

东吴行业轮动混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	60
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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	72

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	72
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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴行业轮动混合型证券投资基金	
基金简称	东吴行业轮动混合	
基金主代码	580003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 4 月 23 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	233,366,407.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C
下属分级基金的交易代码:	580003	011240
报告期末下属分级基金的份额总额	232,938,722.85 份	427,684.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、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策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
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，其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金，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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷
	联系电话	021-50509888-8308
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn
客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	95577
传真	021-50509888-8211	010-85238680
注册地址	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码	200120	100005
法定代表人	陈军	李民吉

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2022 年		2021 年		2020 年	
	东吴行业轮动混 合 A	东吴行业轮 动混合 C	东吴行业轮动混 合 A	东吴行业轮 动混合 C	东吴行业轮动混 合 A	东吴行 业轮动 混合 C
本期 已实 现收 益	-63,588,118.70	-73,353.01	92,294,519.49	27,417.78	228,192,859.47	-
本期 利润	-81,382,721.52	-95,603.99	27,530,500.59	14,507.43	224,329,414.03	-
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.3472	-0.3498	0.1076	0.0993	0.5005	-
本期 加权 平均 净值 利润 率	-39.24%	-43.28%	8.77%	8.06%	54.61%	-
本期 基金 份额 净值 增长 率	-31.62%	-31.94%	7.70%	0.87%	73.33%	-
3.1.2 期末 数据 和指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末 可供 分配	-60,715,586.94	-138,153.22	61,913,110.25	52,765.00	27,182,029.71	-

利润						
期末可供分配基金份额利润	-0.2607	-0.3230	0.2783	0.2751	0.0831	-
期末基金资产净值	172,223,135.91	289,531.40	284,342,722.90	244,555.33	401,561,425.20	-
期末基金份额净值	0.7393	0.6770	1.2783	1.2751	1.2272	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	-3.66%	-31.35%	40.89%	0.87%	30.82%	-

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

东吴行业轮动混合 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	-10.14%	0.87%	1.28%	0.96%	-11.42%	-0.09%
过去六个月	-19.79%	1.18%	-9.87%	0.83%	-9.92%	0.35%
过去一年	-31.62%	1.29%	-15.35%	0.96%	-16.27%	0.33%
过去三年	27.66%	1.63%	-0.95%	0.97%	28.61%	0.66%

过去五年	15.40%	1.64%	4.21%	0.97%	11.19%	0.67%
自基金合同生效起至今	-3.66%	1.83%	33.04%	1.19%	-36.70%	0.64%

东吴行业轮动混合 C

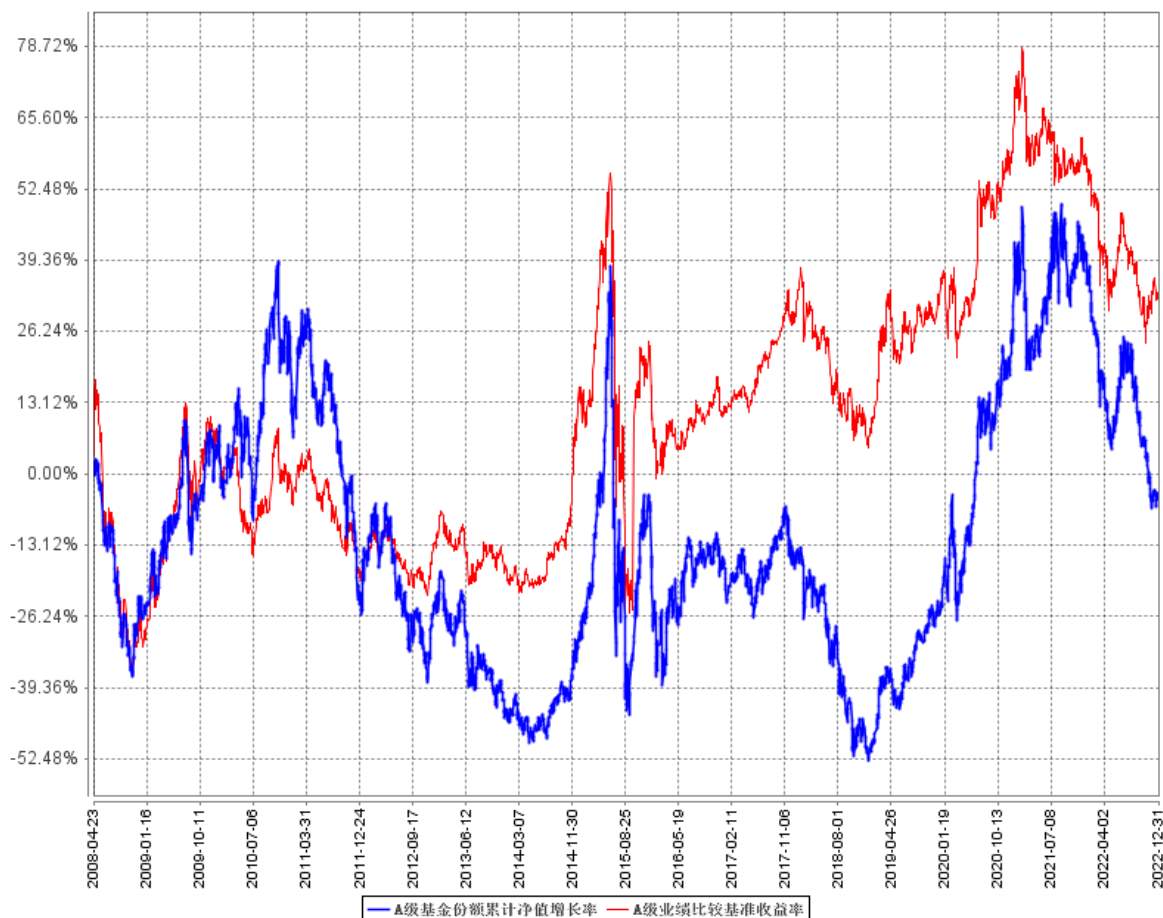
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.21%	0.87%	1.28%	0.96%	-11.49%	-0.09%
过去六个月	-19.95%	1.18%	-9.87%	0.83%	-10.08%	0.35%
过去一年	-31.94%	1.29%	-15.35%	0.96%	-16.59%	0.33%
自基金合同生效起至今	-31.35%	1.52%	-19.75%	0.91%	-11.60%	0.61%

