

东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
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.....	15
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
§5 托管人报告	17
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东吴多策略混合	
基金主代码	580009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 13 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	136,801,716.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
下属分级基金的交易代码:	580009	011949
报告期末下属分级基金的份额总额	64,003,905.40 份	72,797,810.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在充分控制基金资产风险的前提下，通过积极主动的资产配置和多种策略，充分挖掘市场中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置，并积极参与新股申购，辅助权证及其他金融工具等投资，控制基金组合的投资风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	陆志俊
	联系电话	021-50509888-8308	95559
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95559
传真		021-50509888-8211	021-62701216
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼 901、902 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	瑞明大厦 9 楼	号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	李素明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼

§ 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	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-32,086,644.14	-57,694,976.43
本期利润	-12,937,041.16	-34,704,058.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1615	-0.2512
本期加权平均净值利润率	-8.38%	-13.11%
本期基金份额净值增长率	-9.30%	-9.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	50,843,364.83	-19,979,602.86
期末可供分配基金份额利润	0.7944	-0.2745
期末基金资产净值	118,817,324.00	133,839,432.82
期末基金份额净值	1.8564	1.8385
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	87.14%	18.31%

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

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

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

4、本基金于 2021 年 4 月 14 日开始分为 A、C 两类。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴多策略混合 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	3.33%	1.23%	0.67%	0.43%	2.66%	0.80%
过去三个月	-2.00%	1.24%	-2.10%	0.41%	0.10%	0.83%
过去六个月	-9.30%	1.21%	0.23%	0.42%	-9.53%	0.79%
过去一年	-20.27%	1.45%	-6.49%	0.49%	-13.78%	0.96%
过去三年	29.33%	1.91%	-2.37%	0.60%	31.70%	1.31%

自基金合同生效起至今	87.14%	1.64%	2.98%	0.62%	84.16%	1.02%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

东吴多策略混合 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	3.30%	1.23%	0.67%	0.43%	2.63%	0.80%
过去三个月	-2.09%	1.24%	-2.10%	0.41%	0.01%	0.83%
过去六个月	-9.48%	1.21%	0.23%	0.42%	-9.71%	0.79%
过去一年	-20.59%	1.45%	-6.49%	0.49%	-14.10%	0.96%
自基金合同生效起至今	18.31%	1.91%	-9.33%	0.55%	27.64%	1.36%

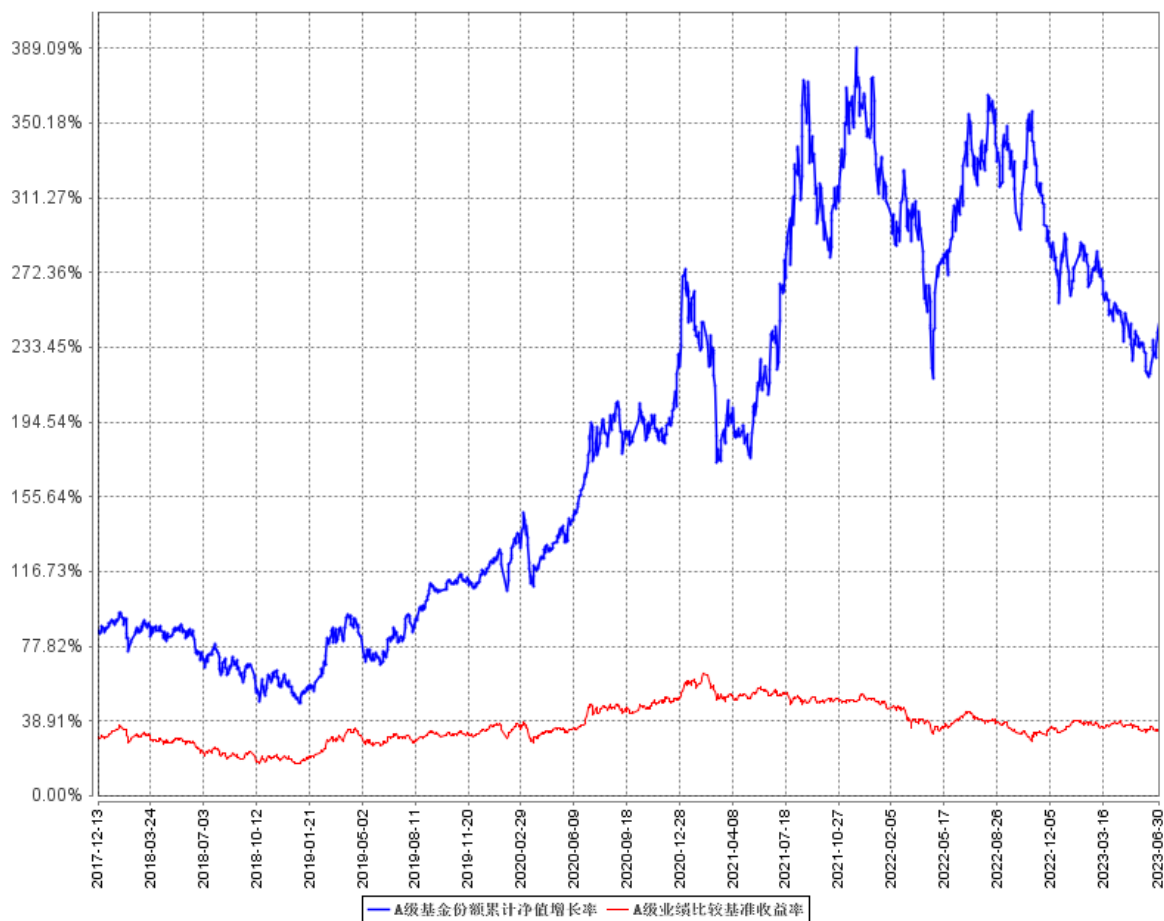
注：1. 比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%

