

# 东吴沪深 300 指数型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十一日

## § 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 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.....	55
7.7 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.....	55
7.8 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.....	55
7.9 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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3 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.....	58
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>59</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>65</b>
11.1 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.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴沪深 300 指数型证券投资基金	
基金简称	东吴沪深 300 指数	
基金主代码	165806	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 7 月 11 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,004,419.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴沪深 300 指数 A	东吴沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码:	165806	165810
报告期末下属分级基金的份额总额	6,004,419.46 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷
	联系电话	021-50509888-8308
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn
客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	021-60637111
传真	021-50509888-8211	021-60635778
注册地址	上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海浦东新区银城路 117 号	北京市西城区闹市口大街 1 号

	瑞明大厦 9 楼	院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	邓晖	田国立

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴沪深 300 指数 A	东吴沪深 300 指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-178,819.13	-
本期利润	-622,070.60	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1114	-
本期加权平均净值利润率	-8.36%	-
本期基金份额净值增长率	-8.88%	-8.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,339,740.33	-
期末可供分配基金份额利润	0.3897	0.0000
期末基金资产净值	8,344,159.79	-
期末基金份额净值	1.3897	1.3897
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	27.97%	27.97%

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

东吴沪深 300 指数 A

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
过去一个月	9.62%	1.03%	9.14%	1.02%	0.48%	0.01%
过去三个月	6.99%	1.36%	5.91%	1.36%	1.08%	0.00%
过去六个月	-8.88%	1.37%	-8.75%	1.38%	-0.13%	-0.01%
过去一年	-12.10%	1.17%	-13.42%	1.18%	1.32%	-0.01%
过去三年	20.63%	1.21%	16.43%	1.20%	4.20%	0.01%
自基金合同生效起至今	27.97%	1.28%	27.95%	1.27%	0.02%	0.01%



## 东吴沪深 300 指数 C

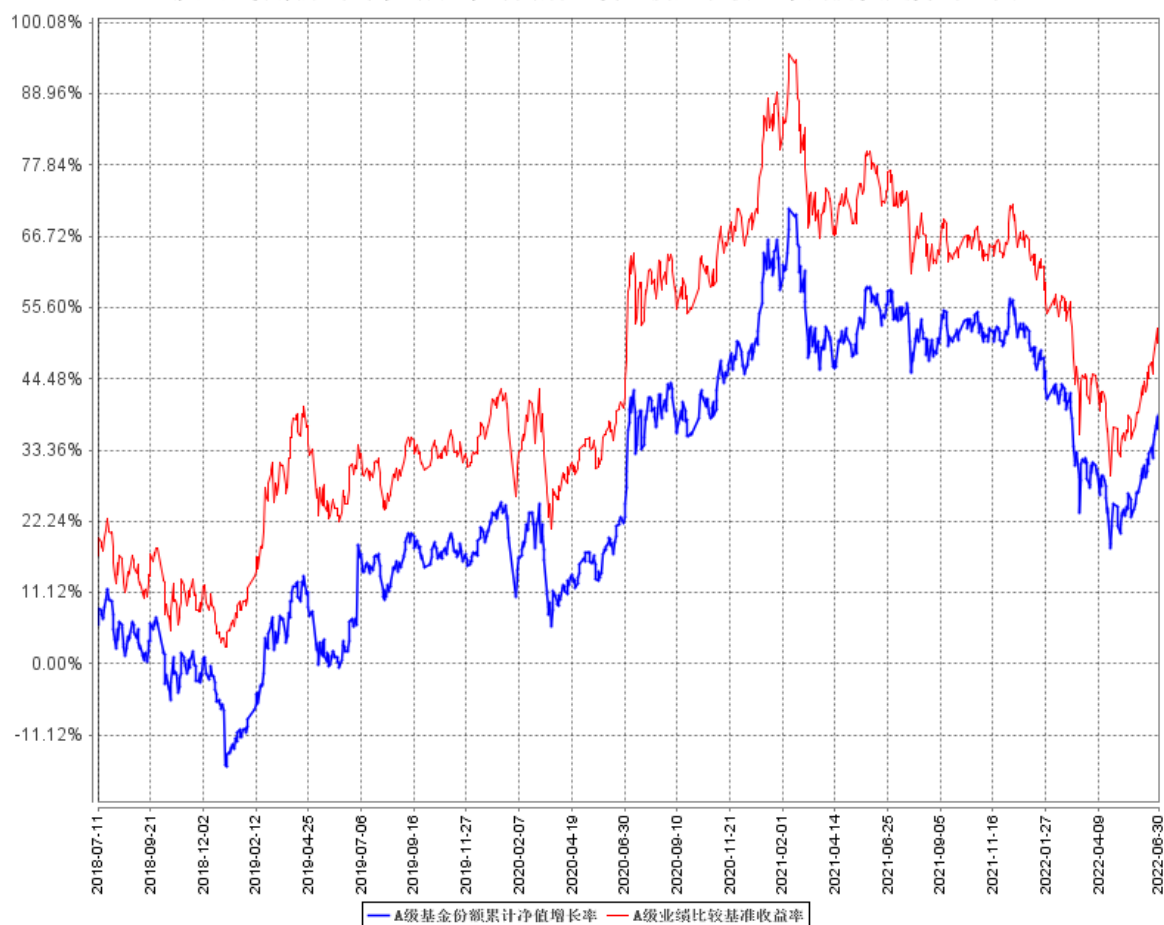
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.62%	1.03%	9.14%	1.02%	0.48%	0.01%
过去三个月	6.99%	1.36%	5.91%	1.36%	1.08%	0.00%
过去六个月	-8.88%	1.37%	-8.75%	1.38%	-0.13%	-0.01%
过去一年	-12.10%	1.17%	-13.42%	1.18%	1.32%	-0.01%
过去三年	20.63%	1.21%	16.43%	1.20%	4.20%	0.01%
自基金合同生效起至今	27.97%	1.28%	27.95%	1.27%	0.02%	0.01%

