2. 业绩基准下跌 5%	-14,733,648.37	-17,439,199.21
3. 业绩基准下跌 10%	-29,467,296.74	-34,878,398.43	

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输

入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	152,389,665.56	211,045,873.80
第二层次	118,510.60	14,743,705.63
第三层次	533,509.01	1,631,079.46
合计	153,041,685.17	227,420,658.89

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			合计
	交易性金融资产			
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	1,631,079.46	-	1,631,079.46
当期购买	-	526,469.69	-	526,469.69
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	1,631,079.46	-	1,631,079.46
当期利得或损失总额	-	7,039.32	-	7,039.32
其中：计入损益的利得或损失	-	7,039.32	-	7,039.32
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	533,509.01	-	533,509.01
期末仍持有的第三层次金融资产	-	7,039.32	-	7,039.32

计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益				
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	3,043,072.14	-	3,043,072.14
当期购买	-	475,264.76	-	475,264.76
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	3,043,072.14	-	3,043,072.14
当期利得或损失总额	-	1,155,814.70	-	1,155,814.70
其中：计入损益的利得或损失	-	1,155,814.70	-	1,155,814.70
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	1,631,079.46	-	1,631,079.46
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,155,814.70	-	1,155,814.70

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	533,509.01	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,631,079.46	平均价格亚式期权模型	波动率	0.3138-2.2471	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### **7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### **7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **7.4.15.1 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。

##### **7.4.15.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### **7.4.15.3 财务报表的批准**

本财务报表已于 2023 年 3 月 30 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	153,041,685.17	93.05
	其中：股票	153,041,685.17	93.05
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	11,132,566.65	6.77
8	其他各项资产	293,251.38	0.18
9	合计	164,467,503.20	100.00

### 8.2 报告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	116,513,887.56	71.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,465,343.36	22.27
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	20,595.37	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	12,440.70	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	24,221.28	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,196.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	153,041,685.17	93.49

### 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	603986	兆易创新	150,000	15,370,500.00	9.39
2	603501	韦尔股份	196,000	15,109,640.00	9.23
3	603005	晶方科技	790,000	14,654,500.00	8.95
4	002920	德赛西威	130,000	13,694,200.00	8.37
5	300496	中科创达	115,000	11,534,500.00	7.05
6	600745	闻泰科技	180,000	9,464,400.00	5.78
7	300223	北京君正	133,000	9,368,520.00	5.72
8	002371	北方华创	35,000	7,885,500.00	4.82
9	300782	卓胜微	68,000	7,772,400.00	4.75
10	600536	中国软件	130,000	7,582,900.00	4.63
11	688111	金山办公	25,000	6,612,250.00	4.04
12	002906	华阳集团	160,000	5,315,200.00	3.25
13	600570	恒生电子	120,000	4,855,200.00	2.97
14	300260	新莱应材	70,000	4,697,000.00	2.87
15	300327	中颖电子	130,000	4,598,100.00	2.81
16	688508	芯朋微	50,000	3,240,500.00	1.98
17	603893	瑞芯微	40,000	2,752,400.00	1.68
18	688409	富创精密	25,000	2,702,750.00	1.65
19	002475	立讯精密	80,000	2,540,000.00	1.55
20	600588	用友网络	80,000	1,933,600.00	1.18
21	688052	纳芯微	2,000	635,200.00	0.39
22	688506	百利天恒	4,798	118,510.60	0.07
23	688400	凌云光	3,707	93,712.96	0.06
24	688141	杰华特	2,038	89,447.82	0.05
25	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
26	688410	C山外山	1,860	44,249.40	0.03
27	301269	华大九天	180	15,829.20	0.01