2. 本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日。

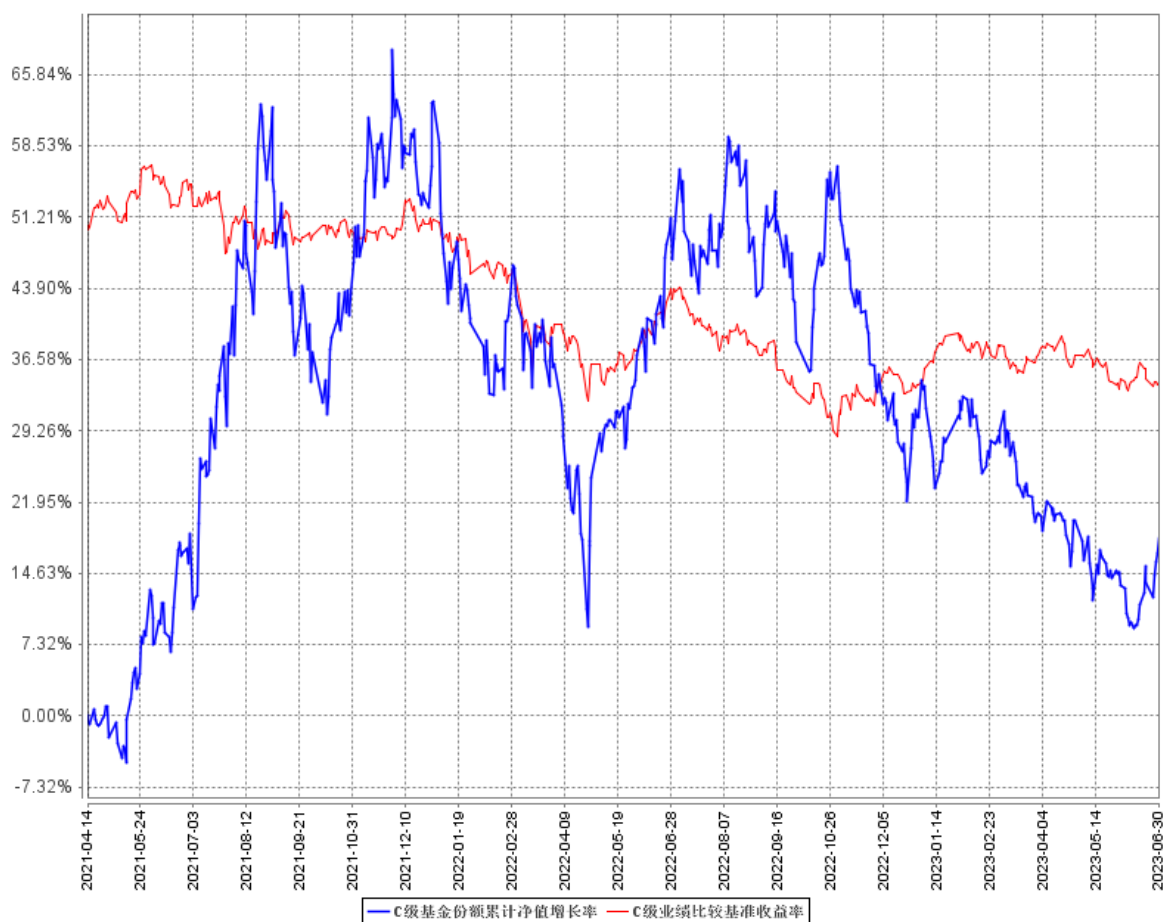
3. 本基金于 2021 年 4 月 14 日开始分为 A、C 两类。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

2、本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日。

3、本基金于 2021 年 4 月 14 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

§ 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。

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		
张浩佳	基金经理	2021 年 9 月 30 日	-	7 年	张浩佳先生,中国国籍,南京大学工学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职国联证券研究所研究员,2017 年 11 月加入东吴基金管理有限公司,现任基金经理。2021 年 9 月 30 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,2022 年 12 月 30 日至今担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 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

2023 年上半年，由于 AI 等科技新浪潮的出现，国内外市场方向也趋向 AI 相关领域，TMT 板块出现较为明显的上涨。而由于国内国外货币等经济形势的变化，一方面是由于海外加息预期的重新提高，且国内仍处于缓慢修复过程中，市场板块出现较为聚焦的行情，同时由于国内处于去库存周期，而大部分制造业，由于前两年的高景气度以及行业供给的不断释放，今年多进入调整期，这也限制了相关板块行情，但总体看，目前国内市场仍处于结构性行情，持续复苏、景气向好的行业预计仍有望有较好的表现机会，但是海外利率或仍居高不下，衰退预期也可能会影响市场节奏，但整体上看，景气相对上行板块或仍是重视方向。