注：1、业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%；

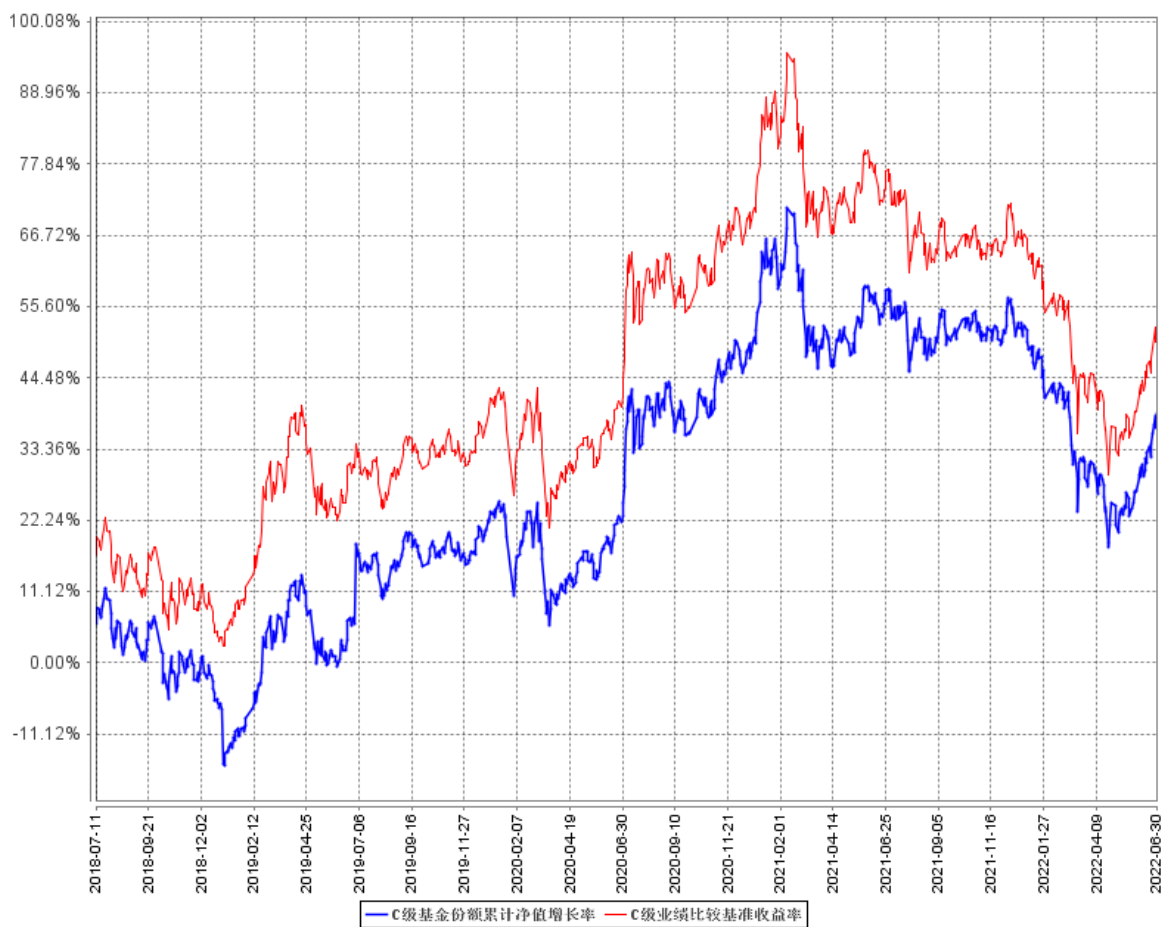
2、东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）变更而来，变更日期为 2018 年 7 月 11 日（即基金合同生效日）。

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

A 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%；

2、东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）变更而来，变更日期为 2018 年 7 月 11 日（即基金合同生效日）。

## § 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。牢记“受人之托,待人理财”的根本使命,深耕细作夯实投研体系,打造核心竞争力;整合市场营销,构建立体式营销体系;全力做好人才工作,构建人才梯队;优化机制机制,一切业绩说话;紧抓时代机遇,做好创新产品运营管理。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,力争在未来 3 年时间内,把公司建设成为具有核心竞争力的现代财富管理公司。

#### 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		
周健	基金经理	2020 年 1 月 18 日	-	15 年	周健先生,中国国籍,南开大学经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职海通证券股份有限公司研究所金融工程分析师。2011 年 5 月加入东吴基金管理有限公司,现任基金经理。2012 年 10 月 27 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2016 年 8 月 11 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 2 月 3 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金

