

东吴新经济混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	20
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
§6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 净资产变动表.....	27
7.4 报表附注.....	29
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	76
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴新经济混合型证券投资基金	
基金简称	东吴新经济混合	
基金主代码	580006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 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	
报告期末基金份额总额	130,413,185.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴新经济混合 A	东吴新经济混合 C
下属分级基金的交易代码:	580006	012617
报告期末下属分级基金的份额总额	89,539,913.51 份	40,873,272.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过投资于引领经济发展未来方向的新兴行业的上市公司，享受新经济发展带来的高成长和高收益。重点投资其中具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，根据自上而下对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，在遵循前述本基金资产配置总体比例限制范围内，确定基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的具体投资比例。根据科学技术和产业的发展趋势对与新经济相关创新技术、典型产业进行识别。随后自下而上地精选代表新经济的典型上市公司和与新经济密切相关的上市公司，针对两类公司的不同特征，充分考虑公司的成长性，运用东吴基金企业竞争优势评价体系进行评价，构建股票池。投资具有成长优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
业绩比较基准	75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

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	王小飞
	联系电话	021-50509888-8308	021-60637103
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	021-60637228
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	李素明	田国立

注：基金管理人于 2023 年 6 月 28 日发布关于公司法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为李素明先生。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2023 年		2022 年		2021 年	
	东吴新经济混合 A	东吴新经济混合 C	东吴新经济混合 A	东吴新经济混合 C	东吴新经济混合 A	东吴新经济混 合 C
本期 已实 现收 益	-61,929,880.57	-30,009,181.89	-50,809,173.36	-14,597,451.42	28,887,662.00	1,471,927.62
本期 利润	-48,209,926.72	-24,111,266.53	-57,129,515.99	-25,868,092.81	29,700,741.30	-671,657.41
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.5059	-0.5253	-0.6892	-0.8673	0.6250	-0.1753
本期 加权 平均 净值 利润 率	-49.83%	-52.40%	-43.18%	-53.43%	33.34%	-8.52%
本期 基金 份额 净值 增长 率	-38.28%	-38.53%	-34.53%	-34.79%	39.51%	19.59%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	期末 可供 分配 利润	-19,005,375.34	-11,153,824.64	25,029,332.88	8,915,107.95	68,350,519.16

期末可供分配基金份额利润	-0.2123	-0.2729	0.2763	0.2698	0.9495	0.9472
期末基金资产净值	70,534,538.17	31,904,331.09	115,606,213.14	41,962,808.60	140,339,521.92	15,335,621.76
期末基金份额净值	0.7877	0.7806	1.2763	1.2698	1.9495	1.9472
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	9.16%	-52.06%	76.86%	-22.01%	170.15%	19.59%

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

东吴新经济混合 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
过去三个月	-10.60%	1.34%	-4.89%	0.59%	-5.71%	0.75%
过去六个月	-22.49%	1.52%	-7.48%	0.63%	-15.01%	0.89%
过去一年	-38.28%	1.49%	-7.23%	0.63%	-31.05%	0.86%
过去三年	-43.63%	2.20%	-21.86%	0.83%	-21.77%	1.37%
过去五年	10.63%	1.97%	16.58%	0.91%	-5.95%	1.06%
自基金合同生效起至今	9.16%	1.70%	16.19%	1.04%	-7.03%	0.66%

东吴新经济混合 C

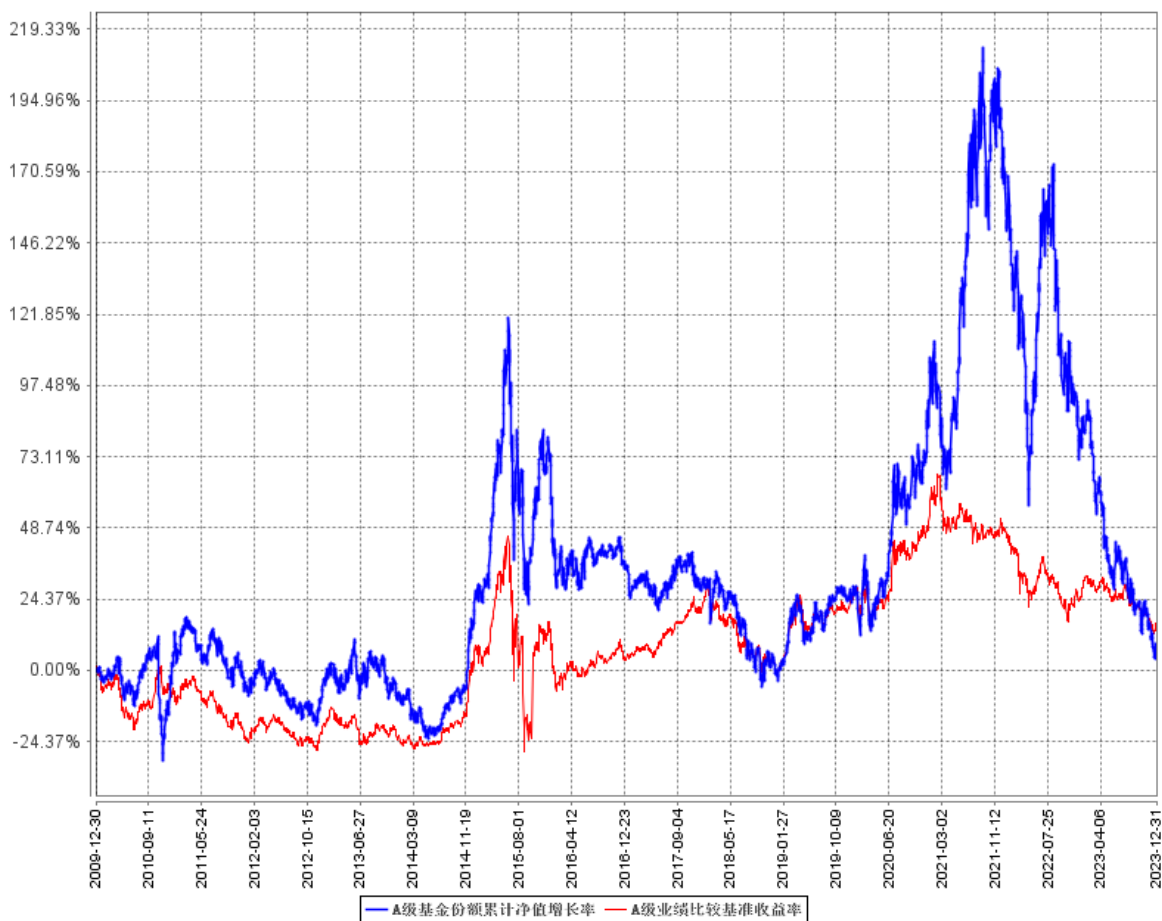
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.68%	1.34%	-4.89%	0.59%	-5.79%	0.75%
过去六个月	-22.64%	1.52%	-7.48%	0.63%	-15.16%	0.89%
过去一年	-38.53%	1.49%	-7.23%	0.63%	-31.30%	0.86%
自基金合同生效起至今	-52.06%	2.18%	-22.62%	0.80%	-29.44%	1.38%