下半年来看，本基金仍重点关注高端制造业，长期看，高端制造行业仍有望是政策持续鼓励的方向，同时业绩持续增长也有望是市场主线，且板块经过一轮回调后估值或也在合理水平，横向比较各行业情况，本基金比较关注高端制造业景气向上周期可能带来的板块业绩弹性，也比较关注产业中具备技术核心及行业优势的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴多策略混合 A 基金份额净值为 1.8564 元，本报告期基金份额净值增长率

为-9.30%；截至本报告期末东吴多策略混合 C 基金份额净值为 1.8385 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.48%；同期业绩比较基准收益率为 0.23%。

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 年上半年经济复苏低于市场预期，市场对经济基本面和政策面预期较为悲观。展望 2023 年下半年，预计中国经济虽有压力但大概率温和触底。2023 年下半年出口可能继续承压，房地产投资有一定压力但有望边际缓和，基建投资、制造业投资和消费有望持平。中国出口与海外经济密切相关，2021 年至 2022 年上半年，出口都是中国经济的拉动力，但自 2022 年下半年开始，出口开始乏力，截至 23 年 6 月中国出口累计同比增速降为-3.2%，这背后主要是受海外经济下行压力影响。当前以美国为代表的全球经济仍处于下行区间，这大概率会进一步拖累下半年中国出口增速。房地产投资持续低于预期，截至 2023 年 6 月房地产投资累计同比为-7.9%，新开工面积累计同比-24.3%。房地产投资较差与人口大周期以及政策导向相关，近期高层推出城中村改造指导意见，有望部分修复房地产悲观预期，预计下半年房地产投资压力可能边际缓和。基建投资具有逆周期属性，考虑到目前政策定力，下半年基建可能和上半年持平。制造业投资与出口有一定关联，但也受自身产业周期驱动，乐观情况下下半年有望持平。今年消费约束来自于收入预期偏弱，下半年可能大致延续上半年的水平。整体来看，2023 年下半年国内经济有望温和触底，并有希望进入弱复苏阶段。

政策层面，2023 年下半年国内外货币政策将由分歧逐渐走向一致，全球流动性将由紧变松。国内货币政策在 2023 年上半年延续了中性偏宽松的基调，1 年期和 5 年期 LRP 利率各下调了 10bp，存款准备金率也下调了 0.25%。展望 2023 年下半年，我们认为国内通胀压力相对较小，而海外通胀也已呈现明显的下行趋势，预计国内 2023 年下半年有望继续保持中性偏宽松的货币政策格局。信用传导方面，从稳增长角度考虑，预计 2023 年下半年国内信用环境也有望维持偏宽。其他政策方面，比如房地产等领域，考虑到国内坚持高质量发展的基调不变，下半年经济强刺激的概率不大。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，截至 2023 年 5 月，已加息 10 次，将基准利率上限从 0.25%加至 5.25%。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 23 年 6 月的 3%，呈现通胀加速回落态势。美联储本轮加息周期有望在 2023 年 7 月份结束，2024 年有望进入降息周期。

资本市场方面，我们认为 2023 年下半年市场向上机会可能大于向下风险。展望 2023 年下半年，A 股基本面、流动性和估值这三大因素中至少有两个因素是有望改善的。一是国内经济基本面有望触底。二是海外美联储有望在 2023 年 7 月结束加息，国内流动性或继续维持中性偏宽。三

是当前 A 股估值处于历史相对偏低水平。这对权益市场来说可能是个相对有利的组合。

风格层面上，我们判断 2023 年下半年成长股可能占优。价值板块，包括消费、金融和周期，受传统经济周期影响更大。下半年经济政策强刺激概率较小，A 股风格上成长股更为占优。相比价值股受经济疲弱拖累，成长股受经济周期的影响相对较小，主要受产业趋势的驱动。目前来看，制造业强者恒强的态势愈发明显，我国如船舶等高端制造业已经脱颖而出，同时经历了过去数年的市场行情后，新能源、半导体、军工等行业在 2023 年的 β 或将弱化，但 α 仍存在，随着国企改革不断加强，国有资产体质增效也愈发明显，而对于消费、医药等赛道，从需求端看这些领域市场空间较大，从供给端看中国拥有全球庞大的工程师红利，参考海外经验，这些领域中有望诞生优质公司。

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，成员由公司总经理、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，公司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

本基金本报告期未进行利润分配。

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，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

本报告期内，基金托管人在东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，东吴基金管理有限公司在东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,829,729.28	62,313,003.28
结算备付金		1,064,447.61	4,506,978.60
存出保证金		286,932.84	456,184.36
交易性金融资产	6.4.7.2	230,685,499.68	638,625,381.99
其中：股票投资		230,685,499.68	638,625,381.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		7,589,611.92	-
应收股利		-	-
应收申购款		155,794.77	1,516,356.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		262,612,016.10	707,417,905.01
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		7,596,456.82	10,014,731.63
应付赎回款		1,215,240.59	10,017,479.68
应付管理人报酬		170,043.37	509,616.79
应付托管费		53,138.57	159,255.26
应付销售服务费		47,242.02	157,511.59
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	873,137.91	2,449,870.03
负债合计		9,955,259.28	23,308,464.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	136,801,716.32	335,783,206.59
未分配利润	6.4.7.8	115,855,040.50	348,326,233.44
净资产合计		252,656,756.82	684,109,440.03
负债和净资产总计		262,612,016.10	707,417,905.01