注：1、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数

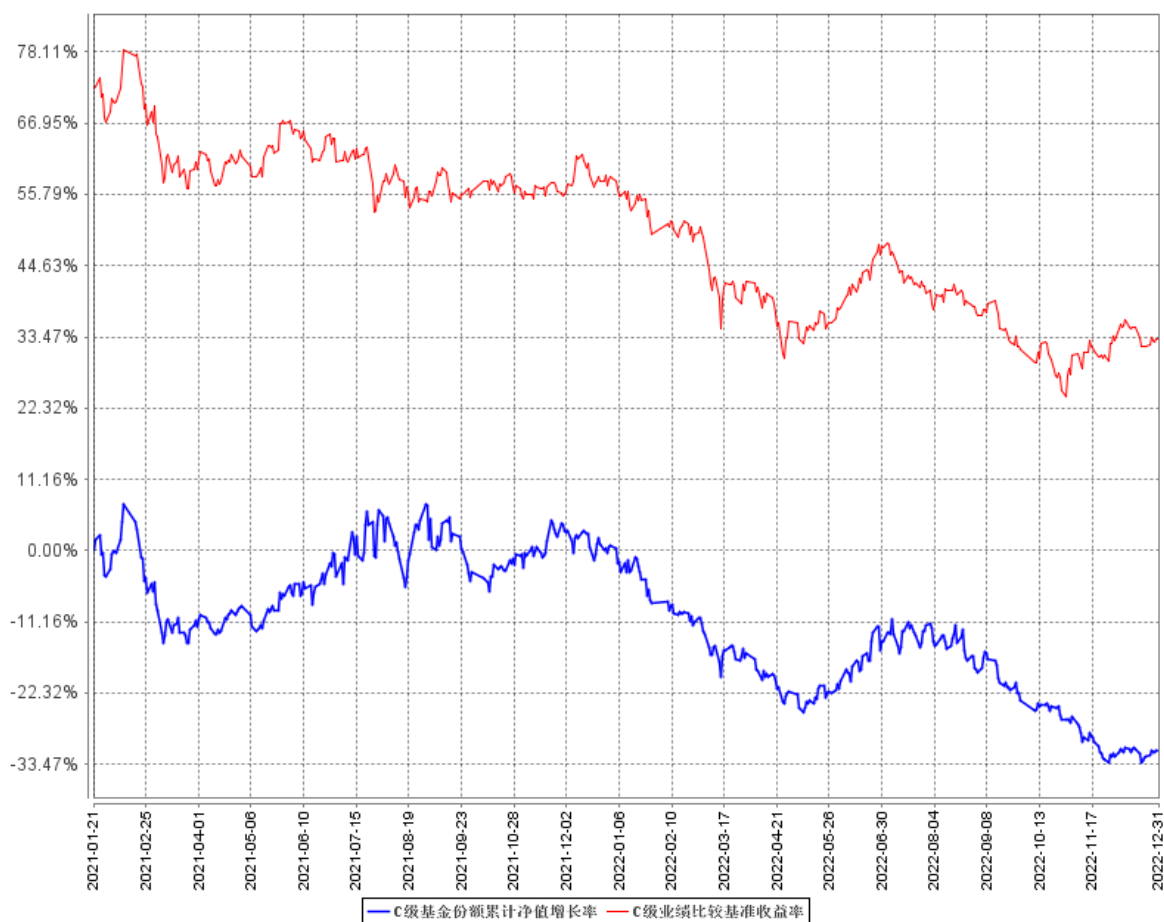
2、本基金于 2021 年 1 月 21 日开始分为 A、C 两类。

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

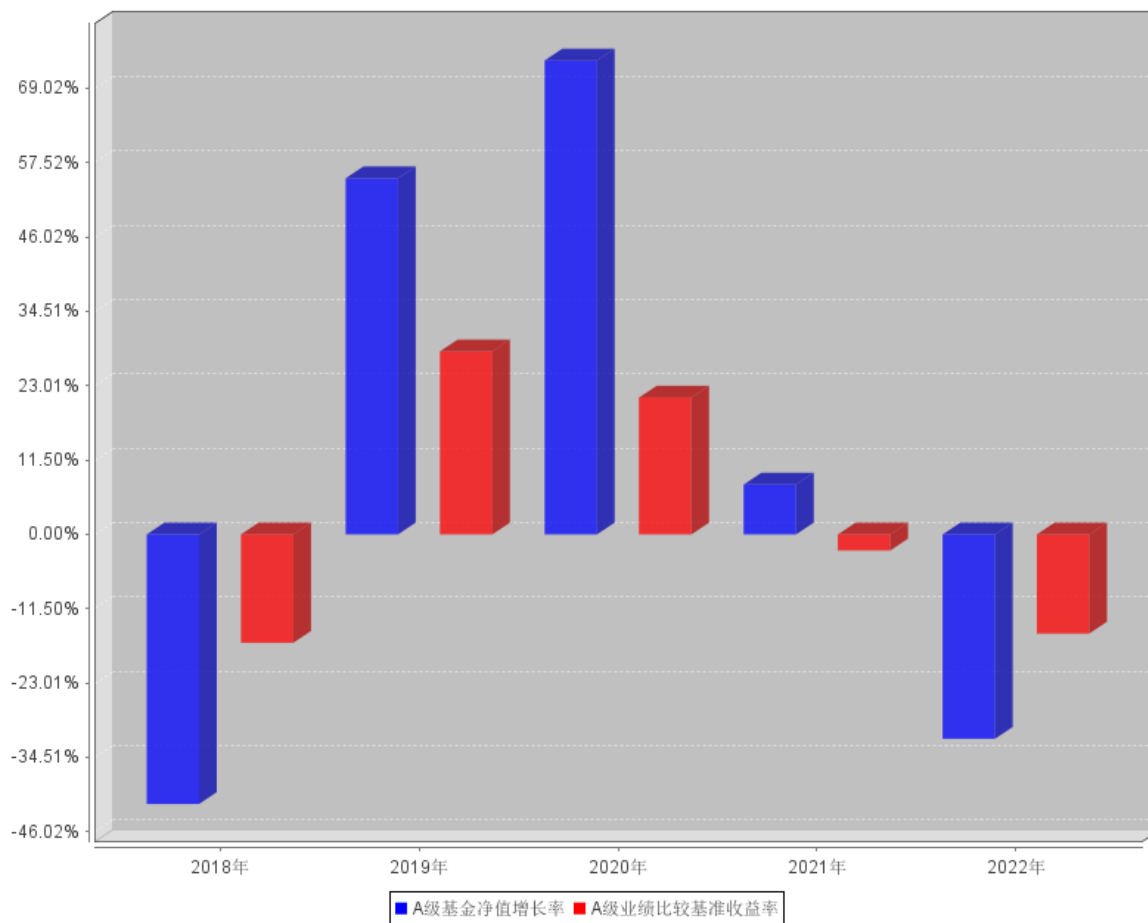


注：1、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

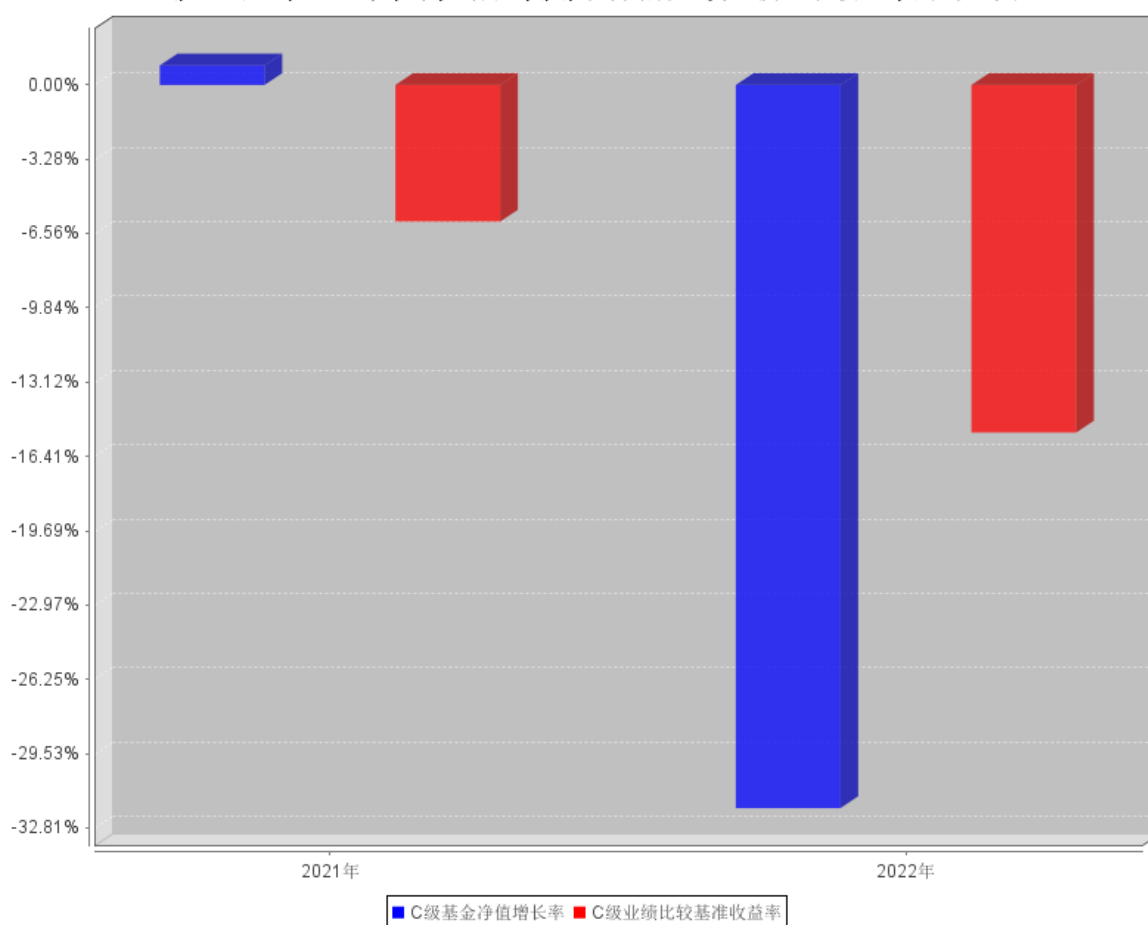
2、本基金于 2021 年 1 月 21 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

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 1 月 21 日开始分为 A、C 两类。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东吴行业轮动混合 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	1.8890	29,173,104.90	12,801,332.69	41,974,437.59	
2021	0.4160	9,024,923.21	3,623,216.89	12,648,140.10	
2020	-	-	-	-	
合计	2.3050	38,198,028.11	16,424,549.58	54,622,577.69	