					<p>经理，2012 年 5 月 03 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理，2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金（原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF））基金经理，2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.2 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及交易进行了相关分析，未发现异常情况。

#### 4.3.2 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

报告期内，国内经济增长进入停滞状态。整个房地产链条均出现大幅下滑，疫情导致消费和投资双双不振，二季度 GDP 同比增长 0.4%，为多年以来的次低点，仅高于 2020 年一季度。受俄乌战争和供应链调整影响，原材料价格快速上涨，通胀压力快速上行。货币政策方面，美联储进入加息周期，且有加速预期，国内政策保持宽松，收益率维持相对较低位置，但进一步宽松的可能性下降。财政政策方面，政策前置导致二季度投资青黄不接，增量较少，经济压力较大。

股市方面，市场出现系统性下跌，之后快速反弹。沪深 300 从去年二月份调整至今，并从四月底开始反弹。沪深 300 指数所配置的板块偏向金融、食品饮料等行业，风格偏向价值，并非现阶段资金追逐的热点，但整体估值较低，个股波动下降，业绩逐步回升，有望具备较好的长期投资价值。

报告期内，本基金采用复制指数配置的策略，努力控制仓位和成份股上的偏离，在日常的基金操作中积极应对申购赎回，尽量减少跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.3897 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.88%；截至本报告期末东吴沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.3897 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.88%；同期业绩比较基准收益率为-8.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾当下市场关注的核心变量，主要有以下几点：

1) 国内经济增长进入关键时点，因为在本轮下行过程中，政府没有推出刺激性货币政策，所以市场仍在等待更多证据以验证需求复苏，这是现阶段市场的主要矛盾。

2) 随着美联储提升加息预期，欧美经济面临快速冷却风险，如果需求下降的速度快于通胀回落，公司盈利将可能出现超预期下降，这与我们去年四季度的情况比较相似，股市或将面临较大压力。

3) 宏观经济的不确定性令全球资产配置处于不稳定状态，叠加地缘政治和疫情影响，市场更加关注资产波动和策略的风险控制能力，需要通过对冲和分散化可以降低组合的风险暴露。

总体看，下半年国内经济发展的趋势更具有相对确定性，但外围因素变化更多，我们需要更加聚焦于国内政策风向和经济复苏信号，尽力规避欧美经济衰退带来的风险和挑战。

市场走势方面，经过前期调整，股市估值处于相对较低位置。虽然二季度上市公司业绩压力较大，但后续在疫情受控、需求回升、原材料价格回落的共同作用下，有望逐步回升。现阶段国内经济走势与海外存在差异，若疫情得到有效控制，需求明确复苏，股票市场的配置价值有望得到明显提升。

行业配置方面，积极寻找估值和业绩可能双击的方向。经过前期充分调整，新老基建和大消费方向有望受益于内需复苏，具备较好的风险收益结构，但是短期机会可能集中在局部供需格局较好的板块。周期方向，市场对通胀预期较为充分，而现阶段需求有下行风险。科技方向，大量资金围绕电动化和智能化不断挖掘，且相关公司业绩正处于兑现期，趋势强劲，需要注意的是景气度的持续性、估值的稳定性，以及未来可能发生的分化。

#### 4.6 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；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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末进行利润分配。

#### **4.8 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，因赎回等原因，本基金于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：东吴沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	653,548.34	550,561.12
结算备付金		2,281.61	2,354.85
存出保证金		877.91	801.40
交易性金融资产	6.4.7.2	7,771,370.15	6,928,137.75
其中：股票投资		7,771,370.15	6,917,137.75
基金投资		-	-
债券投资		-	11,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		4,931.72	39,381.42
应收股利		-	-
应收申购款		724.14	4,125.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	63.49
资产总计		8,433,733.87	7,525,425.08
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,404.25	-

应付赎回款		2,222.67	-
应付管理人报酬		3,238.13	3,153.82
应付托管费		647.64	630.77
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	6.4.7.6	76,061.39	101,247.20
负债合计		89,574.08	105,031.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	6,004,419.46	4,865,082.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	2,339,740.33	2,555,310.40
净资产合计		8,344,159.79	7,420,393.29
负债和净资产总计		8,433,733.87	7,525,425.08

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，东吴沪深 300 指数 A 基金份额净值 1.3897 元，基金份额总额 6,004,419.46 份；东吴沪深 300 指数 C 基金份额净值 1.3897 元，基金份额总额 0.00 份。东吴沪深 300 指数份额总额合计为 6,004,419.46 份。

（2）以上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 年中期报告资产负债表中“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 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-476,103.12	402,305.34
1.利息收入		1,220.98	1,339.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,220.98	1,336.70
债券利息收入		-	2.66
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）		-35,229.88	1,233,984.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-106,648.02	1,170,954.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,820.08	2,433.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	67,598.06	60,596.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-443,251.47	-835,493.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,157.25	2,475.74
<b>减：二、营业总支出</b>		145,967.48	167,269.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,407.60	20,011.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,681.57	4,002.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	123,878.31	143,255.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-622,070.60	235,035.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-622,070.60	235,035.59
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-622,070.60	235,035.59