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，东吴多策略混合 A 基金份额净值 1.8564 元，基金份额总额 64,003,905.40 份；东吴多策略混合 C 基金份额净值 1.8385 元，基金份额总额 72,797,810.92 份。东吴多策略混合份额总额合计为 136,801,716.32 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-44,787,966.35	-58,441,995.87
1.利息收入		195,517.86	372,842.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	195,517.86	357,130.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	15,712.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-87,582,816.95	-85,570,810.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-88,316,892.64	-86,693,518.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	734,075.69	1,122,708.15
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	42,140,520.72	24,959,724.65

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	458,812.02	1,796,247.15
减：二、营业总支出		2,853,133.50	4,427,345.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,679,503.12	2,603,857.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	524,844.76	813,705.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	528,366.97	901,902.50
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	120,418.65	107,880.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,641,099.85	-62,869,341.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,641,099.85	-62,869,341.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-47,641,099.85	-62,869,341.66

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	335,783,206.59	348,326,233.44	684,109,440.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	335,783,206.59	348,326,233.44	684,109,440.03

(基金净值)			
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-198,981,490.27	-232,471,192.94	-431,452,683.21
(一)、综合收益总额	-	-47,641,099.85	-47,641,099.85
(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)	-198,981,490.27	-184,830,093.09	-383,811,583.36
其中：1.基金申购款	100,181,326.79	96,020,282.31	196,201,609.10
2.基金赎回款	-299,162,817.06	-280,850,375.40	-580,013,192.46
(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)	136,801,716.32	115,855,040.50	252,656,756.82
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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)	212,559,707.14	326,650,536.86	539,210,244.00
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)	212,559,707.14	326,650,536.86	539,210,244.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	82,978,764.50	63,211,857.36	146,190,621.86
(一)、综合收益总额	-	-62,869,341.66	-62,869,341.66
(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)	82,978,764.50	126,081,199.02	209,059,963.52
其中: 1.基金申购款	461,399,638.53	538,723,860.20	1,000,123,498.73
2.基金赎回款	-378,420,874.03	-412,642,661.18	-791,063,535.21
(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)	295,538,471.64	389,862,394.22	685,400,865.86

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:

李素明

基金管理人负责人

李素明

主管会计工作负责人

骆银

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由东吴内需增长混合型证券投资基金转型而来，原东吴内需增长混合型证券投资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[2012]1035号《关于核准东吴内需增长混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于2013年1月30日正式生效，首次设立募集规模为464,106,738.16份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

2017年12月12日东吴内需增长混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于东吴内需增长混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括东吴内需增长混合型证券投资基金变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略和修订基金合同等事项。自基金份额持有人大会决议生效之日次一日起，《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》失效且《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

根据2021年4月13日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，2021年4月14日起对本基金增加C类基金份额，并对本基金的基金合同和《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》作相应修改。本基金增加C类基金份额后，将形成A类和C类两类基金份额并分别设置对应的基金代码（A类基金份额代码：580009；C类基金份额代码：011949）。新增的C类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费。原有的基金份额在本基金增加C类基金份额后，全部自动转换为本基金A类基金份额，该类份额的申购赎回业务规则以及费率结构均保持不变。C类基金份额的初始基金份额净值参考交易当日A类基金份额的基金份额净值。

本基金投资范围限于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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为：沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

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《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。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 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

本基金本报告期所采用的会计政策、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。

6.4.5 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

本基金本报告期无会计政策变更。

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，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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	22,829,729.28
等于：本金	22,825,428.26
加：应计利息	4,301.02

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：	22,829,729.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	221,217,022.44	-	230,685,499.68	9,468,477.24
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	221,217,022.44	-	230,685,499.68	9,468,477.24

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	254.17
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	762,225.09
其中：交易所市场	762,225.09
银行间市场	-
应付利息	-
应付账户维护费	9,000.00
应付审计费	42,151.28
应付信息披露费	59,507.37
合计	873,137.91

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴多策略混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	135,769,164.48	135,769,164.48
本期申购	12,281,090.98	12,281,090.98
本期赎回(以“-”号填列)	-84,046,350.06	-84,046,350.06
- 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	64,003,905.40	64,003,905.40

金额单位：人民币元

东吴多策略混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	200,014,042.11	200,014,042.11
本期申购	87,900,235.81	87,900,235.81
本期赎回(以“-”号填列)	-215,116,467.00	-215,116,467.00
- 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	72,797,810.92	72,797,810.92

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

东吴多策略混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	159,432,717.67	-17,321,897.85	142,110,819.82
本期利润	-32,086,644.14	19,149,602.98	-12,937,041.16
本期基金份额交易产生的变动数	-76,502,708.70	2,142,348.64	-74,360,360.06
其中：基金申购款	12,301,904.56	-741,578.38	11,560,326.18
基金赎回款	-88,804,613.26	2,883,927.02	-85,920,686.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,843,364.83	3,970,053.77	54,813,418.60