28	301239	普瑞眼科	226	15,747.68	0.01
29	301175	中科环保	2,070	12,440.70	0.01
30	301095	广立微	138	11,935.62	0.01
31	301327	华宝新能	61	10,795.17	0.01
32	301297	富乐德	795	10,327.05	0.01
33	301301	川宁生物	1,341	10,097.73	0.01
34	301367	怡和嘉业	51	8,964.78	0.01
35	301308	江波龙	151	8,564.72	0.01
36	301267	华夏眼科	128	8,473.60	0.01
37	301330	熵基科技	240	7,514.40	0.00
38	301363	美好医疗	194	7,342.90	0.00
39	301152	天力锂能	154	7,182.56	0.00
40	301338	凯格精机	142	6,956.58	0.00
41	301361	众智科技	316	6,623.36	0.00
42	301121	紫建电子	131	6,519.87	0.00
43	301283	聚胶股份	123	6,323.43	0.00
44	301396	宏景科技	191	6,092.90	0.00
45	301328	维峰电子	77	5,925.92	0.00
46	301306	西测测试	135	5,709.15	0.00
47	301227	森鹰窗业	190	5,603.10	0.00
48	301171	易点天下	315	5,581.80	0.00
49	301398	星源卓镁	192	5,556.48	0.00
50	301270	汉仪股份	195	5,532.15	0.00
51	301132	满坤科技	222	5,434.56	0.00
52	301313	凡拓数创	186	5,420.04	0.00
53	301290	东星医疗	154	5,410.02	0.00
54	301197	工大科雅	266	5,341.28	0.00
55	301139	元道通信	210	5,315.10	0.00
56	301326	捷邦科技	145	5,309.90	0.00
57	301335	天元宠物	157	5,309.74	0.00
58	301233	盛帮股份	154	5,282.20	0.00
59	301231	荣信文化	255	5,196.90	0.00
60	301277	新天地	200	5,156.00	0.00
61	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
62	301280	珠城科技	112	5,017.60	0.00
63	301339	通行宝	321	5,004.39	0.00
64	301356	天振股份	111	4,809.63	0.00
65	301319	唯特偶	87	4,634.49	0.00
66	301368	丰立智能	247	4,574.44	0.00

67	301365	矩阵股份	191	4,559.17	0.00
68	301349	信德新材	40	4,140.80	0.00
69	301265	华新环保	328	3,739.20	0.00
70	301388	欣灵电气	172	3,715.20	0.00
71	301276	嘉曼服饰	144	3,255.84	0.00
72	301309	万得凯	110	2,690.60	0.00
73	002241	歌尔股份	100	1,683.00	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	002240	盛新锂能	48,748,624.78	21.10
2	300496	中科创达	40,034,402.29	17.33
3	002371	北方华创	37,855,921.00	16.39
4	002738	中矿资源	37,199,460.56	16.10
5	002709	天赐材料	36,662,534.68	15.87
6	603501	韦尔股份	35,669,420.16	15.44
7	300223	北京君正	33,755,239.00	14.61
8	603986	兆易创新	29,664,477.23	12.84
9	002756	永兴材料	28,770,154.08	12.46
10	002906	华阳集团	26,713,383.00	11.57
11	600536	中国软件	26,344,324.20	11.41
12	002475	立讯精密	25,156,461.96	10.89
13	603659	璞泰来	24,632,587.00	10.66
14	603305	旭升集团	23,809,184.35	10.31
15	300750	宁德时代	23,566,959.00	10.20
16	002466	天齐锂业	20,649,284.78	8.94
17	603005	晶方科技	20,330,034.66	8.80
18	600745	闻泰科技	18,469,678.10	8.00
19	002812	恩捷股份	16,667,348.00	7.22
20	601689	拓普集团	16,324,926.00	7.07
21	688187	时代电气	15,765,207.67	6.83
22	002920	德赛西威	15,437,589.76	6.68
23	300014	亿纬锂能	14,201,612.00	6.15
24	603290	斯达半导	13,808,155.02	5.98

25	600703	三安光电	13,540,020.00	5.86
26	600584	长电科技	13,531,872.00	5.86
27	688111	金山办公	12,362,491.70	5.35
28	600588	用友网络	10,775,550.20	4.67
29	002460	赣锋锂业	10,672,080.00	4.62
30	601012	隆基绿能	10,486,273.00	4.54
31	600570	恒生电子	10,306,378.75	4.46
32	300782	卓胜微	9,728,027.80	4.21
33	600460	士兰微	9,494,744.20	4.11
34	002624	完美世界	9,440,604.00	4.09
35	300659	中孚信息	9,383,002.00	4.06
36	300073	当升科技	8,650,920.00	3.75
37	300373	扬杰科技	8,499,130.50	3.68
38	002594	比亚迪	8,267,663.00	3.58
39	601633	长城汽车	8,180,811.00	3.54
40	002156	通富微电	6,968,502.65	3.02
41	002938	鹏鼎控股	6,587,460.00	2.85
42	603893	瑞芯微	6,005,649.20	2.60
43	002192	融捷股份	5,994,369.00	2.60
44	002036	联创电子	5,860,271.00	2.54
45	688012	中微公司	5,612,830.08	2.43
46	300260	新莱应材	5,419,181.00	2.35
47	605111	新洁能	5,384,272.00	2.33
48	002368	太极股份	5,296,229.00	2.29
49	300661	圣邦股份	5,064,665.00	2.19
50	002405	四维图新	4,998,457.00	2.16
51	002241	歌尔股份	4,887,227.00	2.12
52	300327	中颖电子	4,880,324.00	2.11
53	300390	天华超净	4,822,695.00	2.09
54	688123	聚辰股份	4,776,528.71	2.07
55	300413	芒果超媒	4,648,937.00	2.01