注：1 比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

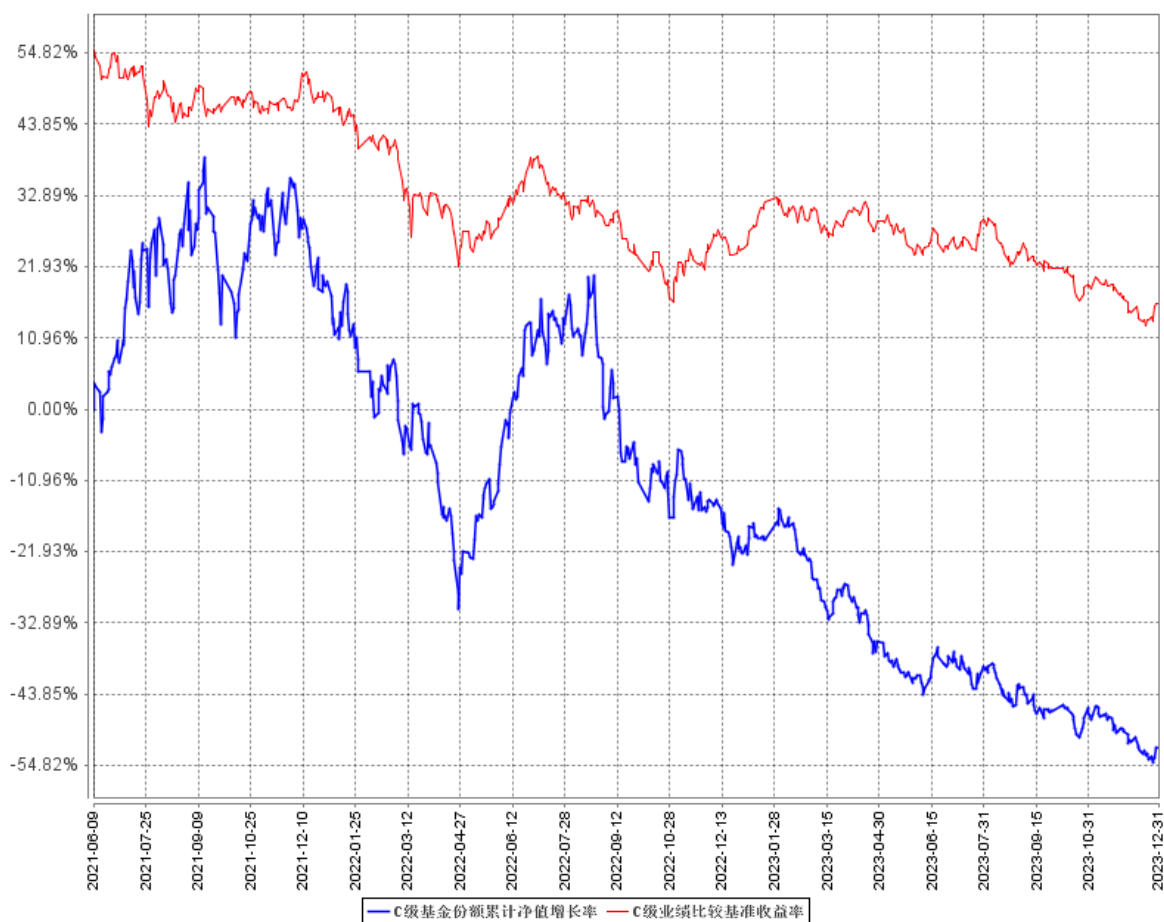
2 本基金于 2021 年 6 月 9 日开始分为 A、C 两类。

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

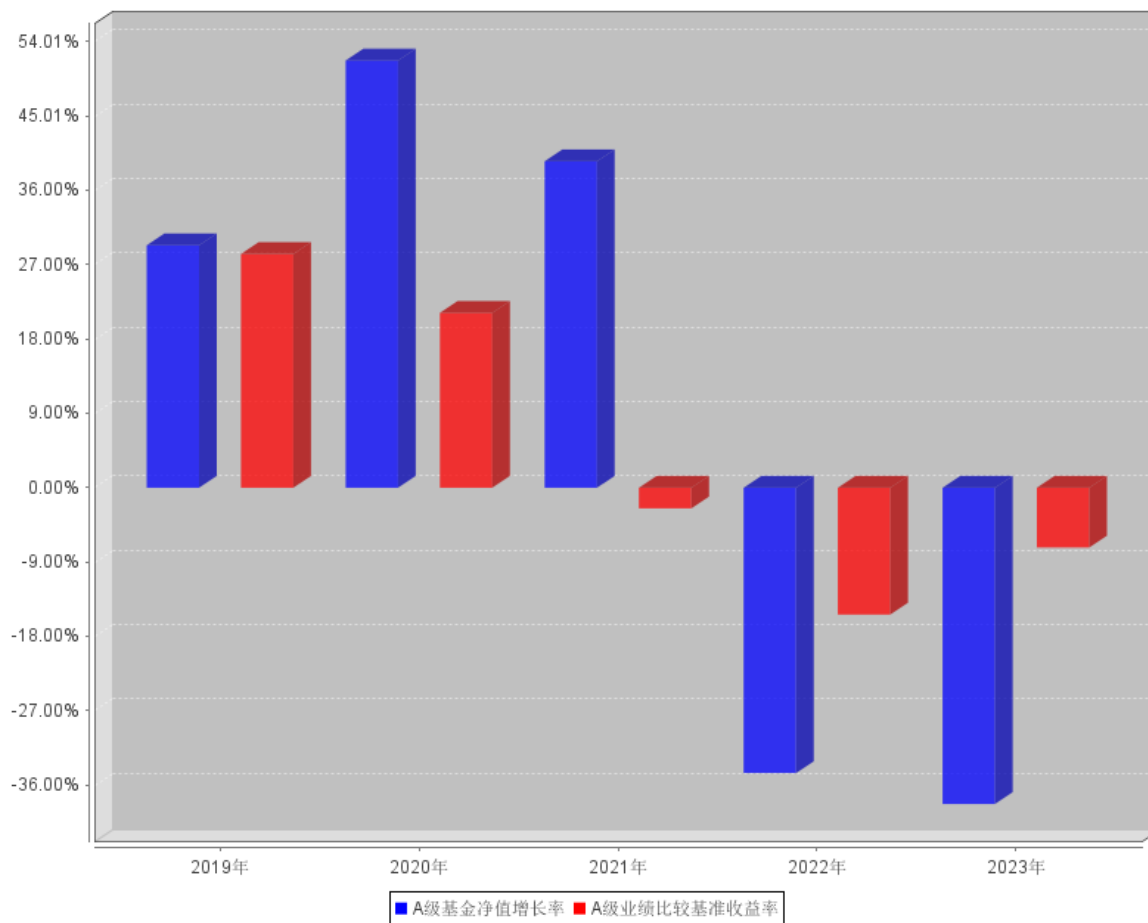


注：1 比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

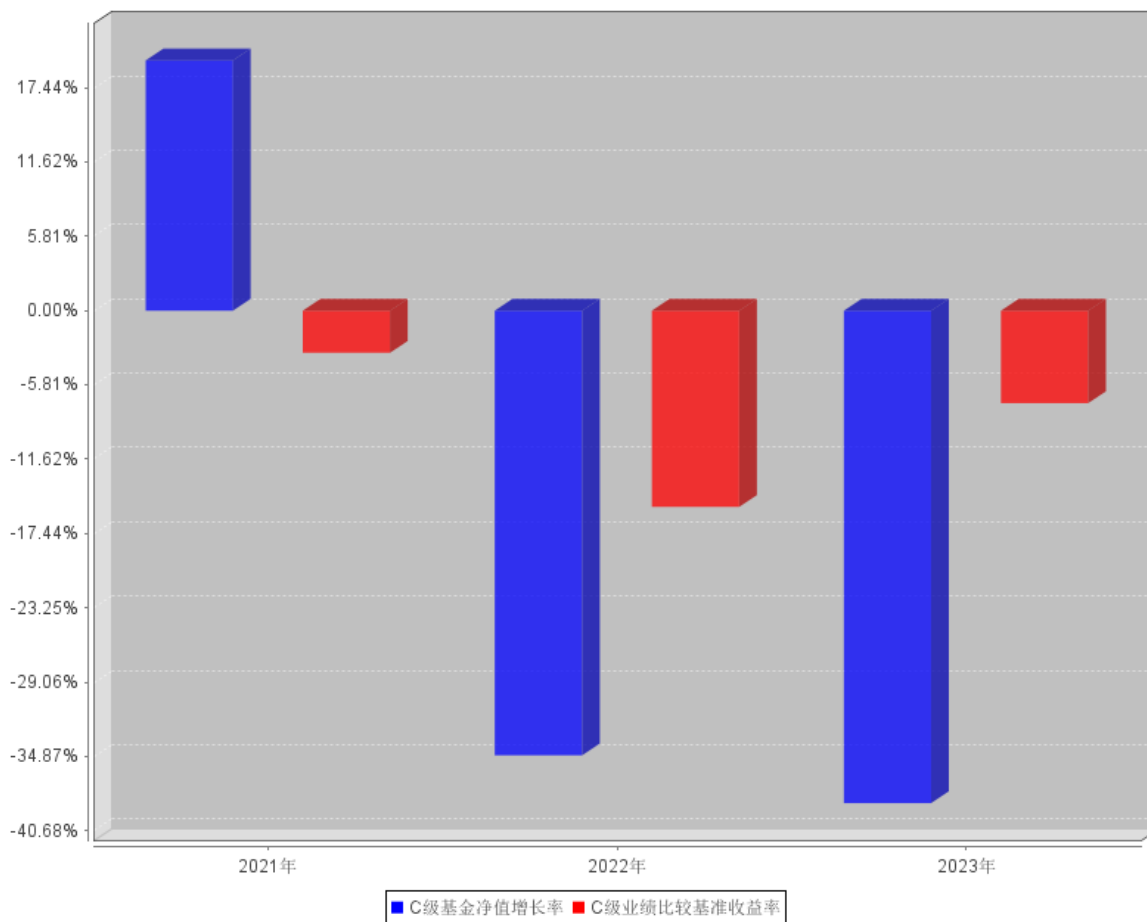
2 本基金于 2021 年 6 月 9 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1 比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