单位：人民币元

东吴多策略混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	21,200,593.99	185,014,819.63	206,215,413.62
本期利润	-57,694,976.43	22,990,917.74	-34,704,058.69
本期基金份额交易产生的变动数	16,514,779.58	-126,984,512.61	-110,469,733.03
其中：基金申购款	211,068.10	84,248,888.03	84,459,956.13
基金赎回款	16,303,711.48	-211,233,400.64	-194,929,689.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,979,602.86	81,021,224.76	61,041,621.90

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	179,959.09
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	11,834.45
其他	3,724.32
合计	195,517.86

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,255,268,065.69
减：卖出股票成本总额	1,340,177,180.29
减：交易费用	3,407,778.04
买卖股票差价收入	-88,316,892.64

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	734,075.69

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	734,075.69

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	42,140,520.72
——股票投资	42,140,520.72
——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	42,140,520.72

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	456,856.89
转换费收入	1,955.13
合计	458,812.02

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	760.00
合计	120,418.65

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、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	209,483,578.14	9.80%	917,258,176.54	46.62%

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

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 2023年1月1日至2023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	193,390.32	9.76%	65,375.30	8.58%
关联方名称	上年度可比期间 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	845,248.14	46.63%	385,897.62	67.55%

注：1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。
2、股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费和证券结算风险基金等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金比率是公允，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,679,503.12
其中：支付销售机构的客户维护费	421,467.30	598,445.66

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，于次月首日起 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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	524,844.76	813,705.47

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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，于次月首日起 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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	288,942.79	288,942.79
东吴证券股份有限公司	-	74.73	74.73
合计	-	289,017.52	289,017.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	507,192.33	507,192.33
东吴证券股份有限公司	-	80.27	80.27
合计	-	507,272.60	507,272.60

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基

金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金的 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费计提的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
交通银行股份有限公司	22,829,729.28	179,959.09	76,827,880.40	341,379.26

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,975	39,223.50	35,668.50	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	362	8,543.20	23,410.54	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	426	17,035.74	15,638.46	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,023	12,378.30	12,347.61	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	319	11,531.85	12,163.47	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	455	9,946.30	10,851.75	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	337	8,984.42	10,615.50	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	718	8,027.24	10,475.62	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,217	8,007.86	9,224.86	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	327	9,895.02	8,282.91	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
603135	中重	2023 年 3 月	6 个月	新股流	17.80	17.89	440	7,832.00	7,871.60	-

	科技	29 日		通受限						
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	244	8,293.56	7,195.56	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	438	4,537.68	5,185.92	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	413	4,815.58	5,063.38	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	133	3,455.34	3,262.49	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	687	16,329.99	29,465.43	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,162	35,847.70	27,458.06	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	952	25,513.60	21,248.64	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	173	13,286.40	18,675.35	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	275	18,502.00	17,993.25	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	281	12,361.19	14,491.17	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	412	13,324.08	13,126.32	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	58.32	45.36	286	16,679.52	12,972.96	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	422	21,100.00	12,959.62	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	363	8,639.40	11,920.92	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	533	6,332.04	11,203.66	-

301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	203	17,699.85	10,807.72	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	614	12,273.86	10,376.60	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	717	10,618.77	9,844.41	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	460	11,615.00	9,057.40	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	200	7,812.00	7,872.00	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	166	12,192.70	7,742.24	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月以上	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

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因暂时性停牌而流通受限的股票。

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 2023 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 2023 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 2023 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

本基金为混合型基金。本基金投资范围限于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资目标为在充分控制基金资产风险的前提下，通过积极主动的资产配置和多种策略，充分挖掘市场中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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，将风险控制在规定范围之内。

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

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。

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，除在附注 6.4.12 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，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 2023 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	22,829,729.28	-	-	-	-	-	22,829,729.28
结算备付金	1,064,447.61	-	-	-	-	-	1,064,447.61
存出保证金	286,932.84	-	-	-	-	-	286,932.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	230,685,499.68	230,685,499.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,589,611.92	7,589,611.92

应收股利							
应收申购款						155,794.77	155,794.77
其他资产							
资产总计	24,181,109.73					-238,430,906.37	262,612,016.10
负债							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款						7,596,456.82	7,596,456.82
应付赎回款						1,215,240.59	1,215,240.59
应付管理人报酬						170,043.37	170,043.37
应付托管费						53,138.57	53,138.57
应付销售服务费						47,242.02	47,242.02
应交税费							
应付利润							
其他负债						873,137.91	873,137.91
负债总计						9,955,259.28	9,955,259.28
利率敏感度缺口	24,181,109.73					-228,475,647.09	252,656,756.82
上年度末 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	62,313,003.28						62,313,003.28
结算备付金	4,506,978.60						4,506,978.60
存出保证金	456,184.36						456,184.36
交易性金融资产						-638,625,381.99	638,625,381.99
衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收清算款							
应收股利							
应收申购款						1,516,356.78	1,516,356.78
其他资产							
资产总计	67,276,166.24					-640,141,738.77	707,417,905.01
负债							
卖出回购金融资产款							
应付清算款						10,014,731.63	10,014,731.63
应付赎回款						10,017,479.68	10,017,479.68
应付管理人报酬						509,616.79	509,616.79
应付托管费						159,255.26	159,255.26
应付销售服务费						157,511.59	157,511.59
应交税费							
应付利润							
其他负债						2,449,870.03	2,449,870.03
负债总计						23,308,464.98	23,308,464.98

