

东吴行业轮动混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	66

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 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	238,878,637.49 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	235,787,113.38 份	3,091,524.11 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	北京市东城区建国门内大街 22 号

	瑞明大厦 9 楼	号
邮政编码	200120	100005
法定代表人	李素明	李民吉

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,485,167.30	76,624.67
本期利润	21,938,454.21	61,434.20
加权平均基金份额本期利润	0.0933	0.0435
本期加权平均净值利润率	11.86%	6.00%
本期基金份额净值增长率	12.55%	12.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-39,582,345.22	-740,777.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1679	-0.2396
期末基金资产净值	196,204,768.16	2,350,746.86
期末基金份额净值	0.8321	0.7604
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	8.44%	-22.89%

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

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

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

4、本基金于 2021 年 1 月 21 日开始分为 A、C 两类。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴行业轮动混合 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
过去一个月	8.97%	2.47%	1.01%	0.65%	7.96%	1.82%
过去三个月	-0.20%	2.69%	-3.36%	0.62%	3.16%	2.07%
过去六个月	12.55%	2.17%	0.18%	0.63%	12.37%	1.54%
过去一年	-9.72%	1.73%	-9.60%	0.74%	-0.12%	0.99%
过去三年	6.25%	1.65%	-2.50%	0.90%	8.75%	0.75%

自基金合同生效起至今	8.44%	1.84%	33.39%	1.18%	-24.95%	0.66%
------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

东吴行业轮动混合 C

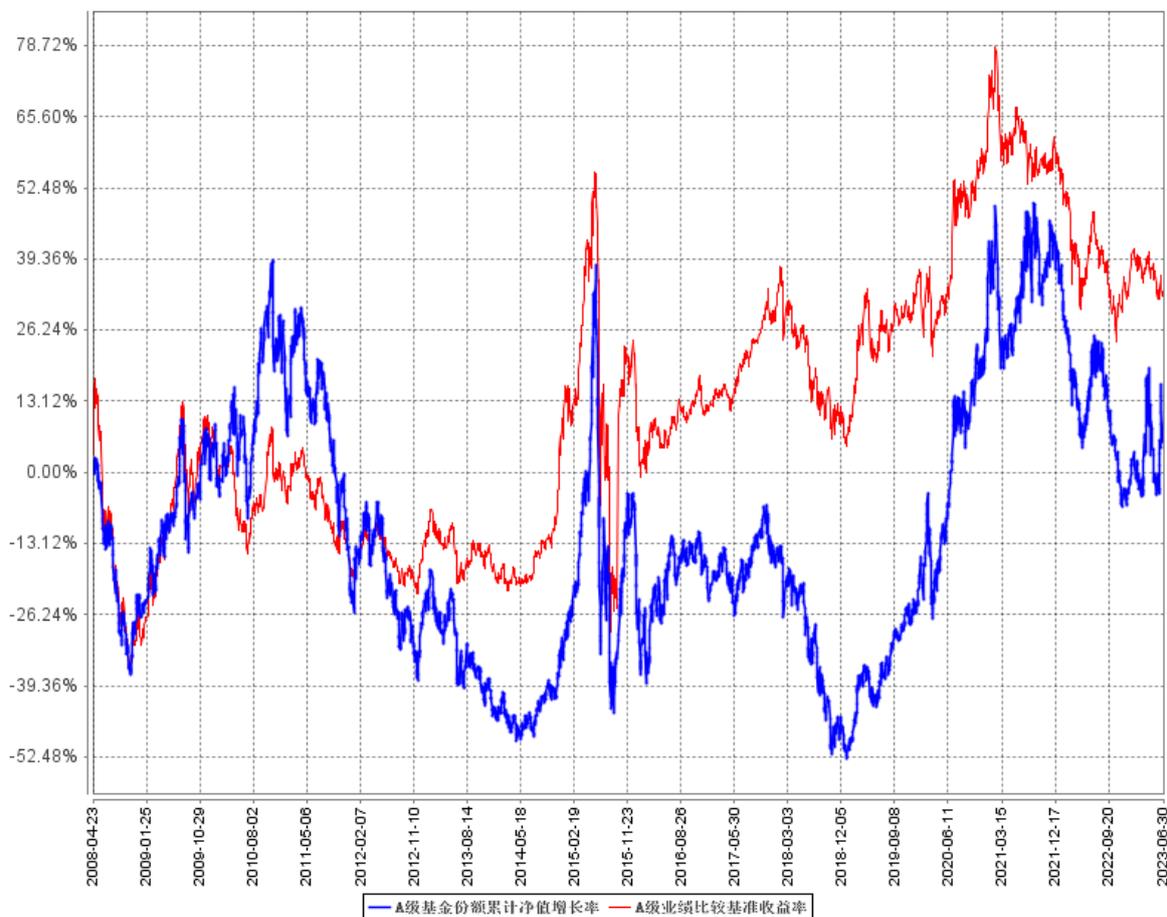
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.94%	2.47%	1.01%	0.65%	7.93%	1.82%
过去三个月	-0.30%	2.69%	-3.36%	0.62%	3.06%	2.07%
过去六个月	12.32%	2.17%	0.18%	0.63%	12.14%	1.54%
过去一年	-10.09%	1.73%	-9.60%	0.74%	-0.49%	0.99%
自基金合同生效起至今	-22.89%	1.67%	-19.34%	0.87%	-3.55%	0.80%