2 本基金于 2021 年 6 月 9 日开始分为 A、C 两类。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地为上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 901、902 室。目前由东吴证券股份有限公司和海澜集团有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、私募资产管理业务协同发展,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		
丁戈	基金经理	2021年12月2日	-	11年	丁戈先生,中国国籍,北京大学政治经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职中银基金管理有限公司研究员。2020年9月加入东吴基金管理有限公司任专户投资经理,现任基金经理。2021年12月2日至今担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理,2021年12月15日至今担任东吴阿尔法灵活配置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日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对公司旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年是 A 股权益市场与公募基金困难与机遇并存的一年。成长行业中，同时兼具产业浪潮

的人工智能行业在 A 股大起大落，先抑后扬的产业链续写下半年的结构性机会。贯穿全年，防御属性更强的低波红利资产走出了第五年的强势行情。本基金专注于成长行业投资，在房地产回落，流动性收紧，经济强预期弱现实的大环境下，产品业绩表现不佳，给持有人带来了损失。当下，如何能给持有人挽回损失，把握 2024 年的机会，是当务之急。

当前市场背景和资金面类似 2019 年初，稳增长政策密集发布。2023 年末，PMI 连续 3 个月回落于荣枯线下方，12 月高频数据显示百城土地成交面积和 30 城商品房成交面积增加，汽车批发零售销量走强，出口综合指数环比上涨。经济转型下，房地产销售和开发投资的负增长阶段性影响消费，价格维持底部阶段。稳增长政策提出“先立后破”、“以进促稳”等方针，重在呵护修复经济预期。

虽然美联储议息会议对 3 月降息表达了不确定性，但海外整体流动性偏宽松，海外科技龙头在季报期间屡创新高。2023 年 A 股上市公司业绩快报陆续披露后，企业均表达了对 2024 年盈利回升的信心，但这一过程可能会比较曲折，呈现前低后高的环增态势。在整体风险偏好较弱的情况下，市场易对利空反应敏感，A 股走势整体以防御开局。

纵观全球，科技创新已进入产品侧，无论是海外科技龙头在端侧的创新、升级，还是拉斯维加斯电子展上展出的人工智能终端、虚拟现实眼镜，都指引着熊彼特式增长，即创新发明带动的效率提升有望迅速在全球铺开。

国内，活跃资本市场提振投资者信心，加强上市公司质量管理，控制融券转融通做空，以及救市资金入市都表达了呵护市场的决心，有力地传递了管理层的积极信号。一线城市房地产的限售逐步打开，融资端的政策逐步落地，双降预期的引导，我们认为，政策底或已基本确立。随着中长期资金在政策鼓励下逐步入市，市场有望企稳，相较于过去存量博弈下的高速行业轮动，未来在基本面触底及科技创新叠加下，2024 年市场有望走出结构性修复行情。

当前，A 股市场对经济有别于 2023 年的强预期弱现实，普遍呈现较为保守的弱预期弱现实。而我们复盘过去历史 9 次市场见底时的特征可以看到，呵护政策的陆续出台，经济基本盘的稳定，海内外宽松政策的释放，有望引领市场走出悲观氛围。2024 年，在房地产修正逐步企稳的背景下，中国式现代化与高质量发展驱动的新质生产力，是成长行业投资的基石。当前 A 股风险偏好下降到比较极端水平，A 股行业公司估值、风险溢价比均处于历史相对较高性价比位置，权益市场有望具备投资机会。确定性的科技产业周期，叠加终端创新，也有望为权益市场科技行业带来投资机会。

全球消费电子已长期处于相对底部区间，伴随新技术在产品端的应用以及渗透提升，消费电子创新有望带动行业回暖。根据 IDC、Gartner、WSTS 数据显示，手机、PC 销售有望于 2024 年销

售回暖，未来三年有望保持在复合增速 4%以上。以海内外头部公司为代表的新品发布，有望再度开启新一轮的投资周期，对应新技术的渗透曲线投资机会。在 AIPC、AI 手机、MR 等端侧创新上，消费电子供应链有望进入新一轮的成长阶段。2020 年后 PC 行业已具备换机基础，PC 作为重要的生产力工具在 AI 的端侧赋能下，我们看到部分公司推出的升级产品，有望从本地化模型提升生产效率。AI 手机、AI 耳机、AI 音箱、AI 眼镜等落地于可触达的 AI Agent，作为相对较佳入口我们已经看到已有公司推出相应产品，期待更多公司推出爆款产品，带动形成新一轮换机周期。在 MR 产品上，我们也看到有公司 7 年磨一剑的产品发布，并且其他公司有望迅速跟进。新一代的图形处理、显示技术、手势识别、空间计算有望重新定义产业，打开新的成长空间，关注 2024CES 上的产品发布。同时 Open Harmony、Harmony OS 有望带来新的生态系投资机会。

在人工智能的技术驱动下，半导体周期有望见底，销售额有望回正。根据 IDC、Gartner、WSTS 数据显示，半导体销售额在集成电路、光学、分立器件等拉动下，实现双位数增长，其中贡献力度最大的是逻辑电路和存储。其中，参考 T 公司财报说明会，未来 HPC 与 AI 有望实现复合 50% 增长，对应的逻辑电路芯片是 GPU 为代表的加速卡。AIPC、AI 手机在换机周期到来时，有望带动存储容量翻倍式增长。AI 硬件、应用创新有望打破生产率瓶颈，带动全社会生产力进入新一轮效率提升周期。国内层面，政策在补短板锻长板方面有望持续推动关键技术突破，形成包括先进制程、成熟制程、存储、半导体设备及材料等多维投资机会。

新能源汽车作为我国优势产业，随着渗透率的提升，已明确进入智能化竞争的下半场。随着海外公司的 FSD 技术突破，国内公司的产品矩阵展开，汽车智能化有望开启新一轮的投资机会。端到端技术和多模态大模型在车端赋能智能驾驶的同时，产业链及技术也可复用于人形机器人等智能载体，在《人形机器人创新发展指导意见》等产业政策的促进下，设备、零部件供应链公司也有望具备投资机会。

2024 年成长股开局困难，我们有信心随着经济基本面的修复，市场风险偏好有望得到改善，代表未来我国经济高质量发展方向的科技行业有望具备较大的投资机会，本产品将致力于为投资人发掘优质成长行业及公司，助力中国经济转型与发展。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴新经济混合 A 基金份额净值为 0.7877 元，本报告期基金份额净值增长率为-38.28%；截至本报告期末东吴新经济混合 C 基金份额净值为 0.7806 元，本报告期基金份额净值增长率为-38.53%；同期业绩比较基准收益率为-7.23%。

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，参考 wind 数据，2023 全年 GDP 增长 5.2%，超额完成年初 5.0%左右的目标。

展望 2024 年，我们判断，国内经济预计可能延续温和复苏，政策可能持续发力。具体而言，2024 年 GDP 目标预计在 5% 左右。2024 年我国经济增长动力或主要源于以下三个方面：（1）消费可能延续温和、自然修复。核心逻辑有：一、居民收入仍趋回升，历史上看，居民收入增速跟名义 GDP 增速走势接近，2024 年名义 GDP 增速可能有所回升，意味着居民收入有望趋于上行。二、随着时间推移，疫情的“疤痕效应”逐渐弱化，居民消费意愿有望边际修复。（2）房地产投资降幅可能收窄。2023 年房地产投资同比-9.6%，是经济重要的拖累。如果参考当前的地产开工面积、房企拿地等领先指标，预计 2024 年地产投资可能延续偏弱。但是保障房建设、城中村改造、平急两用基础设施建设等“三大工程”可能提供额外增量，预期“三大工程”年均规模可能约为 8000-12000 万亿，对应可能额外拉动地产投资约 7.3-10.9 个百分点。（4）出口增速有望转正。2023 年我国商品和货物出口同比-4.6%，同样也是宏观经济的重要拖累。我们判断，2023 年拖累出口的各项因素在 2024 年预计都有望有所好转，包括海外从去库转为补库、全球半导体销售周期上行，都可能带来出口额外的增量。随着国内 PPI 中枢回升，出口价格拖累也可能弱化，叠加 2023 年基数偏低，预计 2024 年出口增速可能小幅转正。此外，2024 年财政支出节奏、实物工作量形成大概率“双重前置”，以及出口改善等，基建、制造业投资可能仍会保持偏高增速。