利率敏感度缺口	67,276,166.24	-	-	-	-616,833,273.79	684,109,440.03
---------	---------------	---	---	---	-----------------	----------------

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

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），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，定期存款利息收入与买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；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（2022 年 12 月 31 日：同）。

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。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%。

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	230,685,499.68	91.30	638,625,381.99	93.35
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	230,685,499.68	91.30	638,625,381.99	93.35

注：本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0—95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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，股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规，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	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-3,031,881.08	-8,688,189.89
	2. 业绩基准下跌 5%	-15,159,405.41	-43,440,949.44
	3. 业绩基准下跌 10%	-30,318,810.82	-86,881,898.88

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	230,042,623.70	636,968,738.88
第二层次	-	385,863.40
第三层次	642,875.98	1,270,779.71
合计	230,685,499.68	638,625,381.99

6.4.14.2.2 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。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	230,685,499.68	87.84
	其中：股票	230,685,499.68	87.84
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	23,894,176.89	9.10
8	其他各项资产	8,032,339.53	3.06
9	合计	262,612,016.10	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	224,859,962.23	89.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	48,687.38	0.02
F	批发和零售业	35,327.57	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,125,262.77	0.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,678.28	0.01
M	科学研究和技术服务业	4,255,671.13	1.68
N	水利、环境和公共设施管理业	226,475.29	0.09

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	62,790.86	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	230,685,499.68	91.30

7.2.2 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。

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

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	600862	中航高科	599,000	15,160,690.00	6.00
2	600685	中船防务	482,890	14,462,555.50	5.72
3	601989	中国重工	2,992,300	14,422,886.00	5.71
4	600150	中国船舶	437,158	14,386,869.78	5.69
5	600760	中航沈飞	315,140	14,181,300.00	5.61
6	601890	亚星锚链	1,138,489	13,183,702.62	5.22
7	600482	中国动力	546,400	12,807,616.00	5.07
8	300395	菲利华	235,796	11,601,163.20	4.59
9	002389	航天彩虹	507,100	11,262,691.00	4.46
10	002025	航天电器	173,124	11,045,311.20	4.37
11	000768	中航西飞	405,217	10,839,554.75	4.29
12	603267	鸿远电子	159,000	10,382,700.00	4.11
13	688002	睿创微纳	223,869	10,029,331.20	3.97
14	600893	航发动力	219,337	9,269,181.62	3.67
15	300855	图南股份	247,747	8,750,424.04	3.46
16	002049	紫光国微	82,802	7,721,286.50	3.06
17	000534	万泽股份	450,558	7,555,857.66	2.99
18	600435	北方导航	603,300	6,931,917.00	2.74
19	688439	振华风光	57,774	6,344,740.68	2.51
20	300034	钢研高纳	138,185	5,443,107.15	2.15
21	300416	苏试试验	184,239	3,972,192.84	1.57
22	600764	中国海防	108,317	2,948,388.74	1.17
23	300447	全信股份	27,800	533,482.00	0.21
24	300696	爱乐达	9,927	244,204.20	0.10
25	688333	铂力特	2,294	242,567.56	0.10
26	301356	天振股份	11,038	241,732.20	0.10

27	301325	曼恩斯特	1,727	196,608.35	0.08
28	688066	航天宏图	3,162	192,565.80	0.08
29	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.07
30	301310	鑫宏业	2,747	188,264.61	0.07
31	300634	彩讯股份	6,800	179,520.00	0.07
32	688459	哈铁科技	17,259	166,376.76	0.07
33	603138	海量数据	8,706	165,762.24	0.07
34	301399	英特科技	2,805	164,669.17	0.07
35	301280	珠城科技	4,175	149,298.00	0.06
36	003031	中瓷电子	1,100	146,432.00	0.06
37	002180	纳思达	4,100	140,425.00	0.06
38	301335	天元宠物	5,869	139,916.96	0.06
39	301387	光大同创	2,851	139,504.41	0.06
40	301307	美利信	4,119	138,459.99	0.05
41	301382	蜂助手	3,623	137,887.32	0.05
42	688352	颀中科技	10,230	136,089.69	0.05
43	688137	近岸蛋白	2,588	133,230.24	0.05
44	688146	中船特气	3,181	132,939.87	0.05
45	301246	宏源药业	4,217	131,894.92	0.05
46	301365	矩阵股份	7,740	127,400.40	0.05
47	688111	金山办公	264	124,666.08	0.05
48	688370	丛麟科技	3,254	123,586.92	0.05
49	688593	新相微	7,172	120,903.56	0.05
50	688523	航天环宇	4,542	120,751.18	0.05
51	600399	抚顺特钢	11,500	117,300.00	0.05
52	688433	华曙高科	3,367	113,635.50	0.04
53	301429	森泰股份	4,989	112,367.08	0.04
54	301439	泓淋电力	6,134	108,853.40	0.04
55	301071	力量钻石	2,407	105,908.00	0.04
56	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.04
57	688227	品高股份	4,164	103,392.12	0.04
58	002409	雅克科技	1,410	102,760.80	0.04
59	301332	德尔玛	7,163	101,957.75	0.04
60	688172	燕东微	4,162	98,972.36	0.04
61	301305	朗坤环境	4,597	95,148.37	0.04
62	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.04
63	688570	天玛智控	3,266	86,577.87	0.03
64	600456	宝钛股份	2,548	86,224.32	0.03
65	301326	捷邦科技	2,264	86,099.92	0.03