注：1、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

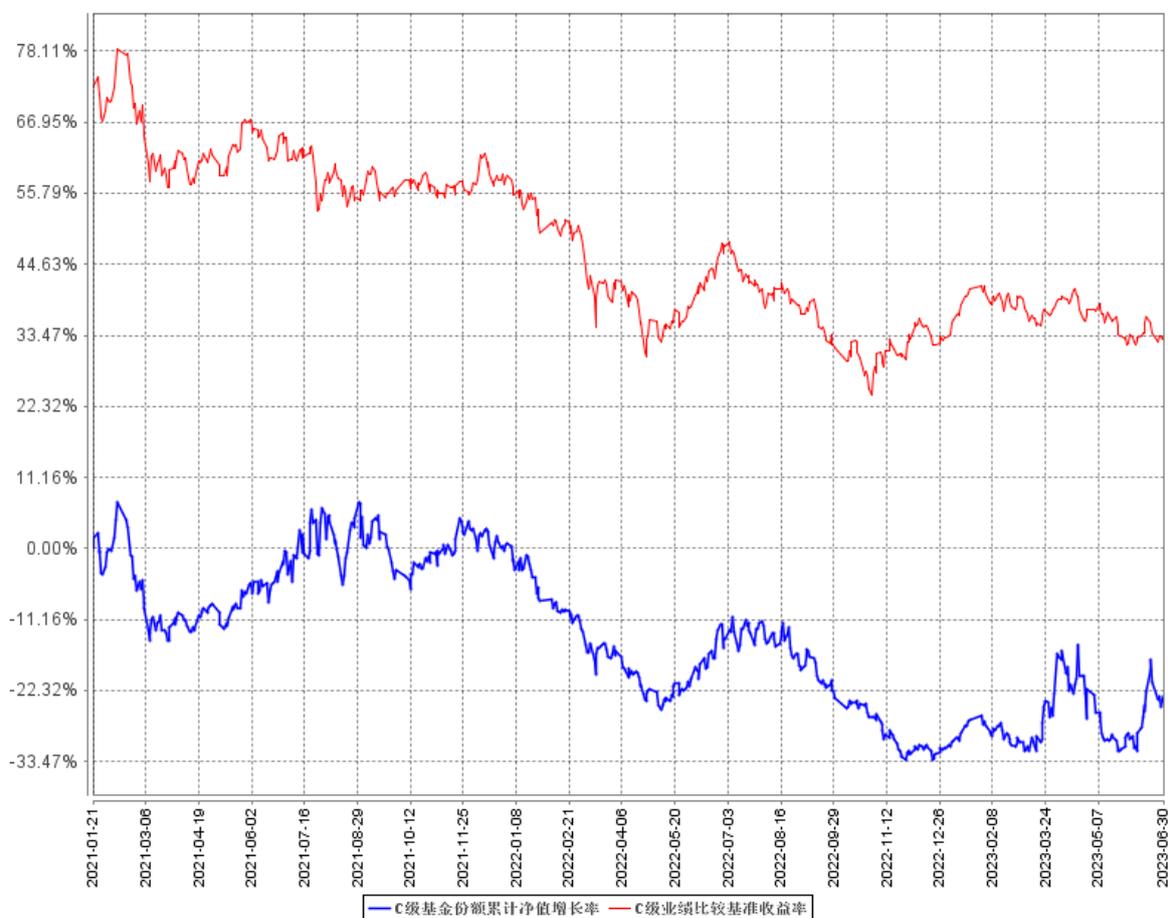
2、本基金于 2021 年 1 月 21 日开始分为 A、C 两类。

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、业绩比较基准=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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	-	13 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、基金经理的任职日期为公司对外公告之日;邬炜自 2023 年 8 月 15 日起不再担任该基金基金经理。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年上半年，A 股市场整体低位震荡，结构分化明显。期间，宏观和产业环境的主要变化如下：第一，国内企业盈利依然承压。上半年国内经济整体复苏力度低于市场预期，尤其是二季度有一定压力。工业企业利润总额累计同比增速从 2022 年的 -4% 下滑至 2023 年前 5 月的 -18.8%。第二，海外金融环境有所波动，美联储在加息后半程传递的政策信号有所反复。美联储 2023 年上半年继续加息 3 次，将联邦基金利率从 4.5% 提升至 5.25%。2023 年上半年市场曾一度乐观预期下半年可能不再加息甚至降息，但美联储在年中传递偏鹰信号，市场也将预期下修至 2024 年才可能进入降息周期。第三，以 ChatGPT 为代表的 AI 产业趋势快速发展，有望驱动科技行业的新一轮景气周期。

在此背景下，主要股指和行业指数出现较大分化：沪深 300 下跌 0.75%、上证 50 下跌 5.43%、创业板指数下跌 5.61%、科创 50 指数上涨 4.71%、上证指数上涨 3.65%；行业层面，通信、传媒、计算机、家电、机械、电子等表现居前，消费者服务、房地产、农林牧渔、建材、基础化工等表现较差。