宏观政策层面，鉴于 2024 年国内经济可能仍有下行压力，我们判断宏观政策大概率继续偏宽松，国内有望“中央加杠杆”，中美货币政策可能从分化逐步走向一致。具体而言，货币政策方面，宽松仍有望是方向，2024 年全年有望降准、降息。此外，结构性货币政策工具有望持续发力、精准发力，PSL 可能保持偏高规模，央行也可能会继续“充实货币政策工具箱”。财政政策方面，全年赤字率大概率高于 3%。可能发行特别国债，新增专项债规模有望达到 3.8 万亿，甚至更高，准财政工具可能继续发力，加上 2023 年增发的 1 万亿国债中有 5000 亿结转 2024 年使用，2024 年广义赤字规模预计可能高于 2023 年，“中央加杠杆”特征明显。海外方面，2020 年 3 月以来美联储持续加息，联邦基金目标利率从 2020 年 3 月的 0.25% 加至 2023 年 7 月的 5.5%，加息幅度达到 525bp。2023 年继续加息，幅度达到 100bp，对国内货币政策和资本流动有一定掣肘。整体看，2024 年美国通胀中枢可能趋于回落，美联储大概率从加息转为降息，中美货币政策可能从过去 3 年的分化逐步走向一致，国内货币政策面临的制约也可能有所弱化。

展望 2024 年，我们对 A 股市场不悲观。沪深 300 指数从 2021 年 1 月见顶回落最大调整幅度 46% 左右，调整时间接近 3 年，估值基本到了历史相对低分位数，并且 2024 年 A 股上市公司利润增速有望进入上行周期。因此，我们认为当前 A 股市场中长期投资价值可能相对比较明显，或值得投资者关注。

我们从两个维度相对看好 A 股的投资机会。一是确定性较强的防御型股票。在经济下台阶的

过程中，根据日本的经验，相对收益来源于红利与出海，其中出海的优势产业在海外需求确定，或者参与到海外供应链当中可能有较强的阿尔法收益。二是有产业景气的成长行业。科技成长是比较值得关注的方向。全球 AI 浪潮下，随着未来终端爆款的推出，消费电子有望是受益的行业。随着智能驾驶的逐步渗透，受益于汽车智能化的整车和零部件也有望是未来的景气方向。美国国债收益率大幅下行，目前一致预期今年美国降息幅度可能在 150 个 BP 左右，基准利率的大幅下行与半导体行业呈现较显著相关性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。重点关注基金投资研究交易、市场销售以及运营等环节的合法合规和风险控制，及时发现需要完善的业务环节，与相关部门沟通并向公司管理层报告，根据要求定期向公司治理层及监管部门报送相关情况报告。

同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。

本基金管理人将不断深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70072926_B06 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴新经济混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了东吴新经济混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴新经济混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴新经济混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴新经济混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>东吴新经济混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估东吴新经济混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

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

	陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈露	金健
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	9,765,455.33	7,141,031.37
结算备付金		1,053,959.89	1,647,483.21
存出保证金		82,309.81	213,978.63
交易性金融资产	7.4.7.2	92,439,562.23	150,670,951.24
其中：股票投资		92,439,562.23	140,468,822.47
基金投资		-	-
债券投资		-	10,202,128.77
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		794,875.20	175,722.79
应收股利		-	-
应收申购款		135,690.66	194,766.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		104,271,853.12	160,043,934.15
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		665,395.85	1,052,011.57
应付管理人报酬		105,971.55	218,172.90
应付托管费		17,661.93	36,362.13
应付销售服务费		11,084.98	16,206.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,032,869.55	1,152,159.73
负债合计		1,832,983.86	2,474,912.41
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	130,413,185.53	123,624,580.91
未分配利润	7.4.7.8	-27,974,316.27	33,944,440.83
净资产合计		102,438,869.26	157,569,021.74
负债和净资产总计		104,271,853.12	160,043,934.15

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，东吴新经济混合 A 基金份额净值 0.7877 元，基金份额总额 89,539,913.51 份；东吴新经济混合 C 基金份额净值 0.7806 元，基金份额总额 40,873,272.02 份。东吴新经济混合份额总额合计为 130,413,185.53 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-69,612,235.20	-79,494,305.47
1.利息收入		72,574.69	80,883.15
其中：存款利息收入	7.4.7.9	72,574.69	80,883.15
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-89,558,186.52	-63,064,895.41
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-90,315,954.47	-63,707,607.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-11,098.77	76,029.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	768,866.72	566,682.26
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）	7.4.7.15	19,617,869.21	-17,590,984.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	255,507.42	1,080,690.81
减：二、营业总支出		2,708,958.05	3,503,303.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,993,522.98	2,673,514.93
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	332,253.83	445,585.88
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	183,816.24	187,948.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	3.81
8. 其他费用	7.4.7.18	199,365.00	196,250.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-72,321,193.25	-82,997,608.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-72,321,193.25	-82,997,608.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-72,321,193.25	-82,997,608.80

7.3 净资产变动表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	123,624,580.91	33,944,440.83	157,569,021.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	123,624,580.91	33,944,440.83	157,569,021.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,788,604.62	-61,918,757.10	-55,130,152.48
（一）、综合收益总额	-	-72,321,193.25	-72,321,193.25
（二）、本期基金份	6,788,604.62	10,402,436.15	17,191,040.77

额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	158,786,797.23	17,042,203.92	175,829,001.15
2.基金赎回款	-151,998,192.61	-6,639,767.77	-158,637,960.38
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	130,413,185.53	-27,974,316.27	102,438,869.26
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	79,864,846.05	75,810,297.63	155,675,143.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	79,864,846.05	75,810,297.63	155,675,143.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,759,734.86	-41,865,856.80	1,893,878.06
（一）、综合收益总额	-	-82,997,608.80	-82,997,608.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	43,759,734.86	41,131,752.00	84,891,486.86
其中：1.基金申购款	326,264,288.88	227,060,836.05	553,325,124.93
2.基金赎回款	-282,504,554.02	-185,929,084.05	-468,433,638.07
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	123,624,580.91	33,944,440.83	157,569,021.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>李素明</u>	<u>李素明</u>	<u>骆银</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴新经济混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1024号《关于核准东吴新经济股票型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于2009年12月30日正式生效，首次设立募集规模为800,855,129.16份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，东吴基金管理有限公司决定自2015年8月7日起，将“东吴新经济股票型证券投资基金”更名为“东吴新经济混合型证券投资基金”，基金类别“股票型基金”变更为“混合型基金”。

根据2021年6月8日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴新经济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6月9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《东吴新经济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：580006；C类基金份额代码：012617）。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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证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。对于中国证监会允许投资的其他金

融工具，将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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法》、《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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	9,765,455.33	7,141,031.37
等于：本金	9,764,067.53	7,140,027.23
加：应计利息	1,387.80	1,004.14
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	9,765,455.33	7,141,031.37

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	87,956,210.61	-	92,439,562.23	4,483,351.62	
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	87,956,210.61	-	92,439,562.23	4,483,351.62	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	155,585,370.06	-	140,468,822.47	-15,116,547.59	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	10,017,970.00	202,128.77	10,202,128.77	-17,970.00
	合计	10,017,970.00	202,128.77	10,202,128.77	-17,970.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	165,603,340.06	202,128.77	150,670,951.24	-15,134,517.59	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付赎回费	831.01	1,312.04
应付交易费用	860,038.54	971,847.69
其中：交易所市场	860,038.54	971,847.69
银行间市场	-	-
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
应付审计费	43,000.00	50,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	1,032,869.55	1,152,159.73

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴新经济混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,576,880.26	90,576,880.26
本期申购	62,114,633.27	62,114,633.27
本期赎回（以“-”号填列）	-63,151,600.02	-63,151,600.02
本期末	89,539,913.51	89,539,913.51

金额单位：人民币元

东吴新经济混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,047,700.65	33,047,700.65

本期申购	96,672,163.96	96,672,163.96
本期赎回（以“-”号填列）	-88,846,592.59	-88,846,592.59
本期末	40,873,272.02	40,873,272.02

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴新经济混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,955,046.22	-24,925,713.34	25,029,332.88
本期期初	49,955,046.22	-24,925,713.34	25,029,332.88
本期利润	-61,929,880.57	13,719,953.85	-48,209,926.72
本期基金份额交易产生的变动数	4,046,523.43	128,695.07	4,175,218.50
其中：基金申购款	19,497,821.03	-12,566,801.68	6,931,019.35
基金赎回款	-15,451,297.60	12,695,496.75	-2,755,800.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,928,310.92	-11,077,064.42	-19,005,375.34