注：以上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 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

**6.3 净资产（基金净值）变动表**

会计主体：东吴沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,865,082.89	-	2,555,310.40	7,420,393.29
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）	4,865,082.89	-	2,555,310.40	7,420,393.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,139,336.57	-	-215,570.07	923,766.50
（一）、综合收益总额	-	-	-622,070.60	-622,070.60
（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）	1,139,336.57	-	406,500.53	1,545,837.10
其中：1.基金申购款	1,718,727.17	-	622,780.96	2,341,508.13
2.基金赎回款	-579,390.60	-	-216,280.43	-795,671.03
（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)	6,004,419.46	-	2,339,740.33	8,344,159.79
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	5,820,860.50	-	3,182,852.48	9,003,712.98
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)	5,820,860.50	-	3,182,852.48	9,003,712.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-490,718.66	-	-86,044.46	-576,763.12
(一)、综合收益总额	-	-	235,035.59	235,035.59
(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)	-490,718.66	-	-321,080.05	-811,798.71
其中: 1.基金申购款	1,456,459.64	-	841,635.62	2,298,095.26
2.基金赎回款	-1,947,178.30	-	-1,162,715.67	-3,109,893.97
(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)	5,330,141.84	-	3,096,808.02	8,426,949.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东吴沪深 300 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)转型而来,原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)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[2011]1278 号《关于核准东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由东吴基金管理有限公司作为管理人向社会公众公开发行募集,基金合同于 2012 年 3 月 9 日正式生效,首次设立募集规模为 385,199,023.48 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为东吴基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

2018 年 6 月 11 日,东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议并通过《关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》,内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、投资组合比例并相应变更基金名称,变更基金份额持有人大会程序、基金合同当事人权利义务、估值方法、基金费用等事项并相应修改基金合同。自东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)终止上市日 2018 年 7 月 11 日起,《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》生效,《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》自同一起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于准许东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)变更注册的批复》(证监许可[2018]530 号)和《东吴基金管理有限公司关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等的有关规定,基金管理人东吴基金管理有限

公司向深圳证券交易所申请终止东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）的上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2018]304 号）同意。东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）自 2018 年 7 月 11 日起终止上市。2018 年 7 月 10 日，即在 2018 年 7 月 10 日下午深圳证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人享有东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）终止上市后的相关权利。

根据《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》，根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、央行票据、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。

基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 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，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 3 号《半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。

#### 6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 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

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，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。

##### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 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。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 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，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

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。

在首次执行日（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 550,561.12 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 61.60 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，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 550,622.72 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 2,354.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1.21 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 2,356.06 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 801.40 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.44 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 801.84 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 63.49 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 61.60 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1.21 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.44 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.24 元。经上述重分类后，应收利息在新金融工具准则下不再单独列报。

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 6,928,137.75 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.24 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 6,928,137.99 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。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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、营业税的单位和个人，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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	653,548.34
等于：本金	653,482.77
加：应计利息	65.57
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：	653,548.34

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,422,749.92	-	7,771,370.15	348,620.23
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,422,749.92	-	7,771,370.15	348,620.23

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	8.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,249.71
其中：交易所市场	2,249.71
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	50,000.00
应付审计费	23,803.31
合计	76,061.39

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴沪深 300 指数 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	4,865,082.89	4,865,082.89
本期申购	1,718,727.17	1,718,727.17
本期赎回(以“-”号填列)	-579,390.60	-579,390.60
- 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	6,004,419.46	6,004,419.46

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴沪深 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,460,905.67	-3,905,595.27	2,555,310.40
本期利润	-178,819.13	-443,251.47	-622,070.60
本期基金份额交易产生的变动数	1,501,127.26	-1,094,626.73	406,500.53
其中：基金申购款	2,264,123.71	-1,641,342.75	622,780.96
基金赎回款	-762,996.45	546,716.02	-216,280.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,783,213.80	-5,443,473.47	2,339,740.33



### 6.4.7.9 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,165.03
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	48.73
其他	7.22
合计	1,220.98

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,106,560.71
减：卖出股票成本总额	2,205,445.64
减：交易费用	7,763.09
买卖股票差价收入	-106,648.02

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 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 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	4.35
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,815.73
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	3,820.08

#### 6.4.7.11.2 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 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	24,120.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	20,300.00

成本总额	
减：应计利息总额	4.59
减：交易费用	0.02
买卖债券差价收入	3,815.73

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	67,598.06
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	67,598.06

#### 6.4.7.15 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-443,251.47
——股票投资	-443,251.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	-443,251.47

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,157.25
合计	1,157.25

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划费	75.00
指数使用费	100,000.00
合计	123,878.31

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	2,681,115.18	47.86%	4,747,263.06	39.35%

#### 6.4.10.1.2 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6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	8,898.14	36.89%	6,671.10	29.08%

#### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份有 限公司	2,479.94	47.88%	2,249.71	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	4,326.18	38.83%	1,865.25	40.34%

限公司				
-----	--	--	--	--

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,407.60	20,011.95
其中：支付销售机构的客户维护费	7,146.96	6,424.22