投资运作方面，2023 年上半年，本基金仓位中性，组合结构主要集中于科技成长领域，年度净值表现跑赢基准。2023 年上半年基金净值增长率 12.55%，基金业绩基准收益率为-0.75%，净值跑赢基准 13.3%。

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 0.8321 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.55%；截至本报告期末东吴行业轮动混合 C 基金份额净值为 0.7604 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.32%；同期业绩比较基准收益率为 0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

政策层面，2023 年下半年国内外货币政策有望由分歧逐渐走向一致，全球流动性可能由紧变松。国内货币政策在 2023 年上半年延续了中性偏宽松的基调，1 年期和 5 年期 LRP 利率各下调了 10bp，存款准备金率也下调了 0.25%。展望 2023 年下半年，我们认为国内通胀压力可能相对较小，而海外通胀也已呈现明显的下行趋势，预计国内 2023 年下半年可能继续保持中性偏宽松的货币政策格局。信用传导方面，从稳增长角度考虑，预计 2023 年下半年国内信用环境也有望维持偏宽。

其他政策方面，比如房地产等领域，考虑到国内坚持高质量发展的基调不变，下半年经济强刺激的概率可能不大。海外方面，以美联储为代表的发达国家央行有望结束加息周期。美联储自 2022 年 3 月开启了一轮史无前例的快速加息周期，截至 2023 年 5 月，已加息 10 次，将基准利率上限从 0.25% 加至 5.25%。美国通胀是美联储加息的核心影响因素，当前俄乌冲突对全球大宗商品的影响逐渐弱化，全球大宗价格进入下行区间，美国 CPI 从 2022 年 6 月的 9.1% 下行至 2023 年 6 月的 3%，呈现通胀加速回落态势。美联储本轮加息周期有望在 2023 年结束，2024 年有望进入降息周期。