66	301323	新莱福	1,992	85,376.00	0.03
67	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.03
68	600522	中天科技	5,000	79,550.00	0.03
69	301345	涛涛车业	1,657	78,877.85	0.03
70	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.03
71	301276	嘉曼服饰	3,026	77,163.00	0.03
72	688479	友车科技	2,433	76,083.39	0.03
73	688151	华强科技	3,475	70,959.50	0.03
74	688448	磁谷科技	1,985	67,946.55	0.03
75	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.02
76	601668	中国建筑	7,600	43,624.00	0.02
77	301267	华夏眼科	640	39,008.00	0.02
78	688249	晶合集成	1,975	35,668.50	0.01
79	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
80	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.01
81	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
82	301358	湖南裕能	687	29,465.43	0.01
83	301260	格力博	1,162	27,458.06	0.01
84	301236	软通动力	918	24,978.78	0.01
85	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
86	688361	中科飞测	362	23,410.54	0.01
87	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.01
88	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
89	301102	兆讯传媒	844	22,678.28	0.01
90	301303	真兰仪表	952	21,248.64	0.01
91	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
92	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.01
93	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
94	301216	万凯新材	1,050	17,461.50	0.01
95	301139	元道通信	566	16,351.74	0.01
96	688484	南芯科技	426	15,638.46	0.01
97	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.01
98	301408	华人健康	879	14,899.05	0.01
99	301361	众智科技	517	14,574.23	0.01
100	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
101	301200	大族数控	354	14,117.52	0.01
102	603162	海通发展	774	13,196.70	0.01
103	301277	新天地	659	12,857.09	0.01
104	301151	冠龙节能	703	12,422.01	0.00

105	001287	中电港	533	11,203.66	0.00
106	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
107	301322	绿通科技	203	10,807.72	0.00
108	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
109	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
110	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
111	301135	瑞德智能	338	9,267.96	0.00
112	601061	中信金属	1,217	9,224.86	0.00
113	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
114	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
115	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
116	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
117	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
118	301189	奥尼电子	261	7,983.99	0.00
119	300834	星辉环材	326	7,954.40	0.00
120	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
121	603135	中重科技	440	7,871.60	0.00
122	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
123	301237	和顺科技	261	7,749.09	0.00
124	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
125	301196	唯科科技	163	5,533.85	0.00
126	601065	江盐集团	438	5,185.92	0.00
127	601133	柏诚股份	413	5,063.38	0.00
128	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
129	603125	常青科技	133	3,262.49	0.00
130	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
131	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
132	600416	湘电股份	15	286.35	0.00

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	002389	航天彩虹	35,271,515.00	5.16
2	300395	菲利华	30,977,565.62	4.53
3	688002	睿创微纳	30,034,934.19	4.39
4	600862	中航高科	28,046,364.48	4.10

5	603267	鸿远电子	27,630,650.00	4.04
6	002025	航天电器	27,297,755.00	3.99
7	605123	派克新材	27,119,305.00	3.96
8	600893	航发动力	26,663,459.25	3.90
9	688172	燕东微	26,158,222.39	3.82
10	688375	国博电子	24,357,080.95	3.56
11	000065	北方国际	23,695,311.40	3.46
12	688066	航天宏图	23,566,214.13	3.44
13	600685	中船防务	23,074,779.43	3.37
14	688385	复旦微电	22,883,984.26	3.35
15	600416	湘电股份	21,975,839.26	3.21
16	300699	光威复材	21,181,652.00	3.10
17	601989	中国重工	19,872,880.00	2.90
18	001270	铖昌科技	19,433,319.48	2.84
19	300034	钢研高纳	17,930,757.55	2.62
20	301117	佳缘科技	17,564,920.48	2.57
21	600760	中航沈飞	17,397,240.00	2.54
22	300114	中航电测	17,249,725.00	2.52
23	600150	中国船舶	16,420,590.17	2.40
24	300474	景嘉微	15,730,505.80	2.30
25	300416	苏试试验	15,547,673.90	2.27
26	003031	中瓷电子	15,231,721.00	2.23
27	688568	中科星图	15,222,544.38	2.23
28	000768	中航西飞	15,179,068.45	2.22
29	000534	万泽股份	14,635,845.74	2.14
30	688439	振华风光	14,621,501.98	2.14
31	301306	西测测试	14,431,546.96	2.11
32	688682	霍莱沃	14,035,818.29	2.05

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	300416	苏试试验	57,222,046.76	8.36