单位：人民币元

东吴行业轮动混合 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	2.6850	72,958.56	2,755.65	75,714.21	
2021	-	-	-	-	
2020	-	-	-	-	
合计	2.6850	72,958.56	2,755.65	75,714.21	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求,进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2022 年年末,公司整体资产管理规模为【268.19】亿元,其中公募基金【236.35】亿元,专户业务【31.84】亿元,子公司【2.48】亿元;旗下管理着【34】只公募基金(不含清盘中的基金),【19】只存续专户资产管理计划(不包含正在清盘中的专户),【8】项存续专项资产管理计划(子公司)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邬炜	研究总监兼研究策划部总经理、基金经理	2020 年 8 月 4 日	-	11 年	邬炜先生,中国国籍,上海财经大学经济学硕士,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、基金经理;中保秦唐(上海)股权基金管理有限公司投资经理。2020 年 6 月加入东吴基金管理有限公司,现任研究总监兼研究策划部总经理、基金经理。自 2020 年 8 月 4 日起至今担任东吴行业轮动混合型证券投资

					资基金基金经理，2021年3月1日至今担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期指公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易

管理制度，对公司旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年，A 股股票市场全面调整，行业结构维持分化。期间，宏观和产业环境的主要变化如下：第一，企业盈利压力逐步加大。随着国内外经济先后进入下行周期，国内非金融石油石化上市公司 2022 年的净利润增速逐季下行。第二，部分行业估值较高，有待调整消化。虽然国内少数抗周期高端制造业 2022 年依然保持较高景气度，但是经过前 2 年的大幅上涨，估值已经较为充分的反映了未来几年的盈利前景，因此估值处于消化过程中。第三，全球金融环境整体趋紧。欧美国家前期经历了货币大放水，2022 年又逢国际政治形势紧张导致能源价格大幅上涨，形成了较大的通胀压力。在此背景下，美联储 2022 年整体处于加息周期中，全球无风险利率显著抬升，对权益市场形成较大压力。

在此背景下，主要股指和行业指数均出现较大幅度的调整：沪深 300 下跌 21.63%、上证 50 下跌 19.52%、创业板指数下跌 29.37%、科创 50 指数下跌 31.35%；行业层面，煤炭、消费者服务、交通运输等表现居前，电力设备、军工、TMT 跌幅较大。

投资运作方面，2022 年本基金仓位中性，组合结构主要集中于成长领域，年度净值表现跑输基准。2022 年基金净值增长率-31.62%，基金业绩基准收益率为-15.67%，跑输 15.95%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴行业轮动混合 A 基金份额净值为 0.7393 元，本报告期基金份额净值增长率为-31.62%；截至本报告期末东吴行业轮动混合 C 基金份额净值为 0.6770 元，本报告期基金份额净值增长率为-31.94%；同期业绩比较基准收益率为-15.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，2023 年中国经济有望迎来一轮复苏。国内经济自 2021 年下半年呈现减速迹象，并在 2022 年遭受大环境冲击，国内 GDP 增速从 2022 年一季度的 4.8% 降至 2022 年四季度的 2.9%。展望 2023 年，经济修复的确定性有望相对较高。2023 年与 2022 年相比，经济的驱动力发生了明显切换，2022 年国内经济是靠出口和基建支撑，但受大环境和房住不炒调控政策影响，国内消费和地产承压。2023 年国内经济驱动力切换到国内消费和地产。当前线下各类消费场景也逐

步修复，2023 年消费对经济的作用也有望从拖累项转为驱动项。地产领域，比较差的时刻或已经过去。此前在房住不炒的基调下，从房地产投融资到销售各方面限制颇多，后经历保交楼、房地产企业三支箭等政策拐点先后出现，预计 2023 年房地产情况有望优于 2022 年。整体来看，疫后消费复苏叠加地产修复，大概率可以对冲出口下滑的影响，2023 年国内经济有望触底并适度修复。但复苏的高度目前来看存在不确定性，综合考虑国内外环节，2023 年更有可能是弱复苏之年。

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

资本市场方面，我们认为 2023 年市场可能明显优于 2022 年，市场向上机会有望大于向下风险。2023 年的 A 股有望迎来基本面和流动性的双轮驱动。一是国内经济环比修复，企业盈利逐级修复。二是海外美联储有望在上半年结束加息，国内流动性继续维持中性偏宽，这对权益市场来说可能是个相对有利的组合。短期来看，在大环境放开驱动下，出行及线下消费有望实现困境反转，近期市场已经演绎这一逻辑。此外，三支箭政策或将推动地产修复。中期维度，我们看好成长和消费领域的机会：一是看好安全自主可控领域，主要集中在 TMT 行业；二是看好清洁能源中的新技术和高景气方向；三是长期看好消费、医药、高端制造业。

基于上述分析，展望 2023 年，本基金的投资策略主要有以下两个方面：第一，继续坚持实践成长投资的方法，致力聚焦企业盈利的成长。我们将继续深耕消费、科技制造领域，坚持以企业的中长期经济价值成长为核心关注点，不断努力挖掘估值合理、竞争优势突出、行业土壤肥沃的优质公司。具体行业包括：食品饮料、生物医药、信息技术、新能源、高端制造等。第二，基金将显著提升赔率要素在行业和公司评估中的权重，努力为投资人创造更好的投资体验和可持续的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 根据法规要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据《公募基金管理公司压力指引（试行）》及基金业协会的相关要求，结合公司旗下各公募基金的实际运作情况，对公司旗下公募基金开展了情景压力测试，形成压力测试分析报告，加强流动性风险管理。公司根据法规要求持续关注流动性法规执行情况，从制度建设、系统控制、指标监测、部门间协作等方面，不断优化流动性管理工作流程，建立健全公司流动性风险管理内部控制体系。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了投资、研究、交易等多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 加强宣传推介材料审核，保证合规推介。公司根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》等法规及相关监管要求，对拟对外发布的宣传材料发表初审及复审合规意见，包括不限于宣传单页、一页通、海报、PPT、视频、文章等。重点根据相关法规及监管要求对宣传材料中涉及到的业绩引用、基金评价引用、风险揭示等内容作出合规风险提示及意见。

(4) 跟踪监管动态，及时落实新规。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求进行内部讨论，成立工作小组，制订落实方案。及时开展内部培训，修改相关制度与流程，升级业务系统并调整风控设置，保障基金投资符合监管要求。

本基金管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营的公司常务副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，分管运营的公司常务副总经理担任基金资产估值委员会主席，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；基金会计人员参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配十二次，至少分配一次；基金当年收益先弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配；全年合计的基金收益分配比例不低于本基金年度已实现净收益的 50%。

本基金于 2022 年 1 月 19 日发布分红公告，向截至 2022 年 1 月 21 日止在本基金注册登记机关登记在册的基金份额持有人发放红利，A 级基金每 10 份基金份额派发红利 1.8890 元，C 级基金每 10 份基金份额派发红利 2.6850 元，共计分配利润为 42,050,151.80 元，符合基金合同的有关约定。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2022 年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2023)审字第 60469066_B17 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	东吴行业轮动混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了东吴行业轮动混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴行业轮动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，公允反映了东吴行业轮动混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴行业轮动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>东吴行业轮动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行业轮动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</p>

	<p>的选择。</p> <p>治理层负责监督东吴行业轮动混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东吴行业轮动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行业轮动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>

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈露	俞明吉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2023年3月30日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	17,242,148.12	42,657,443.70
结算备付金		2,686,669.63	2,760,164.39
存出保证金		751,145.16	1,199,849.08
交易性金融资产	7.4.7.2	155,467,496.29	259,764,667.11
其中：股票投资		145,418,877.84	240,708,028.31
基金投资		-	-
债券投资		10,048,618.45	19,056,638.80
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,280.73	10,026.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	381,921.09
资产总计		176,154,739.93	306,774,071.54
负债和净资产			
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		1,923,972.88	19,605,584.31
应付赎回款		114,711.17	355,975.01
应付管理人报酬		218,646.06	367,116.16
应付托管费		36,441.01	61,186.04
应付销售服务费		98.43	80.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.35	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,348,202.72	1,796,850.99
负债合计		3,642,072.62	22,186,793.31
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	233,366,407.47	222,621,402.98
未分配利润	7.4.7.8	-60,853,740.16	61,965,875.25
净资产合计		172,512,667.31	284,587,278.23
负债和净资产总计		176,154,739.93	306,774,071.54

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，东吴行业轮动混合 A 基金份额净值 0.7393 元，基金份额总额 232,938,722.85 份；东吴行业轮动混合 C 基金份额净值 0.6770 元，基金份额总额 427,684.62 份。东吴行业轮动混合份额总额合计为 233,366,407.47 份。