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,681.57	4,002.41

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无 C 类基金份额，故未产生销售服务费。

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.2% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 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。

### 6.4.10.4 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

#### 6.4.10.4.1 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。

#### 6.4.10.4.2 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。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 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。

#### 6.4.10.5.2 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。

### 6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国建设银行股份有限公司	653,548.34	1,165.03	773,228.28	1,256.81
--------------	------------	----------	------------	----------

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.4 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 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债

券、可交换债券、可分离交易可转债、央行票据、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 按短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短期信用评级列示的债券投资。



#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	11,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	11,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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，本期末本基金的资产均能及时变现。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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30 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	653,548.34	-	-	-	-	-	653,548.34
结算备付金	2,281.61	-	-	-	-	-	2,281.61
存出保证金	877.91	-	-	-	-	-	877.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,771,370.15	7,771,370.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,931.72	4,931.72
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	724.14	724.14
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	656,707.86	-	-	-	-	7,777,026.01	8,433,733.87
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算	-	-	-	-	-	7,404.25	7,404.25

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,222.67	2,222.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,238.13	3,238.13
应付托管费	-	-	-	-	-	647.64	647.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	76,061.39	76,061.39
负债总计	-	-	-	-	-	89,574.08	89,574.08
利率敏感度缺口	656,707.86	-	-	-	-	7,687,451.93	8,344,159.79
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	550,561.12	-	-	-	-	-	550,561.12
结算备付金	2,354.85	-	-	-	-	-	2,354.85
存出保证金	801.40	-	-	-	-	-	801.40
交易性金融资产	-	-	-	-	11,000.00	6,917,137.75	6,928,137.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	39,381.42	39,381.42
应收利息	-	-	-	-	-	63.49	63.49
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	4,125.05	4,125.05
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	553,717.37	-	-	-	11,000.00	6,960,707.71	7,525,425.08
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,153.82	3,153.82
应付托管费	-	-	-	-	-	630.77	630.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	-	3,247.20	3,247.20
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	98,000.00	98,000.00
负债总计	-	-	-	-	105,031.79	105,031.79
利率敏感度缺口	553,717.37	-	-	11,000.00	6,855,675.92	7,420,393.29

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	-	159.61
	基准利率增加 25 个基点	-	-156.93

注：本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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 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	7,771,370.15	93.14	6,917,137.75	93.22
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,771,370.15	93.14	6,917,137.75	93.22

注：本基金投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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。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。

## 6.4.13.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-82,915.92	-73,461.89
	2. 业绩基准下跌 5%	-414,579.58	-367,309.47
3. 业绩基准下跌 10%	-829,159.16	-734,618.94	

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 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。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具****6.4.14.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	7,771,370.15	6,917,137.75
第二层次	-	11,000.00
第三层次	-	-
合计	7,771,370.15	6,928,137.75

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

**6.4.14.3 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。

**6.4.14.4 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。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	7,771,370.15	92.15
	其中：股票	7,771,370.15	92.15
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	655,829.95	7.78
8	其他各项资产	6,533.77	0.08
9	合计	8,433,733.87	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	90,194.00	1.08
B	采矿业	190,589.45	2.28
C	制造业	4,557,381.16	54.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,626.00	0.99
E	建筑业	267,164.50	3.20
F	批发和零售业	86,008.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	277,688.00	3.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	267,462.60	3.21
J	金融业	1,434,443.65	17.19
K	房地产业	205,483.41	2.46
L	租赁和商务服务业	117,400.00	1.41
M	科学研究和技术服务业	126,804.47	1.52
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,452.91	0.74
R	文化、体育和娱乐业	6,672.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	7,771,370.15	93.14

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.2.3 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。

## 7.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	300	613,500.00	7.35
2	300750	宁德时代	600	320,400.00	3.84
3	600036	招商银行	4,600	194,120.00	2.33
4	601318	中国平安	4,023	187,833.87	2.25
5	601012	隆基绿能	2,530	168,573.90	2.02
6	000858	五粮液	700	141,351.00	1.69
7	000002	万科A	6,200	127,100.00	1.52
8	603288	海天味业	1,296	117,106.56	1.40
9	600276	恒瑞医药	3,156	117,056.04	1.40
10	000333	美的集团	1,900	114,741.00	1.38
11	300059	东方财富	3,955	100,457.00	1.20
12	002594	比亚迪	300	100,047.00	1.20
13	601186	中国铁建	11,900	94,010.00	1.13
14	601888	中国中免	400	93,172.00	1.12
15	601390	中国中铁	14,725	90,411.50	1.08
16	000538	云南白药	1,496	90,343.44	1.08
17	601166	兴业银行	4,400	87,560.00	1.05
18	002371	北方华创	300	83,136.00	1.00
19	600887	伊利股份	2,100	81,795.00	0.98
20	000963	华东医药	1,800	81,288.00	0.97
21	603259	药明康德	773	80,384.27	0.96
22	000001	平安银行	5,171	77,461.58	0.93