单位：人民币元

东吴新经济混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,120,318.77	-3,205,210.82	8,915,107.95
本期期初	12,120,318.77	-3,205,210.82	8,915,107.95
本期利润	-30,009,181.89	5,897,915.36	-24,111,266.53
本期基金份额交易产生的变动数	6,735,038.48	-507,820.83	6,227,217.65
其中：基金申购款	12,258,267.61	-2,147,083.04	10,111,184.57
基金赎回款	-5,523,229.13	1,639,262.21	-3,883,966.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,153,824.64	2,184,883.71	-8,968,940.93

7.4.7.9 存款利息收入

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	48,973.56	57,722.70
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	20,968.77	21,062.07
其他	2,632.36	2,098.38

合计	72,574.69	80,883.15
----	-----------	-----------

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
卖出股票成交总额	1,949,981,626.89	1,900,359,581.88
减：卖出股票成本总额	2,034,744,413.26	1,958,263,559.00
减：交易费用	5,553,168.10	5,803,630.02
买卖股票差价收入	-90,315,954.47	-63,707,607.14

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	6,871.23	90,973.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-17,970.00	-14,944.44
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	-11,098.77	76,029.47

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,209,000.00	7,651,407.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,017,970.00	7,656,492.42
减：应计利息总额	209,000.00	9,622.35
减：交易费用	-	237.19
买卖债券差价收入	-17,970.00	-14,944.44

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	768,866.72	566,682.26
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	768,866.72	566,682.26

7.4.7.15 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	19,617,869.21	-17,590,984.02
——股票投资	19,599,899.21	-17,573,014.02
——债券投资	17,970.00	-17,970.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	19,617,869.21	-17,590,984.02

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	250,635.60	1,072,568.12
基金转换费收入	4,871.82	8,122.69
合计	255,507.42	1,080,690.81

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
审计费用	43,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	25,500.00
银行汇划费	365.00	750.00
其他	-	-
合计	199,365.00	196,250.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国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
海澜集团有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	2,326,544,426.09	59.43%	2,202,213,583.34	56.98%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	-	-	3,406,596.40	23.08%

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	2,156,684.37	59.23%	520,331.59	60.50%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	2,035,201.78	56.96%	702,146.02	72.25%

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

本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,993,522.98	2,673,514.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	801,889.06	991,876.28
应支付基金管理人的净管理费	1,191,633.92	1,681,638.65

注：2023 年 7 月 31 日前，本基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 31 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	332,253.83	445,585.88

注：2023 年 7 月 31 日前，本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 31 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴新经济混合 A	东吴新经济混合 C	合计
东吴证券股份有限公司	-	60.63	60.63
东吴基金管理有限公司	-	1,243.21	1,243.21
合计	-	1,303.84	1,303.84
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴新经济混合 A	东吴新经济混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	40,198.56	40,198.56
合计	-	40,198.56	40,198.56

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 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期及上年度可比期间均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	9,765,455.33	48,973.56	7,141,031.37	57,722.70

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限期	流通受限	认购	期末估值	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日		类型	价格	单价	(单位: 股)	成本总额	总额	
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	111	4,438.89	4,307.91	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	41	4,082.37	3,339.86	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	90	2,090.70	3,202.20	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票、债券、权证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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资目标为通过投资于引领经济发展未来方向的新兴行业的上市公司, 享受新经济发展带来的高成长和高收益。重点投资其中具有成长优势和竞争优势的上市公司股票, 追求超额收益。

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

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的货币资金均存放于信用良好的银行，因而与货币资金相关的信用风险不重大。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,202,128.77
合计	-	10,202,128.77

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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							
货币资金	9,765,455.33	-	-	-	-	-	9,765,455.33
结算备付金	1,053,959.89	-	-	-	-	-	1,053,959.89
存出保证金	82,309.81	-	-	-	-	-	82,309.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	92,439,562.23	92,439,562.23
应收清算款	-	-	-	-	-	794,875.20	794,875.20
应收申购款	-	-	-	-	-	135,690.66	135,690.66
资产总计	10,901,725.03	-	-	-	-	93,370,128.09	104,271,853.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	665,395.85	665,395.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	105,971.55	105,971.55
应付托管费	-	-	-	-	-	17,661.93	17,661.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,084.98	11,084.98
其他负债	-	-	-	-	-	1,032,869.55	1,032,869.55
负债总计	-	-	-	-	-	1,832,983.86	1,832,983.86
利率敏感度缺口	10,901,725.03	-	-	-	-	91,537,144.23	102,438,869.26
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							
货币资金	7,141,031.37	-	-	-	-	-	7,141,031.37
结算备付金	1,647,483.21	-	-	-	-	-	1,647,483.21
存出保证金	213,978.63	-	-	-	-	-	213,978.63
交易性金融资产	10,202,128.77	-	-	-	-	140,468,822.47	150,670,951.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	175,722.79	175,722.79
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	194,766.91	194,766.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,204,621.98	-	-	-	-	140,839,312.17	160,043,934.15
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,052,011.57	1,052,011.57

应付管理人报酬	-	-	-	-	218,172.90	218,172.90
应付托管费	-	-	-	-	36,362.13	36,362.13
应付销售服务费	-	-	-	-	16,206.08	16,206.08
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	1,152,159.73	1,152,159.73
负债总计	-	-	-	-	2,474,912.41	2,474,912.41
利率敏感度缺口	19,204,621.98	-	-	-	-138,364,399.76	157,569,021.74

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	-	908.07
	基准利率增加 25 个基点	-	-907.91

注：本期末本基金未持有交易性债券投资，货币资金、结算备付金和存出保证金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该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大的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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	92,439,562.23	90.24	140,468,822.47	89.15
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	92,439,562.23	90.24	140,468,822.47	89.15

注：本基金投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中属于新经济范畴的股票类资产投资比例不低于股票类资产的 80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金投资于权证以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-1,413,656.40	-2,347,778.42
	2. 业绩基准下跌 5%	-7,068,281.98	-11,738,892.12
3. 业绩基准下跌 10%	-14,136,563.96	-23,477,784.24	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	92,428,712.26	139,583,033.99
第二层次	-	10,202,128.77
第三层次	10,849.97	885,788.48
合计	92,439,562.23	150,670,951.24

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	885,788.48	-	885,788.48
当期购买	-	10,611.96	-	10,611.96
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	885,788.48	-	885,788.48
当期利得或损失总额	-	238.01	-	238.01
其中：计入损益的利得或损失	-	238.01	-	238.01
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	10,849.97	-	10,849.97
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	238.01	-	238.01
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	375,547.53	-	375,547.53
当期购买	-	817,031.04	-	817,031.04
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	375,547.53	-	375,547.53
当期利得或损失总额	-	68,757.44	-	68,757.44
其中：计入损益的利得或损失	-	68,757.44	-	68,757.44
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	885,788.48	-	885,788.48
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	68,757.44	-	68,757.44

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	10,849.97	平均价格亚式期权模型	波动率	0.3036-1.6825	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	885,788.48	平均价格亚式期权模型	波动率	0.2063-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	92,439,562.23	88.65
	其中：股票	92,439,562.23	88.65
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	10,819,415.22	10.38
8	其他各项资产	1,012,875.67	0.97
9	合计	104,271,853.12	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	88,311,904.59	86.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,127,657.64	4.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,439,562.23	90.24

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603501	韦尔股份	78,365	8,362,329.15	8.16
2	002475	立讯精密	217,500	7,492,875.00	7.31
3	002920	德赛西威	56,100	7,265,511.00	7.09
4	002241	歌尔股份	338,100	7,103,481.00	6.93
5	688110	东芯股份	153,961	5,300,877.23	5.17
6	002409	雅克科技	72,600	4,045,998.00	3.95
7	300812	易天股份	87,300	3,630,807.00	3.54
8	301391	卡莱特	27,600	3,159,648.00	3.08
9	688328	深科达	69,418	3,113,397.30	3.04
10	300115	长盈精密	234,100	3,101,825.00	3.03
11	300458	全志科技	135,300	3,069,957.00	3.00
12	688025	杰普特	32,440	3,002,322.00	2.93
13	003021	兆威机电	29,000	2,725,710.00	2.66
14	300793	佳禾智能	116,000	2,518,360.00	2.46
15	688097	博众精工	74,885	2,516,136.00	2.46
16	301360	荣旗科技	24,600	2,302,560.00	2.25
17	688001	华兴源创	60,838	2,126,288.10	2.08
18	688766	普冉股份	20,851	2,042,980.98	1.99
19	688595	芯海科技	37,847	1,638,775.10	1.60
20	000810	创维数字	95,200	1,495,592.00	1.46
21	603290	斯达半导	5,900	1,067,900.00	1.04
22	688111	金山办公	3,336	1,054,843.20	1.03
23	688332	中科蓝讯	13,797	1,040,569.74	1.02
24	300366	创意信息	79,100	1,037,792.00	1.01
25	002465	海格通信	80,400	1,033,140.00	1.01
26	002156	通富微电	44,300	1,024,216.00	1.00
27	688301	奕瑞科技	3,146	1,023,267.96	1.00