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	002240	盛新锂能	45,772,110.00	19.82
2	002709	天赐材料	42,016,907.78	18.19
3	002738	中矿资源	36,487,652.80	15.80
4	603659	璞泰来	33,668,758.17	14.58
5	300750	宁德时代	31,998,371.40	13.85
6	002756	永兴材料	31,232,224.17	13.52
7	603305	旭升集团	30,784,018.23	13.33
8	002466	天齐锂业	29,254,870.96	12.67
9	002371	北方华创	28,863,051.50	12.50
10	002475	立讯精密	26,913,584.86	11.65
11	300223	北京君正	26,637,710.84	11.53
12	002460	赣锋锂业	26,406,800.20	11.43
13	300496	中科创达	25,658,215.00	11.11
14	603501	韦尔股份	23,375,952.66	10.12
15	002906	华阳集团	22,839,432.67	9.89
16	601689	拓普集团	22,044,362.48	9.54
17	002812	恩捷股份	21,594,756.10	9.35
18	002241	歌尔股份	18,261,917.39	7.91
19	600703	三安光电	18,209,528.00	7.88
20	600536	中国软件	17,264,695.20	7.47
21	603986	兆易创新	17,229,931.16	7.46
22	002624	完美世界	17,222,449.00	7.46
23	688187	时代电气	15,979,789.68	6.92
24	603005	晶方科技	14,820,847.90	6.42
25	603290	斯达半导	14,572,999.92	6.31
26	300014	亿纬锂能	14,527,921.58	6.29
27	002920	德赛西威	13,942,851.00	6.04
28	600584	长电科技	13,417,961.00	5.81
29	002938	鹏鼎控股	13,049,714.17	5.65
30	601012	隆基绿能	10,328,045.40	4.47
31	300659	中孚信息	9,718,372.00	4.21
32	600460	士兰微	8,962,453.00	3.88
33	300373	扬杰科技	8,461,612.05	3.66
34	300073	当升科技	8,448,251.00	3.66

35	601633	长城汽车	8,287,840.00	3.59
36	600745	闻泰科技	8,283,655.75	3.59
37	002594	比亚迪	8,234,941.00	3.57
38	600588	用友网络	8,163,476.00	3.53
39	002156	通富微电	6,915,068.76	2.99
40	002036	联创电子	6,908,873.00	2.99
41	600570	恒生电子	6,588,129.58	2.85
42	002049	紫光国微	5,989,334.00	2.59
43	002192	融捷股份	5,505,729.00	2.38
44	605111	新洁能	5,505,264.40	2.38
45	688012	中微公司	5,334,687.99	2.31
46	300661	圣邦股份	5,269,380.50	2.28
47	603799	华友钴业	5,261,109.00	2.28
48	002368	太极股份	5,018,624.00	2.17
49	688111	金山办公	5,002,449.88	2.17
50	000792	盐湖股份	4,793,906.00	2.08
51	688123	聚辰股份	4,633,227.16	2.01

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	922,348,653.49
卖出股票收入（成交）总额	904,849,701.59

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 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 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 基金投资的前十名股票是否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	111,355.65
2	应收清算款	158,086.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,808.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,251.38

### 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
4,890	35,294.46	10,523,172.27	6.10%	162,066,757.80	93.90%

### 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	3,921.31	0.0023%

### 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、基金投资和研发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	162,655,956.76
本报告期基金总申购份额	51,828,413.14
减:本报告期基金总赎回份额	41,894,439.83
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	172,589,930.07

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、2022 年 9 月 1 日，袁勇志先生不再担任公司独立董事一职，聘任袁建新为公司第四届董事会独立董事；聘任冷强先生为第四届监事会职工监事。