（2）比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：东吴行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-77,628,882.59	43,127,630.54
1.利息收入		155,551.18	578,058.47
其中：存款利息收入	7.4.7.9	155,551.18	141,888.14
债券利息收入		-	424,778.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	11,391.78
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,978,860.37	107,255,868.53
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-61,530,240.12	105,530,396.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	552,765.55	1,080,260.68
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	998,614.20	645,211.00
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	-17,816,853.80	-64,776,929.25
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	11,280.40	70,632.79
减：二、营业总支出		3,849,442.92	15,582,622.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,122,193.21	4,730,125.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	520,365.54	788,354.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	882.78	671.50
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1.39	1.19
8. 其他费用	7.4.7.18	206,000.00	10,063,470.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-81,478,325.51	27,545,008.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-81,478,325.51	27,545,008.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-81,478,325.51	27,545,008.02

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东吴行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基	222,621,402.98	61,965,875.25	284,587,278.23

金净值)			
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)	222,621,402.98	61,965,875.25	284,587,278.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,745,004.49	-122,819,615.41	-112,074,610.92
(一)、综合收益总额	-	-81,478,325.51	-81,478,325.51
(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)	10,745,004.49	708,861.90	11,453,866.39
其中：1.基金申购款	35,825,522.94	-2,044,673.43	33,780,849.51
2.基金赎回款	-25,080,518.45	2,753,535.33	-22,326,983.12
(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)	-	-42,050,151.80	-42,050,151.80
(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)	233,366,407.47	-60,853,740.16	172,512,667.31
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	327,221,614.99	74,339,810.21	401,561,425.20
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)	327,221,614.99	74,339,810.21	401,561,425.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-104,600,212.01	-12,373,934.96	-116,974,146.97
(一)、综合收益总额	-	27,545,008.02	27,545,008.02
(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)	-104,600,212.01	-27,270,802.88	-131,871,014.89

其中：1.基金申购款	37,047,168.49	8,694,495.05	45,741,663.54
2.基金赎回款	-141,647,380.50	-35,965,297.93	-177,612,678.43
(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）	-	-12,648,140.10	-12,648,140.10
(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）	222,621,402.98	61,965,875.25	284,587,278.23

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：

_____ 陈军 _____	_____ 陈军 _____	_____ 骆银 _____
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

东吴行业轮动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[2008]296号文《关于核准东吴行业轮动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2008年4月23日正式生效，首次设立募集规模为3,173,064,234.06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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。根据2021年1月20日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴行业轮动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1月21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《东吴行业轮动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：580003；C类基金份额代码：011240）。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、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，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=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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、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一基金份额享有同等分配权；

2. 投资者可以选择现金分红方式或红利再投资分红方式，以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；

3. 基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

4. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

5. 基金当期收益应先弥补前期亏损后, 才可进行当期收益分配;
6. 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益每年至多分配 12 次, 至少分配 1 次, 但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配;
7. 全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 50%;
8. 法律、法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求, 本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理, 此外, 本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14 号)。

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

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

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

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

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

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

以摊余成本计量的金融资产:

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 42,657,443.70

元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,227.56 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 42,660,671.26 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,760,164.39 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,242.10 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,761,406.49 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,199,849.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 539.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,200,388.98 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 381,921.09 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,227.56 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,242.10 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 539.90 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 376,911.53 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 259,764,667.11 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 376,911.53 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 260,141,578.64 元。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	17,242,148.12	42,657,443.70
等于：本金	17,240,499.46	42,657,443.70
加：应计利息	1,648.66	-
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：	17,242,148.12	42,657,443.70

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	141,358,339.53	-	145,418,877.84	4,060,538.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	63,000.00	79,321.75	16,310.70
	银行间市场	9,918,530.00	53,296.70	9,969,296.70
	合计	9,981,530.00	53,307.75	10,048,618.45
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	151,339,869.53	53,307.75	155,467,496.29	4,074,319.01
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	218,811,597.50	-	240,708,028.31	21,896,430.81

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,045,036.80	-	4,043,138.80	-1,898.00
	银行间市场	15,016,860.00	-	15,013,500.00	-3,360.00
	合计	19,061,896.80	-	19,056,638.80	-5,258.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	237,873,494.30	-	259,764,667.11	21,891,172.81	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	381,921.09
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	381,921.09

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	84.59	328.03
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,169,118.13	1,607,522.96
其中：交易所市场	1,169,118.13	1,607,147.96
银行间市场	-	375.00
应付利息	-	-
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
应付审计费	50,000.00	60,000.00

应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	1,348,202.72	1,796,850.99

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴行业轮动混合 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	222,429,612.65	222,429,612.65
本期申购	34,718,055.74	34,718,055.74
本期赎回（以“-”号填列）	-24,208,945.54	-24,208,945.54
- 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	232,938,722.85	232,938,722.85

金额单位：人民币元

东吴行业轮动混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	191,790.33	191,790.33
本期申购	1,107,467.20	1,107,467.20
本期赎回（以“-”号填列）	-871,572.91	-871,572.91
- 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	427,684.62	427,684.62

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

东吴行业轮动混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	84,019,605.55	-22,106,495.30	61,913,110.25
本期利润	-63,588,118.70	-17,794,602.82	-81,382,721.52
本期基金份额交易产生的变动数	2,758,807.13	-2,030,345.21	728,461.92
其中：基金申购款	4,521,906.44	-6,383,339.77	-1,861,433.33
基金赎回款	-1,763,099.31	4,352,994.56	2,589,895.25

本期已分配利润	-41,974,437.59	-	-41,974,437.59
本期末	-18,784,143.61	-41,931,443.33	-60,715,586.94

单位：人民币元

东吴行业轮动混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	102,961.04	-50,196.04	52,765.00
本期利润	-73,353.01	-22,250.98	-95,603.99
本期基金份额交易产生的变动数	54,126.01	-73,726.03	-19,600.02
其中：基金申购款	196,328.71	-379,568.81	-183,240.10
基金赎回款	-142,202.70	305,842.78	163,640.08
本期已分配利润	-75,714.21	-	-75,714.21
本期末	8,019.83	-146,173.05	-138,153.22

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
活期存款利息收入	111,317.24	94,580.03
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	31,569.24	35,225.34
其他	12,664.70	12,082.77
合计	155,551.18	141,888.14

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
卖出股票成交总额	2,559,956,861.58	3,313,939,683.41
减：卖出股票成本总额	2,613,779,727.84	3,208,409,286.56
减：交易费用	7,707,373.86	-
买卖股票差价收入	-61,530,240.12	105,530,396.85

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	12月31日
债券投资收益——利息收入	271,857.73	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	280,907.82	1,080,260.68
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	552,765.55	1,080,260.68

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	33,395,730.50	39,410,650.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	32,490,689.30	37,647,158.80
减：应计利息总额	623,748.71	683,230.52
减：交易费用	384.67	-
买卖债券差价收入	280,907.82	1,080,260.68

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	998,614.20	645,211.00
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	998,614.20	645,211.00

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
1. 交易性金融资产	-17,816,853.80	-64,776,929.25

——股票投资	-17,835,892.50	-64,724,670.85
——债券投资	19,038.70	-52,258.40
——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	-17,816,853.80	-64,776,929.25

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
基金赎回费收入	10,967.41	69,086.92
基金转换费收入	312.99	1,545.87
合计	11,280.40	70,632.79

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	9,847,470.42
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	-	-
数字证书服务费	-	-
银行汇划费	-	-
合计	206,000.00	10,063,470.42

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、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	774,824,221.66	15.24%	2,729,239,361.30	42.39%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	-	-	9,149,400.92	73.07%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	-	-	15,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	719,522.09	15.31%	10,126.43	0.87%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	2,512,038.26	42.42%	534,808.92	33.28%

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,122,193.21	4,730,125.17
其中：支付销售机构的客户维护费	1,004,014.19	1,644,522.23

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,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 2 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	520,365.54	788,354.24

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,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 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。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。

7.4.10.2.3 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		
	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		
	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	7.66	7.66
合计	-	7.66	7.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	0.78	0.78

东吴证券股份有限公司	-	3.63	3.63
合计	-	4.41	4.41

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前两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、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

华夏银行股份有 限公司	17,242,148.12	111,317.24	42,657,443.70	94,580.03
----------------	---------------	------------	---------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏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

东吴行业轮动混合A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 21 日	-	2022 年 1 月 21 日	1.8890	29,173,104.90	12,801,332.69	41,974,437.59	
合计	-	-		1.8890	29,173,104.90	12,801,332.69	41,974,437.59	