28	603296	华勤技术	12,800	1,022,592.00	1.00
29	301050	雷电微力	17,500	1,019,550.00	1.00
30	603890	春秋电子	89,000	1,019,050.00	0.99
31	688099	晶晨股份	16,258	1,018,238.54	0.99
32	002273	水晶光电	75,100	1,016,854.00	0.99
33	688052	纳芯微	6,094	1,016,783.90	0.99
34	688636	智明达	15,438	1,006,557.60	0.98
35	688981	中芯国际	18,923	1,003,297.46	0.98
36	301308	江波龙	10,800	994,140.00	0.97
37	688249	晶合集成	840	14,490.00	0.01
38	301498	乖宝宠物	111	4,307.91	0.00
39	301525	儒竞科技	41	3,339.86	0.00
40	301568	思泰克	90	3,202.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002920	德赛西威	62,002,647.80	39.35
2	601689	拓普集团	34,885,110.86	22.14
3	002850	科达利	33,791,167.88	21.45
4	300014	亿纬锂能	32,073,058.25	20.35
5	002126	银轮股份	31,144,206.42	19.77
6	688256	寒武纪	30,358,542.60	19.27
7	603305	旭升集团	29,363,161.97	18.64
8	002236	大华股份	27,072,068.36	17.18
9	688111	金山办公	26,837,672.74	17.03
10	000625	长安汽车	26,170,047.49	16.61
11	688668	鼎通科技	25,406,308.59	16.12
12	300750	宁德时代	24,966,117.16	15.84
13	300308	中际旭创	23,598,389.00	14.98
14	603501	韦尔股份	23,367,394.10	14.83
15	605117	德业股份	20,710,556.20	13.14
16	603005	晶方科技	20,212,416.64	12.83
17	300502	新易盛	20,162,246.00	12.80
18	688088	虹软科技	20,057,731.82	12.73
19	002230	科大讯飞	19,971,430.00	12.67

20	688041	海光信息	19,714,068.42	12.51
21	600933	爱柯迪	19,574,141.13	12.42
22	605133	嵘泰股份	19,372,571.98	12.29
23	603596	伯特利	19,329,918.47	12.27
24	300394	天孚通信	19,120,489.29	12.13
25	300438	鹏辉能源	19,092,064.75	12.12
26	002997	瑞鹄模具	18,919,285.99	12.01
27	002050	三花智控	18,561,485.00	11.78
28	002463	沪电股份	18,437,497.55	11.70
29	601633	长城汽车	17,039,738.14	10.81
30	603728	鸣志电器	16,303,082.96	10.35
31	002475	立讯精密	15,540,658.00	9.86
32	002812	恩捷股份	14,713,997.72	9.34
33	300223	北京君正	14,662,549.37	9.31
34	300428	立中集团	14,569,478.40	9.25
35	002074	国轩高科	14,424,710.98	9.15
36	002517	恺英网络	14,420,236.00	9.15
37	001311	多利科技	14,107,825.96	8.95
38	688017	绿的谐波	13,533,899.32	8.59
39	600418	江淮汽车	13,316,873.00	8.45
40	603348	文灿股份	13,201,808.00	8.38
41	688700	东威科技	12,979,430.74	8.24
42	002555	三七互娱	12,660,475.00	8.03
43	300068	南都电源	12,112,324.45	7.69
44	002906	华阳集团	11,762,811.15	7.47
45	688063	派能科技	11,565,679.49	7.34
46	603197	保隆科技	11,386,503.00	7.23
47	601238	广汽集团	11,304,344.34	7.17
48	002624	完美世界	11,302,422.00	7.17
49	300548	博创科技	10,937,081.90	6.94
50	300568	星源材质	10,438,543.00	6.62
51	688326	经纬恒润	10,263,919.77	6.51
52	002241	歌尔股份	10,074,684.00	6.39
53	002594	比亚迪	9,761,557.00	6.20
54	688025	杰普特	9,609,750.36	6.10
55	603035	常熟汽饰	9,477,625.36	6.01

56	000988	华工科技	9,343,741.72	5.93
57	300366	创意信息	9,188,637.81	5.83
58	603985	恒润股份	8,961,322.00	5.69
59	000034	神州数码	8,866,229.00	5.63
60	601138	工业富联	8,832,106.00	5.61
61	603786	科博达	8,805,703.00	5.59
62	300580	贝斯特	8,776,405.00	5.57
63	300496	中科创达	8,652,556.00	5.49
64	002273	水晶光电	8,583,156.46	5.45
65	002992	宝明科技	8,490,874.00	5.39
66	600602	云赛智联	8,454,005.00	5.37
67	300624	万兴科技	8,403,834.00	5.33
68	688155	先惠技术	8,365,089.41	5.31
69	300133	华策影视	8,326,091.45	5.28
70	000049	德赛电池	7,826,627.00	4.97
71	300033	同花顺	7,754,904.00	4.92
72	300620	光库科技	7,548,221.00	4.79
73	601900	南方传媒	7,384,688.00	4.69
74	300059	东方财富	7,373,426.88	4.68
75	001301	尚太科技	7,324,384.00	4.65
76	605333	沪光股份	7,123,364.00	4.52
77	300707	威唐工业	6,962,457.00	4.42
78	000938	紫光股份	6,926,109.35	4.40
79	600718	东软集团	6,923,649.00	4.39
80	002373	千方科技	6,902,758.00	4.38
81	601595	上海电影	6,815,897.20	4.33
82	002837	英维克	6,806,799.24	4.32
83	300769	德方纳米	6,710,143.88	4.26
84	603259	药明康德	6,562,263.00	4.16
85	300788	中信出版	6,523,772.00	4.14
86	603019	中科曙光	6,523,641.00	4.14
87	603296	华勤技术	6,364,920.26	4.04
88	601858	中国科传	6,307,741.09	4.00
89	688390	固德威	6,276,299.15	3.98
90	002384	东山精密	6,246,273.00	3.96
91	300339	润和软件	6,210,561.00	3.94

92	605128	上海沿浦	6,131,707.00	3.89
93	002179	中航光电	6,091,707.00	3.87
94	300499	高澜股份	6,079,487.92	3.86
95	002222	福晶科技	6,027,081.00	3.83
96	603000	人民网	6,021,151.00	3.82
97	002284	亚太股份	6,010,229.00	3.81
98	300331	苏大维格	6,009,291.00	3.81
99	002821	凯莱英	5,946,411.00	3.77
100	301052	果麦文化	5,820,653.00	3.69
101	688036	传音控股	5,805,080.57	3.68
102	002777	久远银海	5,802,254.00	3.68
103	300364	中文在线	5,739,078.00	3.64
104	002409	雅克科技	5,680,408.00	3.61
105	002292	奥飞娱乐	5,574,837.00	3.54
106	600104	上汽集团	5,562,346.00	3.53
107	688110	东芯股份	5,509,576.43	3.50
108	000837	秦川机床	5,483,441.00	3.48
109	688195	腾景科技	5,406,578.67	3.43
110	300229	拓尔思	5,299,915.55	3.36
111	300745	欣锐科技	5,297,584.00	3.36
112	300136	信维通信	5,280,372.97	3.35
113	300031	宝通科技	5,278,997.64	3.35
114	688533	上声电子	5,261,608.99	3.34
115	300627	华测导航	5,214,652.70	3.31
116	002465	海格通信	5,150,602.00	3.27
117	688200	华峰测控	5,143,445.01	3.26
118	002371	北方华创	5,081,220.00	3.22
119	688002	睿创微纳	5,067,310.95	3.22
120	688248	南网科技	5,061,137.57	3.21
121	003021	兆威机电	5,025,652.00	3.19
122	301215	中汽股份	5,023,727.34	3.19
123	002738	中矿资源	4,997,349.00	3.17
124	300598	诚迈科技	4,967,912.00	3.15
125	300226	上海钢联	4,900,483.74	3.11
126	300762	上海瀚讯	4,879,754.40	3.10
127	002466	天齐锂业	4,877,649.00	3.10