2、2022 年 9 月 9 日，聘任公司总经理邓晖先生兼任公司财务负责人，徐明先生不再担任公司副总经理。

3、2022 年 12 月 6 日，邓晖先生不再担任公司董事、总经理兼财务负责人，聘任公司常务副总经理陈军先生担任公司第四届董事会董事、代任公司总经理。

本报告期内基金托管人发生以下人事变动：

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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 50000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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	329,618,446.90	18.15%	302,264.72	18.02%	-
长江证券	1	316,289,816.97	17.42%	291,337.06	17.37%	-
东吴证券	2	275,441,038.11	15.17%	255,911.95	15.26%	-
中泰证券	2	162,825,739.62	8.97%	150,280.67	8.96%	-
广发证券	1	134,458,454.80	7.40%	123,877.13	7.38%	-
兴业证券	1	122,280,739.10	6.73%	113,879.65	6.79%	-
国元证券	1	110,658,682.92	6.09%	103,057.35	6.14%	-
世纪证券	1	83,284,839.45	4.59%	76,729.96	4.57%	-
国海证券	1	78,337,323.64	4.31%	72,954.31	4.35%	-
东方证券	3	68,303,887.66	3.76%	63,100.40	3.76%	-
招商证券	1	61,778,566.38	3.40%	56,418.60	3.36%	-
粤开证券	2	40,892,883.90	2.25%	38,084.52	2.27%	-
安信证券	2	19,766,242.48	1.09%	18,142.86	1.08%	-
国信证券	2	12,229,813.02	0.67%	11,389.18	0.68%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中金财富证 券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证 券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

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

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

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金退租交易单元 9 个，分别为华泰证券 1 个、国信证券 1 个、申港证券 1 个、甬兴证券 2 个、长城证券 2 个、方正证券 1 个和平安证券 1 个交易单元。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	335,161.30	16.67%	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	172,996.00	8.61%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	1,502,100.00	74.72%	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 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 2021 年年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金和私募资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022 年 1 月 1 日
3	东吴基金管理有限公司关于终止科地瑞富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2022 年 1 月 12 日
4	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 21 日
5	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 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、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 24 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海银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	2022 年 2 月 28 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加广发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	2022 年 3 月 25 日

8	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 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	2022 年 3 月 31 日
9	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	公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 31 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享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	2022 年 4 月 7 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为代销机构、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	2022 年 4 月 9 日
12	东吴基金管理有限公司关于参加泰信财富基金销售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	2022 年 4 月 11 日
13	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 年 1 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	2022 年 4 月 22 日
14	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 22 日
15	东吴基金管理有限公司关于终止	中国证券报、上海证	2022 年 4 月 29 日

	北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司 办理本公司旗下基金销售业务的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	
16	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	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	2022 年 5 月 10 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行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、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 16 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2022 年 5 月 23 日
19	东吴基金管理有限公司关于维持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	2022 年 5 月 27 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启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	2022 年 5 月 27 日
21	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及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 13 日

22	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	2022 年 6 月 13 日
23	东吴基金管理有限公司关于参加平安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	2022 年 6 月 28 日
24	东吴基金管理有限公司管理的基金 2022 年半年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2022 年 7 月 1 日
25	东吴基金管理有限公司关于暂停喜鹊财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	2022 年 7 月 11 日
26	东吴基金管理有限公司关于北京微动利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	2022 年 7 月 14 日
27	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国联证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	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	2022 年 7 月 14 日
28	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 7 月 21 日
29	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2022 年 7 月 21 日

30	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在诺亚正行基金销售有限公司的定期定额投资及转换业务的公告	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	2022 年 7 月 23 日
31	东吴基金管理有限公司关于参加光大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	2022 年 7 月 27 日
32	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	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	2022 年 8 月 3 日
33	东吴基金管理有限公司关于参加中国建设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	2022 年 8 月 18 日
34	东吴基金管理有限公司关于参加世纪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	2022 年 8 月 25 日
35	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	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	2022 年 8 月 29 日
36	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 8 月 31 日
37	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2022 年 8 月 31 日

		券日报、公司网站、 中证信息网站	
38	东吴基金管理有限公司高级管理 人员变更公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 9 月 9 日
39	东吴新趋势价值线灵活配置混合 型证券投资基金 2022 年第 3 季度 报告	公司网站、中证信息 网站	2022 年 10 月 26 日
40	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2022 年 10 月 26 日
41	东吴基金管理有限公司关于维持 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	2022 年 11 月 23 日
42	东吴基金管理有限公司高级管理 人员变更公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、上交所网 站、公司网站、中证 信息网站	2022 年 12 月 6 日
43	东吴基金管理有限公司关于参加 深圳众禄基金销售股份有限公司 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、上交所网 站、公司网站、中证 信息网站	2022 年 12 月 16 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	20221001-20221231	60,792,329.56	0.00	0.00	60,792,329.56	35.22%
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

2023年3月31日