东吴行业轮动混合 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 21 日	-	2022 年 1 月 21 日	2.6850	72,958.56	2,755.65	75,714.21	
合计	-	-		2.6850	72,958.56	2,755.65	75,714.21	

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通 受限 类型	认购 价格	期末估值 单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
688506	百利 天恒	2022 年 12 月 28 日	1 个月以内 (含 1 个月)	新 股 未 上 市	24.70	24.70	4,463	110,236.10	110,236.10	-
688205	德科	2022 年 8	6 个月	新 股	48.51	48.98	2,090	101,385.90	102,368.20	-

	立	月 2 日		流 通 受限							
688387	信科 移动	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新 股 流 通 受限	6.05	4.88	18,688	113,062.40	91,197.44	-	
688432	有研 硅	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新 股 流 通 受限	9.91	11.24	5,612	55,614.92	63,078.88	-	
688503	聚和 材料	2022 年 12 月 2 日	6 个月	新 股 流 通 受限	110.00	136.39	450	49,500.00	61,375.50	-	
688084	晶品 特装	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新 股 流 通 受限	60.98	74.73	687	41,893.26	51,339.51	-	
688459	哈铁 科技	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受限	13.58	8.27	5,702	77,433.16	47,155.54	-	
301269	华大 九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新 股 流 通 受限	32.69	87.94	192	6,276.48	16,884.48	-	
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新 股 流 通 受限	33.65	69.68	226	7,604.90	15,747.68	-	
301095	广立 微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受限	58.00	86.49	154	8,932.00	13,319.46	-	
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新 股 流 通 受限	3.82	6.01	2,182	8,335.24	13,113.82	-	
301327	华宝 新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受限	237.50	176.97	73	17,337.50	12,918.81	-	
301297	富乐 德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新 股 流 通 受限	8.48	12.99	795	6,741.60	10,327.05	-	
301308	江波 龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新 股 流 通 受限	55.67	56.72	170	9,463.90	9,642.40	-	
301301	川宁 生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新 股 流 通 受限	5.00	7.53	1,207	6,035.00	9,088.71	-	
301330	熵基 科技	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受限	43.32	31.31	253	10,959.96	7,921.43	-	

301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	159	7,366.47	7,789.41	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	199	6,101.34	7,532.15	-
301121	紫建电子	2022年8月1日	6个月	新股流通受限	61.07	49.77	145	8,855.15	7,216.65	-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	154	8,778.00	7,182.56	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	123	6,480.87	6,323.43	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	142	6,138.66	6,005.18	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	77	6,067.60	5,925.92	-
301197	工大科雅	2022年7月29日	6个月	新股流通受限	25.50	20.08	292	7,446.00	5,863.36	-
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	26.80	24.48	234	6,271.20	5,728.32	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	194	7,420.50	5,721.06	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	198	5,084.64	5,617.26	-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	315	5,726.70	5,581.80	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	341	6,403.98	5,316.19	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通	38.46	25.31	210	8,076.60	5,315.10	-

				受限							
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股流通受限	51.72	36.62	145	7,499.40	5,309.90	-	
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	180	4,545.00	5,245.20	-	
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	255	6,499.95	5,196.90	-	
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-	
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	141	6,216.69	4,953.33	-	
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	170	5,848.00	4,919.80	-	
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	44.80	101	6,807.40	4,524.80	-	
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	43	5,971.84	4,451.36	-	
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	82	3,915.50	4,368.14	-	
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	225	5,024.25	4,167.00	-	
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	321	4,262.88	3,659.40	-	
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	144	5,855.04	3,255.84	-	
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	115	4,485.00	2,812.90	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的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对行业轮动规律的把握,侧重投资于预期收益较高的行业,并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票,追求超额收益。

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,969,296.70	18,810,638.80
合计	9,969,296.70	18,810,638.80

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	246,000.00
AAA 以下	79,321.75	-
未评级	-	-
合计	79,321.75	246,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

资产							
银行存款	17,242,148.12	-	-	-	-	-	17,242,148.12
结算备付金	2,686,669.63	-	-	-	-	-	2,686,669.63
存出保证金	751,145.16	-	-	-	-	-	751,145.16
交易性金融资产	-	9,969,296.70	-	-	79,321.75	145,418,877.84	155,467,496.29
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	-	-	-	-	-	7,280.73	7,280.73
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,679,962.91	9,969,296.70	-	-	79,321.75	145,426,158.57	176,154,739.93
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1,923,972.88	1,923,972.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	114,711.17	114,711.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	218,646.06	218,646.06
应付托管费	-	-	-	-	-	36,441.01	36,441.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	98.43	98.43
应交税费	-	-	-	-	-	0.35	0.35
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,348,202.72	1,348,202.72
负债总计	-	-	-	-	-	3,642,072.62	3,642,072.62
利率敏感度缺口	20,679,962.91	9,969,296.70	-	-	79,321.75	141,784,085.95	172,512,667.31
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	42,657,443.70	-	-	-	-	-	42,657,443.70
结算备付金	2,760,164.39	-	-	-	-	-	2,760,164.39
存出保证金	1,199,849.08	-	-	-	-	-	1,199,849.08
交易性金融资产	-	15,013,500.00	3,797,138.80	-	246,000.00	240,708,028.31	259,764,667.11
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	-	-	-	-	-	10,026.17	10,026.17
其他资产	-	-	-	-	-	381,921.09	381,921.09
资产总计	46,617,457.17	15,013,500.00	3,797,138.80	-	246,000.00	241,099,975.57	306,774,071.54
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	19,605,584.31	19,605,584.31
应付赎回款	-	-	-	-	-	355,975.01	355,975.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	367,116.16	367,116.16
应付托管费	-	-	-	-	-	61,186.04	61,186.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	80.80	80.80
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,796,850.99	1,796,850.99
负债总计	-	-	-	-	-	22,186,793.31	22,186,793.31
利率敏感度缺口	46,617,457.17	15,013,500.00	3,797,138.80	-	246,000.00	218,913,182.26	284,587,278.23

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	5,133.36	13,526.52
基准利率增加 25 个基点	-5,111.35	-13,455.67	

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	145,418,877.84	84.29	240,708,028.31	84.58
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	145,418,877.84	84.29	240,708,028.31	84.58

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，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。本基金根据行业轮动规律，80%以上的非现金基金资产投资于具有“三重优势”的股票、债券、权证等资产；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	业绩基准下跌 1%	-1,518,111.47	-3,699,634.62
	业绩基准下跌 5%	-7,590,557.36	-18,498,173.08
	业绩基准下跌 10%	-15,181,114.72	-36,996,346.17

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	144,711,941.34	239,212,652.21
第二层次	10,079,532.80	19,166,379.63
第三层次	676,022.15	1,385,635.27
合计	155,467,496.29	259,764,667.11

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	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	-	1,385,635.27	-	1,385,635.27
当期购买	-	693,013.44	-	693,013.44
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	1,385,635.27	-	1,385,635.27
当期利得或损失总额	-	-16,991.29	-	-16,991.29
其中：计入损益的利得或损失	-	-16,991.29	-	-16,991.29
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	676,022.15	-	676,022.15
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	-	-16,991.29	-	-16,991.29
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	2,940,706.40	-	2,940,706.40
当期购买	-	553,447.49	-	553,447.49
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	2,940,706.40	-	2,940,706.40
当期利得或损失总额	-	832,187.78	-	832,187.78
其中：计入损益的利得或损失	-	832,187.78	-	832,187.78
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-

期末余额	-	1,385,635.27	-	1,385,635.27
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	-	832,187.78	-	832,187.78

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	676,022.15	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,385,635.27	平均价格亚式期权模型	波动率	0.2434-2.2471	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	145,418,877.84	82.55
	其中：股票	145,418,877.84	82.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,048,618.45	5.70
	其中：债券	10,048,618.45	5.70
	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	19,928,817.75	11.31
8	其他各项资产	758,425.89	0.43
9	合计	176,154,739.93	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	3,399,000.00	1.97
C	制造业	89,259,457.24	51.74
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	880,992.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	6,983,184.00	4.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,898,016.97	10.37
J	金融业	10,811,223.00	6.27
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	6,922,642.23	4.01
N	水利、环境和公共设施管理业	13,113.82	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,246,051.68	5.36
R	文化、体育和娱乐业	5,196.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	145,418,877.84	84.29