资本市场方面，我们认为 2023 年下半年市场向上机会可能大于向下风险。展望 2023 年下半年，A 股基本面、流动性和估值这三大因素中至少有两个因素是有望改善的。一是国内经济基本面有望触底。二是海外美联储有望在 2023 年结束加息，国内流动性可能继续维持中性偏宽。三是当前 A 股估值处于历史相对偏低水平。这对权益市场来说或许是个相对有利的组合。

基于上述分析，展望 2023 年下半年，本基金的投资策略主要有以下两个方面：第一，行业选择上，本基金以资产定价评估叠加成长投资为投资框架，继续努力寻找估值合理甚至偏低，且基本面有望持续改善、乃至有望进入扩张周期的行业。当前，我们更为关注的行业主要包括：电子及半导体、汽车零部件、食品饮料等。第二，我们将继续深耕科技、制造、消费三大领域，力争通过长期跟踪竞争优势突出、行业土壤肥沃的优质公司，挖掘个股超额收益。我们将继续努力，为投资人创造更好的投资体验和可持续的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；基金会计等参与基金组合估值方法的确定，

复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 2023 年中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	30,153,982.18	17,242,148.12
结算备付金		3,348,425.95	2,686,669.63
存出保证金		685,505.86	751,145.16
交易性金融资产	6.4.7.2	175,874,470.63	155,467,496.29
其中：股票投资		174,042,108.60	145,418,877.84
基金投资		-	-
债券投资		1,832,362.03	10,048,618.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		2,031,258.78	-
应收股利		-	-
应收申购款		59,460.57	7,280.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		212,153,103.97	176,154,739.93
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,795,232.95	1,923,972.88
应付赎回款		262,176.36	114,711.17
应付管理人报酬		237,928.15	218,646.06
应付托管费		39,654.71	36,441.01
应付销售服务费		834.49	98.43
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	6.4.7.6	2,261,762.29	1,348,202.72
负债合计		13,597,588.95	3,642,072.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	238,878,637.49	233,366,407.47
未分配利润	6.4.7.8	-40,323,122.47	-60,853,740.16
净资产合计		198,555,515.02	172,512,667.31
负债和净资产总计		212,153,103.97	176,154,739.93

报告截止日 2023 年 6 月 30 日，东吴行业轮动混合 A 基金份额净值 0.8321 元，基金份额总额 235,787,113.38 份；东吴行业轮动混合 C 基金份额净值 0.7604 元，基金份额总额 3,091,524.11 份。东吴行业轮动混合份额总额合计为 238,878,637.49 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		23,722,827.34	-36,734,324.55
1.利息收入		71,788.12	79,507.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	71,788.12	79,507.19
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,178,911.51	-30,568,173.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,536,984.29	-31,563,118.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	60,520.20	199,226.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	581,407.02	795,717.99
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	12,438,096.44	-6,250,554.39

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	34,031.27	4,896.64
减：二、营业总支出		1,722,938.93	2,015,476.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,387,372.31	1,635,226.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	231,228.70	272,537.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,035.28	451.64
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.08	0.99
8. 其他费用	6.4.7.18	102,302.56	107,260.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,999,888.41	-38,749,801.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,999,888.41	-38,749,801.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,999,888.41	-38,749,801.49

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	233,366,407.47	-60,853,740.16	172,512,667.31
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）	233,366,407.47	-60,853,740.16	172,512,667.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,512,230.02	20,530,617.69	26,042,847.71
（一）、综合收益总额	-	21,999,888.41	21,999,888.41
（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）	5,512,230.02	-1,469,270.72	4,042,959.30
其中：1.基金申购款	25,593,750.80	-5,539,733.20	20,054,017.60
2.基金赎回款	-20,081,520.78	4,070,462.48	-16,011,058.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	238,878,637.49	-40,323,122.47	198,555,515.02
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	222,621,402.98	61,965,875.25	284,587,278.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	30,153,982.18
等于：本金	30,150,741.19
加：应计利息	3,240.99
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：	30,153,982.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		157,531,352.15	-	174,042,108.60	16,510,756.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,798,161.00	32,542.03	1,832,362.03	1,659.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,798,161.00	32,542.03	1,832,362.03	1,659.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		159,329,513.15	32,542.03	175,874,470.63	16,512,415.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	852.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,167,607.40
其中：交易所市场	2,167,607.40
银行间市场	-
应付利息	-
应付账户维护费	9,000.00