23	600030	中信证券	3,510	76,026.60	0.91
24	601066	中信建投	2,600	75,166.00	0.90
25	000568	泸州老窖	300	73,962.00	0.89
26	002475	立讯精密	2,186	73,864.94	0.89
27	601111	中国国航	6,300	73,143.00	0.88
28	002352	顺丰控股	1,300	72,553.00	0.87
29	601728	中国电信	18,000	67,140.00	0.80
30	600809	山西汾酒	200	64,960.00	0.78
31	300760	迈瑞医疗	200	62,640.00	0.75
32	002415	海康威视	1,700	61,540.00	0.74
33	300896	爱美客	100	60,001.00	0.72
34	601398	工商银行	11,700	55,809.00	0.67
35	000651	格力电器	1,600	53,952.00	0.65
36	600438	通威股份	900	53,874.00	0.65
37	601628	中国人寿	1,700	52,836.00	0.63
38	002812	恩捷股份	200	50,090.00	0.60
39	002714	牧原股份	900	49,743.00	0.60
40	601328	交通银行	9,800	48,804.00	0.58
41	300014	亿纬锂能	500	48,750.00	0.58
42	600309	万华化学	500	48,495.00	0.58
43	000725	京东方 A	11,548	45,499.12	0.55
44	600547	山东黄金	2,420	44,915.20	0.54
45	002460	赣锋锂业	300	44,610.00	0.53
46	601899	紫金矿业	4,755	44,364.15	0.53
47	300015	爱尔眼科	983	44,008.91	0.53
48	002142	宁波银行	1,200	42,972.00	0.51
49	600048	保利发展	2,400	41,904.00	0.50
50	002129	TCL 中环	700	41,223.00	0.49
51	600690	海尔智家	1,500	41,190.00	0.49
52	300498	温氏股份	1,900	40,451.00	0.48
53	600031	三一重工	2,100	40,026.00	0.48
54	688111	金山办公	200	39,424.00	0.47
55	300274	阳光电源	400	39,300.00	0.47
56	600837	海通证券	4,000	39,240.00	0.47
57	688981	中芯国际	850	38,394.50	0.46
58	002049	紫光国微	200	37,944.00	0.45
59	002241	歌尔股份	1,128	37,900.80	0.45
60	603501	韦尔股份	216	37,374.48	0.45
61	002709	天赐材料	600	37,236.00	0.45

62	601816	京沪高铁	7,400	37,148.00	0.45
63	002304	洋河股份	200	36,630.00	0.44
64	300124	汇川技术	550	36,228.50	0.43
65	600436	片仔癀	100	35,673.00	0.43
66	603986	兆易创新	240	34,130.40	0.41
67	000063	中兴通讯	1,309	33,418.77	0.40
68	300122	智飞生物	300	33,303.00	0.40
69	600919	江苏银行	4,600	32,752.00	0.39
70	600406	国电南瑞	1,200	32,400.00	0.39
71	600585	海螺水泥	907	31,998.96	0.38
72	600111	北方稀土	900	31,644.00	0.38
73	601668	中国建筑	5,900	31,388.00	0.38
74	002271	东方雨虹	605	31,139.35	0.37
75	600104	上汽集团	1,700	30,277.00	0.36
76	601919	中远海控	2,160	30,024.00	0.36
77	601088	中国神华	900	29,970.00	0.36
78	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.35
79	002230	科大讯飞	700	28,854.00	0.35
80	601288	农业银行	9,500	28,690.00	0.34
81	300759	康龙化成	300	28,566.00	0.34
82	600000	浦发银行	3,492	27,970.92	0.34
83	300661	圣邦股份	150	27,303.00	0.33
84	002459	晶澳科技	340	26,826.00	0.32
85	002202	金风科技	1,800	26,640.00	0.32
86	600196	复星医药	600	26,454.00	0.32
87	600016	民生银行	7,000	26,040.00	0.31
88	601601	中国太保	1,100	25,883.00	0.31
89	002410	广联达	475	25,859.00	0.31
90	601225	陕西煤业	1,200	25,416.00	0.30
91	000596	古井贡酒	100	24,966.00	0.30
92	600958	东方证券	2,383	24,330.43	0.29
93	002027	分众传媒	3,600	24,228.00	0.29
94	300142	沃森生物	500	24,195.00	0.29
95	000792	盐湖股份	800	23,968.00	0.29
96	000100	TCL 科技	5,000	23,950.00	0.29
97	000661	长春高新	100	23,342.00	0.28
98	601658	邮储银行	4,300	23,177.00	0.28
99	601988	中国银行	6,900	22,494.00	0.27
100	601688	华泰证券	1,577	22,393.40	0.27