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	600519	贵州茅台	6,900	11,916,300.00	6.91
2	002410	广联达	154,100	9,238,295.00	5.36
3	000858	五粮液	48,300	8,727,327.00	5.06
4	600570	恒生电子	212,344	8,591,438.24	4.98
5	002415	海康威视	225,200	7,809,936.00	4.53
6	300015	爱尔眼科	237,500	7,379,125.00	4.28
7	300124	汇川技术	101,700	7,068,150.00	4.10
8	002179	中航光电	121,139	6,996,988.64	4.06
9	002352	顺丰控股	120,900	6,983,184.00	4.05
10	300012	华测检测	309,700	6,906,310.00	4.00
11	002180	纳思达	98,100	5,090,409.00	2.95
12	600036	招商银行	102,000	3,800,520.00	2.20
13	002475	立讯精密	114,200	3,625,850.00	2.10
14	601166	兴业银行	199,500	3,509,205.00	2.03
15	601658	邮储银行	757,900	3,501,498.00	2.03
16	601012	隆基绿能	82,800	3,499,128.00	2.03
17	600885	宏发股份	102,800	3,434,548.00	1.99
18	601899	紫金矿业	339,900	3,399,000.00	1.97
19	300408	三环集团	110,500	3,393,455.00	1.97
20	600563	法拉电子	21,100	3,373,468.00	1.96
21	002384	东山精密	131,200	3,244,576.00	1.88
22	603288	海天味业	40,175	3,197,930.00	1.85
23	000568	泸州老窖	8,400	1,883,952.00	1.09
24	600763	通策医疗	12,100	1,851,179.00	1.07
25	002335	科华数据	35,700	1,781,073.00	1.03
26	002837	英维克	52,900	1,762,099.00	1.02
27	002372	伟星新材	80,900	1,726,406.00	1.00

28	300760	迈瑞医疗	5,421	1,712,873.37	0.99
29	002960	青鸟消防	60,860	1,703,471.40	0.99
30	603501	韦尔股份	20,582	1,586,666.38	0.92
31	600745	闻泰科技	29,400	1,545,852.00	0.90
32	603939	益丰药房	13,800	880,992.00	0.51
33	600276	恒瑞医药	22,800	878,484.00	0.51
34	000661	长春高新	4,800	798,960.00	0.46
35	300661	圣邦股份	4,400	759,440.00	0.44
36	002050	三花智控	35,500	753,310.00	0.44
37	300776	帝尔激光	1,240	156,240.00	0.09
38	688506	百利天恒	4,463	110,236.10	0.06
39	688205	德科立	2,090	102,368.20	0.06
40	688387	信科移动	18,688	91,197.44	0.05
41	300750	宁德时代	200	78,684.00	0.05
42	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
43	688432	有研硅	5,612	63,078.88	0.04
44	688503	聚和材料	450	61,375.50	0.04
45	688084	晶品特装	687	51,339.51	0.03
46	688459	哈铁科技	5,702	47,155.54	0.03
47	601689	拓普集团	300	17,574.00	0.01
48	301269	华大九天	192	16,884.48	0.01
49	301239	普瑞眼科	226	15,747.68	0.01
50	301095	广立微	154	13,319.46	0.01
51	301175	中科环保	2,182	13,113.82	0.01
52	301327	华宝新能	73	12,918.81	0.01
53	301297	富乐德	795	10,327.05	0.01
54	301308	江波龙	170	9,642.40	0.01
55	301301	川宁生物	1,207	9,088.71	0.01
56	301330	熵基科技	253	7,921.43	0.00
57	301338	凯格精机	159	7,789.41	0.00
58	301363	美好医疗	199	7,532.15	0.00
59	301121	紫建电子	145	7,216.65	0.00
60	301152	天力锂能	154	7,182.56	0.00
61	301283	聚胶股份	123	6,323.43	0.00
62	301306	西测测试	142	6,005.18	0.00
63	301328	维峰电子	77	5,925.92	0.00
64	301197	工大科雅	292	5,863.36	0.00
65	301132	满坤科技	234	5,728.32	0.00
66	301227	森鹰窗业	194	5,721.06	0.00

67	301270	汉仪股份	198	5,617.26	0.00
68	301171	易点天下	315	5,581.80	0.00
69	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
70	301339	通行宝	341	5,316.19	0.00
71	301139	元道通信	210	5,315.10	0.00
72	301326	捷邦科技	145	5,309.90	0.00
73	301313	凡拓数创	180	5,245.20	0.00
74	301231	荣信文化	255	5,196.90	0.00
75	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
76	301290	东星医疗	141	4,953.33	0.00
77	301398	星源卓镁	170	4,919.80	0.00
78	301280	珠城科技	101	4,524.80	0.00
79	301349	信德新材	43	4,451.36	0.00
80	301319	唯特偶	82	4,368.14	0.00
81	301368	丰立智能	225	4,167.00	0.00
82	301265	华新环保	321	3,659.40	0.00
83	301276	嘉曼服饰	144	3,255.84	0.00
84	301309	万得凯	115	2,812.90	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	300750	宁德时代	62,038,460.00	21.80
2	601012	隆基绿能	61,339,489.40	21.55
3	002475	立讯精密	58,215,419.98	20.46
4	601689	拓普集团	58,145,516.37	20.43
5	600519	贵州茅台	53,382,360.25	18.76
6	300776	帝尔激光	52,754,254.77	18.54
7	000568	泸州老窖	52,466,192.24	18.44
8	600522	中天科技	39,130,254.63	13.75
9	688223	晶科能源	35,289,863.06	12.40
10	600926	杭州银行	32,768,692.40	11.51
11	002466	天齐锂业	32,011,384.44	11.25
12	300751	迈为股份	31,963,789.00	11.23
13	300274	阳光电源	31,227,186.70	10.97
14	002920	德赛西威	29,498,529.00	10.37

15	600487	亨通光电	28,362,897.04	9.97
16	300014	亿纬锂能	28,081,012.00	9.87
17	688063	派能科技	27,633,590.83	9.71
18	002594	比亚迪	26,848,705.00	9.43
19	601318	中国平安	26,810,523.50	9.42
20	002960	青鸟消防	25,560,286.96	8.98
21	002460	赣锋锂业	24,593,100.48	8.64
22	688516	奥特维	23,864,456.33	8.39
23	300763	锦浪科技	22,247,310.35	7.82
24	002484	江海股份	22,046,832.82	7.75
25	300498	温氏股份	21,582,349.90	7.58
26	000858	五粮液	20,979,934.02	7.37
27	300496	中科创达	20,365,654.69	7.16
28	603005	晶方科技	20,146,611.16	7.08
29	600809	山西汾酒	19,808,636.08	6.96
30	600009	上海机场	19,743,952.00	6.94
31	002895	川恒股份	19,623,572.12	6.90
32	002812	恩捷股份	19,531,182.70	6.86
33	002709	天赐材料	19,488,474.00	6.85
34	300316	晶盛机电	19,465,613.12	6.84
35	000887	中鼎股份	19,225,940.42	6.76
36	600570	恒生电子	18,980,974.70	6.67
37	603606	东方电缆	18,971,836.00	6.67
38	002049	紫光国微	17,961,178.26	6.31
39	603305	旭升集团	17,883,497.50	6.28
40	002179	中航光电	17,544,124.00	6.16
41	002459	晶澳科技	17,437,437.52	6.13
42	600588	用友网络	17,266,311.00	6.07
43	002906	华阳集团	16,641,252.00	5.85
44	688599	天合光能	16,494,410.42	5.80
45	002008	大族激光	16,328,294.00	5.74
46	002714	牧原股份	15,906,770.20	5.59
47	600919	江苏银行	15,651,454.00	5.50
48	603596	伯特利	15,418,439.00	5.42
49	600036	招商银行	15,200,001.00	5.34
50	603939	益丰药房	15,133,630.00	5.32