2	600765	中航重机	55,785,675.89	8.15
3	002025	航天电器	51,656,046.00	7.55
4	000733	振华科技	49,898,383.78	7.29
5	300395	菲利华	47,158,390.25	6.89
6	688066	航天宏图	45,022,442.05	6.58
7	002049	紫光国微	42,625,471.45	6.23
8	688385	复旦微电	42,160,716.23	6.16
9	688122	西部超导	39,082,194.23	5.71
10	600760	中航沈飞	38,247,704.85	5.59
11	300593	新雷能	35,047,539.76	5.12
12	600150	中国船舶	34,745,031.82	5.08
13	300855	图南股份	33,040,113.86	4.83
14	300034	钢研高纳	30,819,217.55	4.51
15	688333	铂力特	29,587,365.36	4.32
16	688439	振华风光	28,885,983.70	4.22
17	688172	燕东微	27,200,115.22	3.98
18	000065	北方国际	26,892,646.72	3.93
19	605123	派克新材	26,139,434.00	3.82
20	600416	湘电股份	23,925,519.20	3.50
21	688002	睿创微纳	22,735,560.80	3.32
22	002389	航天彩虹	22,678,246.34	3.32
23	688375	国博电子	22,433,297.03	3.28
24	300699	光威复材	21,927,002.00	3.21
25	688270	臻镭科技	21,599,224.10	3.16
26	688311	盟升电子	21,197,194.37	3.10
27	300114	中航电测	18,726,995.00	2.74
28	000738	航发控制	17,833,442.16	2.61
29	300474	景嘉微	17,518,023.30	2.56
30	001270	铖昌科技	17,128,024.12	2.50
31	600893	航发动力	16,955,872.70	2.48
32	603267	鸿远电子	16,377,218.07	2.39
33	003031	中瓷电子	15,547,773.00	2.27
34	688568	中科星图	15,365,343.64	2.25
35	301117	佳缘科技	15,251,903.88	2.23

注：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	890,096,777.26
卖出股票收入（成交）总额	1,255,268,065.69

注：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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有贵金属投资。

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投资。

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持有股指期货。

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。

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	286,932.84
2	应收清算款	7,589,611.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	155,794.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,032,339.53

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
东吴多策略混合 A	9,589	6,674.72	8,134,638.63	12.71%	55,869,266.77	87.29%
东吴多策略混合 C	14,012	5,195.39	20,333,141.60	27.93%	52,464,669.32	72.07%
合计	23,601	5,796.44	28,467,780.23	20.81%	108,333,936.09	79.19%

注：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	东吴多策略混合 A	17,500.98	0.0273%
	东吴多策略混合 C	3,546.89	0.0049%
	合计	21,047.87	0.0154%

注：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，比例的分母采用基金份额的合计数。

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、基金投资和研发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	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 13 日）基金 份额总额	215,437,775.44	-
本报告期期初基金份额总额	135,769,164.48	200,014,042.11
本报告期基金总申购份额	12,281,090.98	87,900,235.81
减：本报告期基金总赎回份额	84,046,350.06	215,116,467.00
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	64,003,905.40	72,797,810.92

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。

3、本基金于 2021 年 4 月 14 日开始分为 A、C 两类。

§ 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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2023 年 3 月 30 日经东吴基金管理有限公司第四届董事会 2023 年第 1 次临时会议审议通过，聘任李杰同志为东吴基金管理有限公司副总经理，2023 年 4 月 4 日完成相关手续后，正式履职。

2、2023 年 6 月 2 日经东吴基金管理有限公司第四届董事会第三次会议审议通过，聘任李素明同志为东吴基金管理有限公司董事、总经理兼财务负责人、法定代表人，2023 年 6 月 6 日完成相关手续后，正式履职；陈军先生不再代任公司总经理，不再担任公司董事及法定代表人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	

广发证券	3	958,169,028.34	44.81%	890,872.37	44.95%	-
华融证券	2	362,123,196.76	16.94%	333,623.89	16.83%	-
长江证券	2	354,968,958.32	16.60%	330,580.31	16.68%	-
开源证券	1	253,422,480.32	11.85%	233,478.38	11.78%	-
东吴证券	2	209,483,578.14	9.80%	193,390.32	9.76%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期交易单元无变更。

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

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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 2022 年年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2023 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司行 E 通平台为代销机构、开通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	2023 年 1 月 11 日
3	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	公司网站、中证信息网站	2023 年 1 月 20 日
4	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	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	2023 年 1 月 20 日
5	东吴基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告	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	2023 年 2 月 3 日
6	东吴基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2023 年 2 月 10 日

	参加上海好买基金销售有限公司申购补差费率优惠的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
7	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银银平台为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023 年 2 月 16 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为代销机构、开通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	2023 年 2 月 27 日
9	东吴基金管理有限公司关于经营证券期货业务许可证（副本）遗失公告	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	2023 年 3 月 8 日
10	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2022 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	2023 年 3 月 31 日
11	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2023 年 3 月 31 日
12	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	2023 年 4 月 4 日
13	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
14	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2023 年 4 月 21 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资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	2023 年 5 月 20 日
16	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台关闭建行网银直连支付的公告	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	2023 年 5 月 26 日

17	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	2023 年 6 月 7 日
18	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台关闭招商银行网银直连支付的公告	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	2023 年 6 月 8 日
19	东吴基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告	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	2023 年 6 月 28 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京证券股份有限公司为代销机构、开通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	2023 年 6 月 30 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内需增长混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴内需增长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 8、报告期内东吴多策略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。

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

2023 年 8 月 31 日