128	300490	华自科技	4,807,735.40	3.05
129	600446	金证股份	4,772,775.12	3.03
130	300793	佳禾智能	4,770,646.00	3.03
131	300017	网宿科技	4,668,142.00	2.96
132	688392	骄成超声	4,550,124.91	2.89
133	603200	上海洗霸	4,491,057.40	2.85
134	002965	祥鑫科技	4,407,971.00	2.80
135	688595	芯海科技	4,364,039.71	2.77
136	000957	中通客车	4,348,064.25	2.76
137	603160	汇顶科技	4,239,229.00	2.69
138	688032	禾迈股份	4,223,467.66	2.68
139	002045	国光电器	4,211,046.00	2.67
140	688348	昱能科技	4,210,910.53	2.67
141	688005	容百科技	4,208,875.92	2.67
142	300418	昆仑万维	4,143,412.06	2.63
143	601127	赛力斯	4,094,859.00	2.60
144	688177	百奥泰	4,076,094.34	2.59
145	300969	恒帅股份	4,001,382.28	2.54
146	002882	金龙羽	3,993,918.00	2.53
147	000719	中原传媒	3,956,108.58	2.51
148	300654	世纪天鸿	3,940,956.00	2.50
149	002756	永兴材料	3,925,972.48	2.49
150	300681	英搏尔	3,682,349.00	2.34
151	301221	光庭信息	3,681,099.73	2.34
152	002824	和胜股份	3,658,801.00	2.32
153	300073	当升科技	3,612,444.00	2.29
154	603917	合力科技	3,607,647.00	2.29
155	688800	瑞可达	3,533,454.00	2.24
156	300188	美亚柏科	3,522,273.24	2.24
157	002281	光迅科技	3,492,350.00	2.22
158	301018	申菱环境	3,488,842.00	2.21
159	002268	电科网安	3,483,167.00	2.21
160	688023	安恒信息	3,465,085.12	2.20
161	600118	中国卫星	3,440,094.00	2.18
162	600741	华域汽车	3,436,626.00	2.18
163	300520	科大国创	3,427,737.00	2.18

164	300604	长川科技	3,420,947.00	2.17
165	300724	捷佳伟创	3,404,610.00	2.16
166	300075	数字政通	3,390,644.00	2.15
167	300682	朗新科技	3,390,034.00	2.15
168	002152	广电运通	3,385,019.00	2.15
169	603936	博敏电子	3,384,490.00	2.15
170	300953	震裕科技	3,377,605.00	2.14
171	300870	欧陆通	3,363,575.00	2.13
172	002472	双环传动	3,320,516.00	2.11
173	603778	国晟科技	3,317,291.75	2.11
174	002782	可立克	3,300,178.00	2.09
175	688327	云从科技	3,246,351.75	2.06
176	688766	普冉股份	3,241,318.48	2.06
177	603890	春秋电子	3,237,386.67	2.05
178	300655	晶瑞电材	3,212,546.30	2.04
179	600633	浙数文化	3,198,721.00	2.03
180	300845	捷安高科	3,195,779.00	2.03
181	688076	诺泰生物	3,193,353.71	2.03

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002920	德赛西威	50,050,502.00	31.76
2	300750	宁德时代	37,911,211.44	24.06
3	300014	亿纬锂能	36,178,234.76	22.96
4	601689	拓普集团	34,646,577.31	21.99
5	002850	科达利	32,467,822.66	20.61
6	002126	银轮股份	31,513,311.00	20.00
7	603305	旭升集团	28,519,979.70	18.10
8	002236	大华股份	27,766,052.00	17.62
9	688256	寒武纪	27,300,704.86	17.33
10	000625	长安汽车	25,668,053.15	16.29
11	688111	金山办公	24,660,326.40	15.65
12	688668	鼎通科技	24,462,153.58	15.52

13	603596	伯特利	23,859,065.38	15.14
14	300308	中际旭创	22,844,995.41	14.50
15	002230	科大讯飞	21,712,359.00	13.78
16	300428	立中集团	21,281,879.36	13.51
17	300502	新易盛	20,696,748.62	13.14
18	688088	虹软科技	20,545,267.45	13.04
19	605117	德业股份	20,322,928.58	12.90
20	600933	爱柯迪	20,081,482.00	12.74
21	688041	海光信息	19,668,632.47	12.48
22	688700	东威科技	19,190,321.26	12.18
23	002997	瑞鹄模具	19,166,803.98	12.16
24	300394	天孚通信	18,940,034.32	12.02
25	002074	国轩高科	18,834,180.37	11.95
26	603005	晶方科技	18,526,052.00	11.76
27	002050	三花智控	18,485,148.00	11.73
28	603348	文灿股份	18,409,299.20	11.68
29	605133	嵘泰股份	18,163,340.82	11.53
30	300438	鹏辉能源	17,684,652.00	11.22
31	002463	沪电股份	16,627,947.61	10.55
32	601633	长城汽车	16,251,895.00	10.31
33	603728	鸣志电器	16,191,002.00	10.28
34	002992	宝明科技	15,394,814.00	9.77
35	603501	韦尔股份	14,562,459.00	9.24
36	002517	恺英网络	14,090,961.00	8.94
37	300223	北京君正	14,086,061.58	8.94
38	600418	江淮汽车	13,699,725.52	8.69
39	001311	多利科技	13,379,526.97	8.49
40	688017	绿的谐波	13,099,467.49	8.31
41	002555	三七互娱	12,717,776.00	8.07
42	000049	德赛电池	12,621,723.52	8.01
43	002812	恩捷股份	12,402,065.00	7.87
44	603197	保隆科技	12,113,071.64	7.69
45	300073	当升科技	11,791,278.00	7.48
46	300068	南都电源	11,782,789.92	7.48
47	688063	派能科技	11,246,158.29	7.14
48	002906	华阳集团	11,214,474.00	7.12
49	601238	广汽集团	10,675,254.30	6.77
50	688630	芯碁微装	10,517,566.04	6.67

51	300548	博创科技	10,477,203.50	6.65
52	002624	完美世界	10,341,750.00	6.56
53	688326	经纬恒润	9,763,234.77	6.20
54	002594	比亚迪	9,531,406.00	6.05
55	000988	华工科技	9,388,610.00	5.96
56	603035	常熟汽饰	9,215,049.60	5.85
57	601138	工业富联	8,863,924.00	5.63
58	002866	传艺科技	8,735,631.00	5.54
59	300580	贝斯特	8,589,334.86	5.45
60	000034	神州数码	8,394,835.00	5.33
61	603786	科博达	8,385,699.00	5.32
62	300366	创意信息	8,376,629.00	5.32
63	002475	立讯精密	8,323,636.62	5.28
64	300496	中科创达	8,238,753.00	5.23
65	600602	云赛智联	8,232,942.70	5.22
66	300624	万兴科技	8,226,839.28	5.22
67	300568	星源材质	8,093,472.16	5.14
68	002373	千方科技	7,804,204.15	4.95
69	002273	水晶光电	7,722,105.00	4.90
70	300133	华策影视	7,690,276.00	4.88
71	601900	南方传媒	7,634,095.00	4.84
72	300033	同花顺	7,606,933.00	4.83
73	300620	光库科技	7,554,473.00	4.79
74	603985	恒润股份	7,392,325.00	4.69
75	300059	东方财富	7,190,429.00	4.56
76	688025	杰普特	7,184,719.11	4.56
77	605333	沪光股份	7,162,390.00	4.55
78	601595	上海电影	7,107,781.40	4.51
79	300757	罗博特科	7,095,852.00	4.50
80	688155	先惠技术	7,088,342.09	4.50
81	000938	紫光股份	6,953,588.00	4.41
82	002837	英维克	6,801,512.00	4.32
83	600718	东软集团	6,792,156.00	4.31
84	001301	尚太科技	6,706,168.00	4.26
85	002284	亚太股份	6,394,027.00	4.06
86	603019	中科曙光	6,331,451.00	4.02
87	605128	上海沿浦	6,302,935.00	4.00
88	300769	德方纳米	6,272,329.00	3.98