51	002487	大金重工	14,720,115.00	5.17
52	002415	海康威视	14,538,750.88	5.11
53	601939	建设银行	14,500,340.00	5.10
54	300760	迈瑞医疗	14,467,342.04	5.08
55	601288	农业银行	14,428,150.00	5.07
56	600763	通策医疗	14,392,934.00	5.06
57	600276	恒瑞医药	14,379,090.32	5.05
58	601009	南京银行	14,315,446.94	5.03
59	600754	锦江酒店	14,280,164.39	5.02
60	002384	东山精密	13,961,421.00	4.91
61	688559	海目星	13,847,657.87	4.87
62	600765	中航重机	13,789,522.40	4.85
63	300450	先导智能	13,751,257.00	4.83
64	300438	鹏辉能源	13,730,402.70	4.82
65	603501	韦尔股份	13,720,946.80	4.82
66	603035	常熟汽饰	13,318,825.93	4.68
67	000049	德赛电池	13,113,165.48	4.61
68	002371	北方华创	13,045,035.00	4.58
69	000733	振华科技	13,035,640.00	4.58
70	601899	紫金矿业	12,691,032.58	4.46
71	601111	中国国航	12,632,550.00	4.44
72	002756	永兴材料	12,538,855.90	4.41
73	600438	通威股份	12,535,968.00	4.40
74	000333	美的集团	12,475,293.00	4.38
75	300015	爱尔眼科	12,227,525.93	4.30
76	603566	普莱柯	11,935,913.57	4.19
77	002050	三花智控	11,626,090.00	4.09
78	002352	顺丰控股	11,612,417.00	4.08
79	002840	华统股份	11,281,652.40	3.96
80	002074	国轩高科	11,172,349.00	3.93
81	002438	江苏神通	11,025,699.00	3.87
82	603799	华友钴业	11,023,352.30	3.87
83	000625	长安汽车	11,021,574.00	3.87
84	002180	纳思达	10,912,472.00	3.83
85	000519	中兵红箭	10,910,570.00	3.83
86	001979	招商蛇口	10,672,080.00	3.75

87	000876	新希望	10,587,705.30	3.72
88	601816	京沪高铁	10,483,572.00	3.68
89	601225	陕西煤业	10,324,264.84	3.63
90	002126	银轮股份	10,301,223.00	3.62
91	603806	福斯特	10,178,335.60	3.58
92	601238	广汽集团	10,174,136.23	3.58
93	601888	中国中免	9,877,339.00	3.47
94	300861	美畅股份	9,797,396.00	3.44
95	603985	恒润股份	9,068,836.70	3.19
96	300035	中科电气	8,933,650.00	3.14
97	688111	金山办公	8,926,265.78	3.14
98	603899	晨光股份	8,830,936.00	3.10
99	688005	容百科技	8,723,477.17	3.07
100	002410	广联达	8,700,699.00	3.06
101	002823	凯中精密	8,184,444.48	2.88
102	603290	斯达半导	8,051,085.00	2.83
103	002567	唐人神	8,029,152.63	2.82
104	600885	宏发股份	7,650,926.00	2.69
105	601166	兴业银行	7,477,550.00	2.63
106	601021	春秋航空	7,455,351.84	2.62
107	002738	中矿资源	7,355,393.00	2.58
108	300416	苏试试验	7,313,286.50	2.57
109	600566	济川药业	7,271,389.92	2.56
110	300124	汇川技术	7,248,406.00	2.55
111	603363	傲农生物	7,113,222.41	2.50
112	002335	科华数据	7,093,372.00	2.49
113	002196	方正电机	6,892,672.00	2.42
114	002241	歌尔股份	6,874,597.50	2.42
115	300012	华测检测	6,846,205.00	2.41
116	603906	龙蟠科技	6,846,023.00	2.41
117	688518	联赢激光	6,825,928.97	2.40
118	600887	伊利股份	6,770,210.00	2.38
119	002850	科达利	6,702,896.61	2.36
120	600660	福耀玻璃	6,678,847.49	2.35
121	002129	TCL 中环	6,658,756.00	2.34
122	300443	金雷股份	6,535,257.00	2.30

123	603659	璞泰来	6,533,512.00	2.30
124	300223	北京君正	6,512,974.00	2.29
125	603288	海天味业	6,493,165.66	2.28
126	600418	江淮汽车	6,416,430.99	2.25
127	603259	药明康德	6,356,165.00	2.23
128	603986	兆易创新	6,353,615.00	2.23
129	688008	澜起科技	6,282,798.60	2.21
130	601633	长城汽车	6,279,798.16	2.21
131	300712	永福股份	6,193,139.00	2.18
132	300428	立中集团	6,124,190.20	2.15
133	601799	星宇股份	6,010,458.00	2.11
134	002025	航天电器	5,993,111.00	2.11
135	601088	中国神华	5,833,635.00	2.05
136	002311	海大集团	5,769,926.00	2.03
137	601985	中国核电	5,743,653.00	2.02
138	600011	华能国际	5,740,282.00	2.02
139	002353	杰瑞股份	5,738,593.00	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	74,367,231.50	26.13
2	601012	隆基绿能	62,147,409.92	21.84
3	601689	拓普集团	60,164,792.75	21.14
4	300776	帝尔激光	59,558,303.80	20.93
5	002475	立讯精密	59,094,500.23	20.76
6	600519	贵州茅台	49,888,030.00	17.53
7	000568	泸州老窖	49,012,953.00	17.22
8	002920	德赛西威	42,930,128.21	15.09
9	600522	中天科技	38,929,314.00	13.68
10	688223	晶科能源	35,852,108.21	12.60
11	002466	天齐锂业	32,144,806.55	11.30
12	600926	杭州银行	32,048,886.27	11.26
13	600487	亨通光电	31,166,207.85	10.95

14	601318	中国平安	31,111,835.43	10.93
15	300751	迈为股份	30,849,739.00	10.84
16	300274	阳光电源	30,834,443.00	10.83
17	688063	派能科技	30,805,110.36	10.82
18	300014	亿纬锂能	29,143,658.15	10.24
19	002049	紫光国微	27,013,663.00	9.49
20	688516	奥特维	26,890,682.43	9.45
21	002008	大族激光	25,925,241.99	9.11
22	002594	比亚迪	25,797,595.50	9.06
23	603005	晶方科技	25,215,168.16	8.86
24	000887	中鼎股份	24,767,633.02	8.70
25	002460	赣锋锂业	24,368,552.62	8.56
26	300763	锦浪科技	23,491,241.00	8.25
27	603501	韦尔股份	22,366,489.20	7.86
28	002484	江海股份	21,576,440.00	7.58
29	002960	青鸟消防	21,393,075.14	7.52
30	300498	温氏股份	21,147,068.64	7.43
31	300496	中科创达	20,233,395.15	7.11
32	002050	三花智控	20,198,697.00	7.10
33	002812	恩捷股份	19,930,471.00	7.00
34	603606	东方电缆	19,353,080.00	6.80
35	600809	山西汾酒	19,160,870.00	6.73
36	600009	上海机场	18,680,554.55	6.56
37	002709	天赐材料	18,457,003.24	6.49
38	002895	川恒股份	18,275,992.45	6.42
39	300316	晶盛机电	18,181,751.40	6.39
40	603305	旭升集团	18,149,551.15	6.38
41	600036	招商银行	17,802,069.44	6.26
42	002241	歌尔股份	17,796,778.99	6.25
43	002906	华阳集团	17,213,528.46	6.05
44	603596	伯特利	16,763,328.00	5.89
45	002459	晶澳科技	16,568,749.60	5.82
46	600588	用友网络	16,452,966.00	5.78
47	688599	天合光能	15,773,164.84	5.54
48	600703	三安光电	15,689,431.39	5.51
49	600919	江苏银行	14,619,683.00	5.14
50	002487	大金重工	14,427,528.00	5.07
51	601939	建设银行	14,334,560.00	5.04

52	601288	农业银行	14,332,302.00	5.04
53	603939	益丰药房	14,330,189.28	5.04
54	601009	南京银行	14,100,833.00	4.95
55	002714	牧原股份	13,985,158.00	4.91
56	688559	海目星	13,979,564.23	4.91
57	300438	鹏辉能源	13,971,526.12	4.91
58	603035	常熟汽饰	13,484,031.03	4.74
59	000858	五粮液	13,355,648.00	4.69
60	600276	恒瑞医药	13,175,700.20	4.63
61	300450	先导智能	13,095,593.30	4.60
62	600765	中航重机	13,052,389.20	4.59
63	000049	德赛电池	12,849,010.10	4.51
64	600754	锦江酒店	12,777,794.00	4.49
65	002371	北方华创	12,754,474.70	4.48
66	000733	振华科技	12,474,922.00	4.38
67	300760	迈瑞医疗	12,295,494.00	4.32
68	300473	德尔股份	12,125,805.00	4.26
69	600763	通策医疗	11,955,294.37	4.20
70	002756	永兴材料	11,843,017.00	4.16
71	600438	通威股份	11,803,496.00	4.15
72	603566	普莱柯	11,644,501.84	4.09
73	601111	中国国航	11,596,313.00	4.07
74	300861	美畅股份	11,489,621.00	4.04
75	000333	美的集团	11,105,761.99	3.90
76	002921	联诚精密	11,068,920.96	3.89
77	002840	华统股份	11,008,643.81	3.87
78	000625	长安汽车	10,895,795.70	3.83
79	000519	中兵红箭	10,616,588.00	3.73
80	601238	广汽集团	10,555,215.00	3.71
81	603799	华友钴业	10,232,409.80	3.60
82	002126	银轮股份	10,229,323.00	3.59
83	600570	恒生电子	10,203,644.50	3.59
84	002074	国轩高科	10,039,942.00	3.53
85	601225	陕西煤业	10,022,319.00	3.52
86	601816	京沪高铁	9,940,664.00	3.49
87	000876	新希望	9,935,069.70	3.49
88	001979	招商蛇口	9,910,106.00	3.48
89	600893	航发动力	9,878,946.04	3.47