应付审计费	24,795.19
应付信息披露费	59,507.37
合计	2,261,762.29

6.4.7.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	232,938,722.85	232,938,722.85
本期申购	18,822,116.83	18,822,116.83
本期赎回(以“-”号填列)	-15,973,726.30	-15,973,726.30
- 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	235,787,113.38	235,787,113.38

金额单位：人民币元

东吴行业轮动混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	427,684.62	427,684.62
本期申购	6,771,633.97	6,771,633.97
本期赎回(以“-”号填列)	-4,107,794.48	-4,107,794.48
- 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	3,091,524.11	3,091,524.11

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。

6.4.7.8 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	-18,784,143.61	-41,931,443.33	-60,715,586.94

本期利润	9,485,167.30	12,453,286.91	21,938,454.21
本期基金份额交易产生的变动数	-108,118.04	-697,094.45	-805,212.49
其中：基金申购款	-1,111,940.56	-2,698,827.55	-3,810,768.11
基金赎回款	1,003,822.52	2,001,733.10	3,005,555.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,407,094.35	-30,175,250.87	-39,582,345.22

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	8,019.83	-146,173.05	-138,153.22
本期利润	76,624.67	-15,190.47	61,434.20
本期基金份额交易产生的变动数	83,961.44	-748,019.67	-664,058.23
其中：基金申购款	237,976.93	-1,966,942.02	-1,728,965.09
基金赎回款	-154,015.49	1,218,922.35	1,064,906.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	168,605.94	-909,383.19	-740,777.25

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	47,356.90
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	18,955.41
其他	5,475.81
合计	71,788.12

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,977,427,514.62
减：卖出股票成本总额	1,960,944,410.91
减：交易费用	5,946,119.42
买卖股票差价收入	10,536,984.29

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	33,684.55
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	26,835.65
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	60,520.20

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,085,998.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,981,530.00
减：应计利息总额	77,629.00
减：交易费用	3.43
买卖债券差价收入	26,835.65

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无权证投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	581,407.02
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	581,407.02

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,438,096.44
——股票投资	12,450,218.14
——债券投资	-12,121.70
——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	12,438,096.44

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	33,268.48
转换费收入 011240	317.46
转换费收入 580003	445.33
合计	34,031.27

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他费用	-
数字证书服务费	-
汇划费	-
合计	102,302.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东吴证券股份有限 公司	1,047,464,597.24	26.51%	511,214,033.68	22.03%

6.4.10.1.2 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6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 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	1,884,159.08	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	972,928.76	26.60%	686,142.98	31.65%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	475,442.01	22.23%	413,150.38	44.74%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,387,372.31	1,635,226.45
其中：支付销售机构的客户维护费	460,991.09	524,087.13

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	231, 228. 70	272, 537. 71

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	2. 90	2. 90
东吴证券股份有限公司	-	4. 40	4. 40
合计	-	7. 30	7. 30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴行业轮动混合 A	东吴行业轮动混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	4. 42	4. 42
合计	-	4. 42	4. 42

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	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	30,153,982.18	47,356.90	28,058,013.06	56,920.18

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股限售	19.86	18.06	840	16,682.40	15,170.40	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股限售	23.60	64.67	163	3,846.80	10,541.21	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股限售	32.52	42.37	173	5,625.96	7,330.01	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股限售	39.99	36.71	161	6,438.39	5,910.31	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股限售	43.67	53.05	110	4,803.70	5,835.50	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股限售	35.00	51.23	108	3,780.00	5,532.84	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股限售	21.86	23.85	221	4,831.06	5,270.85	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股限售	36.15	38.13	136	4,916.40	5,185.68	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股限售	11.18	14.59	326	3,644.68	4,756.34	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股限售	30.26	25.33	177	5,356.02	4,483.41	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股限售	26.66	31.50	140	3,732.40	4,410.00	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股限售	33.99	29.49	128	4,350.72	3,774.72	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股限售	6.58	7.58	489	3,217.62	3,706.62	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股限售	17.80	17.89	164	2,919.20	2,933.96	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股限售	10.36	11.84	183	1,895.88	2,166.72	-