89	603259	药明康德	6,231,173.06	3.95
90	300331	苏大维格	6,215,737.00	3.94
91	002222	福晶科技	6,081,147.00	3.86
92	300339	润和软件	6,017,790.00	3.82
93	300788	中信出版	5,979,637.00	3.79
94	300499	高澜股份	5,966,984.00	3.79
95	002384	东山精密	5,928,304.00	3.76
96	300707	威唐工业	5,913,806.00	3.75
97	002179	中航光电	5,910,622.60	3.75
98	688390	固德威	5,775,051.46	3.67
99	601858	中国科传	5,707,084.92	3.62
100	002292	奥飞娱乐	5,684,837.48	3.61
101	603000	人民网	5,613,243.00	3.56
102	002821	凯莱英	5,607,441.00	3.56
103	688533	上声电子	5,470,971.44	3.47
104	600104	上汽集团	5,429,931.00	3.45
105	002882	金龙羽	5,336,465.00	3.39
106	603296	华勤技术	5,333,336.34	3.38
107	301215	中汽股份	5,321,525.16	3.38
108	688148	芳源股份	5,313,907.15	3.37
109	300136	信维通信	5,285,057.00	3.35
110	300229	拓尔思	5,283,356.25	3.35
111	300745	欣锐科技	5,272,315.08	3.35
112	300364	中文在线	5,266,016.04	3.34
113	002371	北方华创	5,234,238.00	3.32
114	002777	久远银海	5,187,302.92	3.29
115	300627	华测导航	5,102,964.00	3.24
116	688002	睿创微纳	5,066,339.16	3.22
117	000837	秦川机床	5,030,488.00	3.19
118	300017	网宿科技	5,019,849.00	3.19
119	301052	果麦文化	4,957,726.00	3.15
120	688036	传音控股	4,915,245.28	3.12
121	300598	诚迈科技	4,850,940.66	3.08
122	688200	华峰测控	4,835,933.64	3.07
123	688195	腾景科技	4,816,190.14	3.06
124	300762	上海瀚讯	4,804,137.00	3.05
125	002738	中矿资源	4,741,942.00	3.01
126	002466	天齐锂业	4,661,462.00	2.96

127	300031	宝通科技	4,649,905.00	2.95
128	688248	南网科技	4,602,659.45	2.92
129	688567	孚能科技	4,582,329.98	2.91
130	601127	赛力斯	4,580,658.00	2.91
131	002965	祥鑫科技	4,542,812.00	2.88
132	301349	信德新材	4,541,723.02	2.88
133	688392	骄成超声	4,510,178.67	2.86
134	300226	上海钢联	4,395,957.58	2.79
135	688348	昱能科技	4,394,892.00	2.79
136	300490	华自科技	4,327,702.00	2.75
137	600446	金证股份	4,289,835.00	2.72
138	002465	海格通信	4,276,119.00	2.71
139	300418	昆仑万维	4,211,907.00	2.67
140	688177	百奥泰	4,178,649.74	2.65
141	603200	上海洗霸	4,054,454.02	2.57
142	300919	中伟股份	4,052,393.00	2.57
143	603160	汇顶科技	4,030,108.00	2.56
144	300570	太辰光	4,026,110.00	2.56
145	002045	国光电器	3,991,444.00	2.53
146	688023	安恒信息	3,975,307.77	2.52
147	000957	中通客车	3,972,101.81	2.52
148	002426	胜利精密	3,948,000.00	2.51
149	688659	元琛科技	3,905,199.20	2.48
150	688559	海目星	3,865,548.88	2.45
151	000821	京山轻机	3,835,960.00	2.43
152	002756	永兴材料	3,814,509.00	2.42
153	002241	歌尔股份	3,756,123.00	2.38
154	300654	世纪天鸿	3,753,481.20	2.38
155	300969	恒帅股份	3,683,356.00	2.34
156	688032	禾迈股份	3,675,194.30	2.33
157	600118	中国卫星	3,669,413.00	2.33
158	688005	容百科技	3,665,485.57	2.33
159	300075	数字政通	3,567,521.00	2.26
160	300188	美亚柏科	3,559,020.00	2.26
161	300604	长川科技	3,541,068.00	2.25
162	603917	合力科技	3,537,499.00	2.25
163	301221	光庭信息	3,510,298.00	2.23
164	603936	博敏电子	3,506,998.00	2.23

165	300845	捷安高科	3,489,810.80	2.21
166	000719	中原传媒	3,424,471.00	2.17
167	002281	光迅科技	3,424,317.44	2.17
168	002152	广电运通	3,399,445.00	2.16
169	601799	星宇股份	3,382,551.00	2.15
170	002782	可立克	3,358,643.00	2.13
171	688076	诺泰生物	3,342,764.63	2.12
172	300057	万顺新材	3,280,094.40	2.08
173	300520	科大国创	3,271,147.00	2.08
174	002824	和胜股份	3,252,222.00	2.06
175	688800	瑞可达	3,248,205.89	2.06
176	002472	双环传动	3,235,881.00	2.05
177	300682	朗新科技	3,217,760.00	2.04
178	300450	先导智能	3,216,285.00	2.04
179	002268	电科网安	3,207,896.42	2.04
180	300681	英搏尔	3,193,484.00	2.03
181	600741	华域汽车	3,161,044.00	2.01
182	301018	申菱环境	3,155,561.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,967,115,253.81
卖出股票收入（成交）总额	1,949,981,626.89

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	82,309.81
2	应收清算款	794,875.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	135,690.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,012,875.67

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东吴新经济混合 A	12,686	7,058.17	0.00	0.00%	89,539,913.51	100.00%
东吴新经济混合 C	7,863	5,198.18	0.00	0.00%	40,873,272.02	100.00%
合计	20,549	6,346.45	0.00	0.00%	130,413,185.53	100.00%

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。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴新经济混合 A	4,996.50	0.0056%
	东吴新经济混合 C	11.21	0.0000%
	合计	5,007.71	0.0038%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴新经济混合 A	东吴新经济混合 C
基金合同生效日（2009 年 12 月 30 日）基金份额总额	800,855,129.16	-
本报告期期初基金份额总额	90,576,880.26	33,047,700.65
本报告期基金总申购份额	62,114,633.27	96,672,163.96
减:本报告期基金总赎回份额	63,151,600.02	88,846,592.59
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	89,539,913.51	40,873,272.02

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、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。

3、2023 年 8 月 7 日经东吴基金管理有限公司第三十次股东会审议通过，聘任郭晶晶同志担任东吴基金管理有限公司董事，免去叶犇同志董事职务；聘任叶犇同志担任东吴基金管理有限公司监事长，免去袁维静同志监事长职务。

4、2023 年 12 月 27 日经东吴基金管理有限公司第四届董事会 2023 年第 3 次临时会议审议通过，同意陈军同志辞去公司常务副总经理职务，陈军同志不再担任公司常务副总经理。

本报告期内基金托管人发生以下人事变动：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内应支付审计费 43000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	3	2,326,544,426.09	59.43%	2,156,684.37	59.23%	-
广发证券	1	479,175,084.09	12.24%	448,210.08	12.31%	-
东方证券	1	387,023,536.55	9.89%	364,426.04	10.01%	-
国泰君安	2	306,057,758.46	7.82%	283,163.83	7.78%	-
兴业证券	1	150,569,375.51	3.85%	141,668.38	3.89%	-
天风证券	2	110,195,047.09	2.82%	102,626.21	2.82%	-
招商证券	1	94,722,576.67	2.42%	88,032.16	2.42%	-
国盛证券	1	41,672,943.69	1.06%	39,197.13	1.08%	-
国信证券	1	18,539,057.31	0.47%	17,265.24	0.47%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 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	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2023 年 1 月 4 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	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
4	东吴新经济混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	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	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 10 日
7	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
8	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
9	东吴基金管理有限公司旗下基金招募说明书更新的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 3 月 16 日
10	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2023 年 3 月 16 日
11	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、	2023 年 3 月 31 日

		中证信息网站	
12	东吴新经济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
13	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
14	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	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 11 日
15	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
16	东吴新经济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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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

23	东吴基金管理有限公司管理的基金 2023 年半年末基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 1 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构、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 7 月 12 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧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 7 月 12 日
26	东吴基金管理有限公司关于参加金元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	2023 年 7 月 20 日
27	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 年 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 21 日
28	东吴新经济混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 21 日
29	东吴基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 29 日
30	东吴新经济混合型证券投资基金更新基金合同、招募说明书、产品资料概要及托管协议	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 29 日
31	东吴新经济混合型证券投资基金 2023 年中期报告	公司网站、中证信息网站	2023 年 8 月 31 日
32	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 8 月 31 日
33	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资业务的公告	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 9 月 5 日
34	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构、开	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2023 年 9 月 20 日

	通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中证信息网站	
35	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 10 月 25 日
36	东吴新经济混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	公司网站、中证信息网站	2023 年 10 月 25 日
37	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技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 11 月 3 日
38	东吴基金管理有限公司关于参加上海万得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	2023 年 11 月 10 日
39	东吴基金管理有限公司关于参加嘉实财富管理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	2023 年 11 月 29 日
40	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧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 12 月 4 日
41	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示公告	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 12 月 15 日
42	东吴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所网站、公司网站、中证信息网站	2023 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴新经济股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴新经济混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴新经济混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴新经济混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588。

东吴基金管理有限公司

2024年3月29日