90	603806	福斯特	9,771,540.20	3.43
91	002438	江苏神通	9,744,221.00	3.42
92	002384	东山精密	9,738,619.00	3.42
93	002179	中航光电	9,430,178.00	3.31
94	601888	中国中免	9,167,079.00	3.22
95	688111	金山办公	8,753,299.90	3.08
96	300253	卫宁健康	8,743,492.16	3.07
97	603985	恒润股份	8,546,075.00	3.00
98	688005	容百科技	8,487,407.02	2.98
99	002284	亚太股份	8,486,650.98	2.98
100	300035	中科电气	8,345,081.00	2.93
101	601899	紫金矿业	8,322,241.00	2.92
102	688116	天奈科技	8,158,235.97	2.87
103	300083	创世纪	8,148,410.49	2.86
104	603290	斯达半导	8,099,953.00	2.85
105	603899	晨光股份	8,048,552.76	2.83
106	002318	久立特材	7,893,502.00	2.77
107	002567	唐人神	7,567,318.00	2.66
108	300428	立中集团	7,473,679.00	2.63
109	603363	傲农生物	7,461,165.80	2.62
110	603906	龙蟠科技	7,219,488.00	2.54
111	002415	海康威视	7,166,973.00	2.52
112	002823	凯中精密	7,126,450.51	2.50
113	300416	苏试试验	7,051,811.74	2.48
114	600566	济川药业	6,992,186.86	2.46
115	002738	中矿资源	6,980,816.75	2.45
116	300712	永福股份	6,886,788.00	2.42
117	002850	科达利	6,709,678.00	2.36
118	603657	春光科技	6,689,166.80	2.35
119	688518	联赢激光	6,567,797.73	2.31
120	002353	杰瑞股份	6,392,664.96	2.25
121	002196	方正电机	6,363,110.00	2.24
122	600660	福耀玻璃	6,286,189.00	2.21
123	600887	伊利股份	6,283,065.00	2.21
124	002129	TCL 中环	6,266,437.00	2.20
125	600418	江淮汽车	6,214,992.00	2.18
126	688008	澜起科技	6,143,091.93	2.16
127	600795	国电电力	6,131,181.01	2.15

128	300223	北京君正	6,128,816.00	2.15
129	601633	长城汽车	6,128,163.00	2.15
130	002025	航天电器	6,091,381.10	2.14
131	603259	药明康德	6,041,806.00	2.12
132	601799	星宇股份	6,023,802.00	2.12
133	603659	璞泰来	6,010,112.00	2.11
134	601021	春秋航空	5,908,146.00	2.08
135	601088	中国神华	5,823,644.00	2.05
136	300443	金雷股份	5,800,012.58	2.04
137	002311	海大集团	5,698,953.00	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	2,536,326,469.87
卖出股票收入（成交）总额	2,559,956,861.58

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,969,296.70	5.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	79,321.75	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,048,618.45	5.82

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	229945	22 贴现国债 45	100,000	9,969,296.70	5.78
2	113661	福 22 转债	630	79,321.75	0.05

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票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	751,145.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,280.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	758,425.89

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
东吴行业轮动混合 A	17,439	13,357.34	13,528,428.42	5.81%	219,410,294.43	94.19%
东吴行业轮动混合 C	466	917.78	5,808.55	1.36%	421,876.07	98.64%
合计	17,905	13,033.59	13,534,236.97	5.80%	219,832,170.50	94.20%

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	东吴行业轮动混合 A	2,968.95	0.0013%
	东吴行业轮动混合 C	1,537.87	0.3596%
	合计	4,506.82	0.0019%

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C
基金合同生效日（2008年4月23日）基金份额总额	3,173,064,234.06	-
本报告期期初基金份额总额	222,429,612.65	191,790.33
本报告期基金总申购份额	34,718,055.74	1,107,467.20
减：本报告期基金总赎回份额	24,208,945.54	871,572.91
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	232,938,722.85	427,684.62

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 1 月 21 日开始分为 A、C 两类。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

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

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

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

本报告期内，无涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内应支付审计费 50000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
民生证券	1	1,857,421,160.26	36.54%	1,703,011.10	36.25%	-
安信证券	1	1,096,639,652.87	21.57%	1,021,296.40	21.74%	-
东吴证券	2	774,824,221.66	15.24%	719,522.09	15.31%	-
招商证券	2	755,342,309.91	14.86%	700,132.48	14.90%	-
华福证券	2	366,570,341.07	7.21%	340,154.10	7.24%	-
国信证券	1	80,272,649.49	1.58%	73,667.21	1.57%	-
国泰君安	1	78,085,041.48	1.54%	71,939.22	1.53%	-
华泰证券	2	66,666,013.59	1.31%	61,419.51	1.31%	-
国盛证券	2	7,988,849.17	0.16%	7,440.03	0.16%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金新增 2 个交易单元，为华福证券；退租 3 个交易单元，为诚通证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	959,996.40	12.19%	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	6,913,651.20	87.81%	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2021 年年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金和私募资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 1 日
3	东吴基金管理有限公司关于终止科地瑞富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 12 日
4	东吴行业轮动混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 19 日
5	东吴行业轮动混合型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额)、大额转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 19 日
6	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 24 日
7	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 24 日
8	东吴基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2022 年 2 月 18 日

	旗下部分基金新增北京中植基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海银基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 28 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申万宏源（西部）证券有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 9 日
11	东吴基金管理有限公司关于参加广发证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 25 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 25 日
13	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 31 日
14	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 31 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 7 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 9 日
17	东吴基金管理有限公司关于参加泰信财富基金销售有限公司申购补差费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 11 日

18	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 22 日
19	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 22 日
20	东吴基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 29 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 13 日
22	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于北京证券交易所股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 23 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 27 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 8 日
25	东吴基金管理有限公司关于参加平安证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 28 日
26	东吴基金管理有限公司管理的基金 2022 年半年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2022 年 7 月 1 日
27	东吴基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 7 月 11 日
28	东吴基金管理有限公司关于北京微动利基金销售有限公司	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2022 年 7 月 14 日

	司办理旗下基金相关销售业务的公告	券日报、公司网站、 中证信息网站	
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国联证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 7 月 14 日
30	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 7 月 21 日
31	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 年 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 7 月 21 日
32	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在诺亚正行基金销售有限公司的定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 7 月 23 日
33	东吴基金管理有限公司关于参加光大银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 7 月 27 日
34	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 8 月 3 日
35	东吴基金管理有限公司关于参加中国建设银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 8 月 18 日
36	东吴基金管理有限公司关于参加世纪证券有限责任公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 8 月 25 日
37	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 8 月 29 日
38	东吴行业轮动混合型证券投资基金 2022 年中期报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 8 月 31 日
39	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 8 月 31 日

40	东吴基金管理有限公司高级 管理人员变更公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 9 月 9 日
41	东吴基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增招商证券 股份有限公司 为代销机构、开通定期定额及 转换业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 9 月 9 日
42	东吴基金管理有限公司旗下 基金招募说明书更新的提示 性公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 9 月 13 日
43	东吴行业轮动混合型证券投 资基金更新招募说明书及产 品资料概要	公司网站、中证信息 网站	2022 年 9 月 13 日
44	东吴基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增九州证券 股份有限公司为代销机构、开 通定期定额及转换业务的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 9 月 29 日
45	东吴行业轮动混合型证券投 资基金 2022 年第 3 季度报告	公司网站、中证信息 网站	2022 年 10 月 26 日
46	东吴基金管理有限公司旗下 基金 2022 年 3 季度报告提示 性公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站、 中证信息网站	2022 年 10 月 26 日
47	东吴基金管理有限公司高级 管理人员变更公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、上交所网 站、公司网站、中证 信息网站	2022 年 12 月 6 日
48	东吴基金管理有限公司关于 参加深圳众禄基金销售股份 有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、上交所网 站、公司网站、中证 信息网站	2022 年 12 月 16 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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行业轮动股票型证券投资基金设立的文件；
2. 《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《东吴行业轮动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. 报告期内东吴行业轮动混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日