101	300782	卓胜微	160	21,600.00	0.26
102	000338	潍柴动力	1,700	21,199.00	0.25
103	600600	青岛啤酒	200	20,784.00	0.25
104	000776	广发证券	1,100	20,570.00	0.25
105	601766	中国中车	3,900	20,280.00	0.24
106	600010	包钢股份	8,600	20,210.00	0.24
107	600050	中国联通	5,800	20,068.00	0.24
108	601211	国泰君安	1,300	19,760.00	0.24
109	600029	南方航空	2,600	19,006.00	0.23
110	300450	先导智能	300	18,954.00	0.23
111	600383	金地集团	1,400	18,816.00	0.23
112	688599	天合光能	284	18,531.00	0.22
113	601633	长城汽车	500	18,520.00	0.22
114	600741	华域汽车	800	18,400.00	0.22
115	600795	国电电力	4,700	18,377.00	0.22
116	600905	三峡能源	2,900	18,241.00	0.22
117	600893	航发动力	400	18,204.00	0.22
118	000768	中航西飞	600	18,174.00	0.22
119	600019	宝钢股份	3,000	18,060.00	0.22
120	601377	兴业证券	2,541	17,914.05	0.21
121	300347	泰格医药	156	17,854.20	0.21
122	002179	中航光电	280	17,729.60	0.21
123	601600	中国铝业	3,700	17,575.00	0.21
124	600763	通策医疗	100	17,444.00	0.21
125	601006	大秦铁路	2,600	17,134.00	0.21
126	601989	中国重工	4,600	17,066.00	0.20
127	600745	闻泰科技	200	17,022.00	0.20
128	600009	上海机场	300	17,010.00	0.20
129	600570	恒生电子	390	16,980.60	0.20
130	600760	中航沈飞	280	16,926.00	0.20
131	603659	璞泰来	200	16,880.00	0.20
132	000876	新希望	1,100	16,830.00	0.20
133	600660	福耀玻璃	400	16,724.00	0.20
134	600999	招商证券	1,160	16,715.60	0.20
135	600085	同仁堂	300	15,864.00	0.19
136	601985	中国核电	2,300	15,778.00	0.19
137	600460	士兰微	300	15,600.00	0.19
138	600346	恒力石化	700	15,568.00	0.19
139	000938	紫光股份	800	15,520.00	0.19

140	000157	中联重科	2,500	15,400.00	0.18
141	002493	荣盛石化	1,000	15,390.00	0.18
142	603369	今世缘	300	15,300.00	0.18
143	600588	用友网络	700	15,197.00	0.18
144	600150	中国船舶	800	15,184.00	0.18
145	603833	欧派家居	100	15,068.00	0.18
146	601800	中国交建	1,600	14,848.00	0.18
147	002920	德赛西威	100	14,800.00	0.18
148	600132	重庆啤酒	100	14,660.00	0.18
149	000895	双汇发展	500	14,650.00	0.18
150	601009	南京银行	1,400	14,588.00	0.17
151	300601	康泰生物	320	14,457.60	0.17
152	601857	中国石油	2,587	13,711.10	0.16
153	002074	国轩高科	300	13,680.00	0.16
154	300316	晶盛机电	200	13,518.00	0.16
155	600584	长电科技	500	13,500.00	0.16
156	601669	中国电建	1,700	13,379.00	0.16
157	000625	长安汽车	770	13,336.40	0.16
158	000977	浪潮信息	500	13,240.00	0.16
159	600989	宝丰能源	900	13,185.00	0.16
160	601117	中国化学	1,400	13,174.00	0.16
161	300496	中科创达	100	13,048.00	0.16
162	002001	新和成	552	12,591.12	0.15
163	002466	天齐锂业	100	12,480.00	0.15
164	601100	恒立液压	200	12,344.00	0.15
165	003816	中国广核	4,400	12,320.00	0.15
166	600028	中国石化	3,000	12,240.00	0.15
167	601238	广汽集团	800	12,192.00	0.15
168	600176	中国巨石	700	12,187.00	0.15
169	300408	三环集团	400	12,040.00	0.14
170	002311	海大集团	200	12,002.00	0.14
171	600926	杭州银行	800	11,984.00	0.14
172	000066	中国长城	1,100	11,902.00	0.14
173	600188	兖矿能源	300	11,844.00	0.14
174	688396	华润微	200	11,814.00	0.14
175	601021	春秋航空	200	11,670.00	0.14
176	603019	中科曙光	400	11,608.00	0.14
177	000166	申万宏源	2,700	11,583.00	0.14
178	300595	欧普康视	200	11,438.00	0.14

179	002236	大华股份	696	11,428.32	0.14
180	601336	新华保险	351	11,298.69	0.14
181	300999	金龙鱼	200	10,804.00	0.13
182	600918	中泰证券	1,400	10,710.00	0.13
183	600011	华能国际	1,500	10,560.00	0.13
184	000786	北新建材	300	10,386.00	0.12
185	002648	卫星化学	400	10,340.00	0.12
186	000301	东方盛虹	600	10,146.00	0.12
187	601868	中国能建	4,200	9,954.00	0.12
188	002916	深南电路	100	9,371.00	0.11
189	001979	招商蛇口	687	9,226.41	0.11
190	603806	福斯特	140	9,172.80	0.11
191	002938	鹏鼎控股	300	9,063.00	0.11
192	600426	华鲁恒升	300	8,760.00	0.10
193	002007	华兰生物	380	8,664.00	0.10
194	600352	浙江龙盛	842	8,571.56	0.10
195	002555	三七互娱	400	8,492.00	0.10
196	000069	华侨城 A	1,300	8,437.00	0.10
197	601838	成都银行	500	8,290.00	0.10
198	600489	中金黄金	1,100	8,129.00	0.10
199	300003	乐普医疗	400	7,428.00	0.09
200	600886	国投电力	700	7,350.00	0.09
201	601901	方正证券	1,094	7,340.74	0.09
202	600183	生益科技	400	6,796.00	0.08
203	300413	芒果超媒	200	6,672.00	0.08
204	002008	大族激光	200	6,626.00	0.08
205	601788	光大证券	400	6,304.00	0.08
206	603160	汇顶科技	100	6,193.00	0.07
207	000708	中信特钢	300	6,045.00	0.07
208	300433	蓝思科技	500	5,535.00	0.07
209	002736	国信证券	561	5,368.77	0.06
210	600655	豫园股份	500	4,720.00	0.06

### 7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	600519	贵州茅台	171,128.00	2.31
2	300750	宁德时代	106,299.00	1.43
3	601318	中国平安	98,594.00	1.33
4	000858	五粮液	86,763.00	1.17
5	000002	万科A	83,084.00	1.12
6	600036	招商银行	80,137.00	1.08
7	000963	华东医药	73,803.00	0.99
8	002594	比亚迪	71,837.00	0.97
9	601066	中信建投	69,261.00	0.93
10	601816	京沪高铁	65,608.00	0.88
11	601633	长城汽车	65,431.00	0.88
12	000001	平安银行	64,938.00	0.88
13	300760	迈瑞医疗	63,092.00	0.85
14	600276	恒瑞医药	61,268.00	0.83
15	002371	北方华创	59,790.00	0.81
16	600745	闻泰科技	58,195.00	0.78
17	601166	兴业银行	56,044.00	0.76
18	601111	中国国航	55,547.00	0.75
19	688008	澜起科技	54,750.52	0.74
20	601888	中国中免	54,465.00	0.73

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002594	比亚迪	94,665.00	1.28
2	601318	中国平安	78,554.00	1.06
3	000858	五粮液	66,305.00	0.89
4	002475	立讯精密	64,110.00	0.86

5	688008	澜起科技	62,747.70	0.85
6	601766	中国中车	62,510.00	0.84
7	603517	绝味食品	61,643.30	0.83
8	601816	京沪高铁	61,256.00	0.83
9	300760	迈瑞医疗	60,001.00	0.81
10	002466	天齐锂业	57,810.00	0.78
11	601166	兴业银行	49,088.00	0.66
12	000625	长安汽车	47,148.00	0.64
13	603986	兆易创新	44,368.00	0.60
14	600745	闻泰科技	42,870.00	0.58
15	600036	招商银行	42,535.00	0.57
16	600030	中信证券	39,769.00	0.54
17	601633	长城汽车	37,385.00	0.50
18	000001	平安银行	35,258.00	0.48
19	002821	凯莱英	34,700.00	0.47
20	600019	宝钢股份	32,950.00	0.44

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。

#### 7.4.3 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	3,502,929.51
卖出股票收入（成交）总额	2,106,560.71

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未投资债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未投资债券。

#### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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“招商银行（证券代码：600036）”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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	877.91
2	应收清算款	4,931.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	724.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,533.77

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。



#### **7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### **7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东吴沪深 300 指数 A	529	11,350.51	603,060.40	10.04%	5,401,359.06	89.96%
东吴沪深 300 指数 C	-	-	-	-	-	-
合计	529	11,350.51	603,060.40	10.04%	5,401,359.06	89.96%

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴沪深 300 指数 A	31,204.18	0.5197%
	东吴沪深 300 指数 C	-	-
	合计	31,204.18	0.5197%

### 8.3 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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴沪深 300 指数 A	东吴沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2018 年 7 月 11 日）基金份额总额	4,997,386.59	-
本报告期期初基金份额总额	4,865,082.89	-
本报告期基金总申购份额	1,718,727.17	-
减：本报告期基金总赎回份额	579,390.60	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	6,004,419.46	-

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本报告期内管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 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）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的管理人、托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	3	2,681,115.18	47.86%	2,479.94	47.88%	-
海通证券	2	1,854,697.74	33.11%	1,727.36	33.35%	-
招商证券	1	726,327.00	12.97%	661.91	12.78%	-
光大证券	1	339,991.00	6.07%	309.82	5.98%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 1 个交易单元，为东吴证券；退租 2 个交易单元，为长城证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	8,898.14	36.89%	-	-	-	-
海通证券	15,222.20	63.11%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 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	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 5 日
4	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
5	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 19 日
6	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
7	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 24 日
8	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 9 日
9	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 23 日
10	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
11	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 9 日
12	东吴基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2022 年 3 月 9 日

	旗下部分基金新增申万宏源（西部）证券有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
13	0323 见报_东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 23 日
14	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
15	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
16	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 31 日
17	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 7 日
18	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
19	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
20	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
21	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 20 日
22	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
23	东吴沪深 300 指数型证券投资	公司网站、中证信息	2022 年 4 月 22 日

	资基金 2022 年第 1 季度报告	网站	
24	东吴基金管理有限公司关于终止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	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 29 日
25	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 6 日
26	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 18 日
27	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
28	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
29	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 1 日
30	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、开通定期定额投资业务的公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 1 日
31	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 15 日
32	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
33	东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额继续暂停申购业务的提示性公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 29 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；
2. 《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金托管协议》；
4. 《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》；
5. 《东吴沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》；
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
7. 报告期内东吴沪深 300 指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 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。

### 12.3 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 8 月 31 日