601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股限售	11.66	12.26	170	1,982.20	2,084.20	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股限售	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股限售	25.98	24.53	54	1,402.92	1,324.62	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股限售	29.60	71.42	160	4,736.00	11,427.20	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股限售	24.80	43.85	230	5,704.00	10,085.50	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股限售	76.80	107.95	91	6,988.80	9,823.45	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股限售	20.67	26.17	347	7,172.49	9,080.99	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股限售	67.28	65.43	128	8,611.84	8,375.04	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股限售	23.77	42.89	180	4,278.60	7,720.20	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股限售	30.85	23.63	286	8,823.10	6,758.18	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股限售	41.20	42.69	149	6,138.80	6,360.81	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股限售	26.80	22.32	281	7,530.80	6,271.92	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股限售	43.99	51.57	121	5,322.79	6,239.97	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股限售	23.80	32.84	186	4,426.80	6,108.24	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股限售	32.34	31.86	179	5,788.86	5,702.94	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股限售	16.24	16.95	332	5,391.68	5,627.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股限售	28.75	21.02	255	7,331.25	5,360.10	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股限售	26.35	30.60	169	4,453.15	5,171.40	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股限售	58.32	45.36	110	6,415.20	4,989.60	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股限售	50.00	30.71	155	7,750.00	4,760.05	-
001287	中电	2023年3月	6个月	新股限售	11.88	21.02	220	2,613.60	4,624.40	-

	港	月 30 日								
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股限售	14.81	13.73	323	4,783.63	4,434.79	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股限售	131.11	53.24	81	7,079.94	4,312.44	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股限售	25.25	19.69	218	5,504.50	4,292.42	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股限售	33.73	31.85	132	4,452.36	4,204.20	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股限售	44.18	25.10	158	4,992.34	3,965.80	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股限售	29.99	23.79	165	4,948.35	3,925.35	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股限售	46.13	34.40	113	5,212.69	3,887.20	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股限售	19.99	16.90	228	4,557.72	3,853.20	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股限售	39.06	39.36	97	3,788.82	3,817.92	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股限售	56.50	52.93	72	4,068.00	3,810.96	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股限售	28.84	30.78	102	2,941.68	3,139.56	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股限售	73.45	46.64	60	4,407.00	2,798.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股限售	20.68	25.49	64	1,323.52	1,631.36	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股限售	15.38	14.87	93	1,430.34	1,382.91	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股限售	44.48	39.48	30	1,334.40	1,184.40	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。本基金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。

6.4.13.1 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业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风

险发生的可能性很小；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,832,362.03	9,969,296.70
合计	1,832,362.03	9,969,296.70

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	79,321.75
未评级	-	-
合计	-	79,321.75

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	30,153,982.18	-	-	-	-	-	30,153,982.18
结算备付金	3,348,425.95	-	-	-	-	-	3,348,425.95
存出保证金	685,505.86	-	-	-	-	-	685,505.86
交易性金融资产	1,832,362.03	-	-	-	-	174,042,108.60	175,874,470.63

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,031,258.78	2,031,258.78
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	59,460.57	59,460.57
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	36,020,276.02	-	-	-	-	176,132,827.95	212,153,103.97
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,795,232.95	10,795,232.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	262,176.36	262,176.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	237,928.15	237,928.15
应付托管费	-	-	-	-	-	39,654.71	39,654.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	834.49	834.49
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,261,762.29	2,261,762.29
负债总计	-	-	-	-	-	13,597,588.95	13,597,588.95
利率敏感度缺口	36,020,276.02	-	-	-	-	-162,535,239.00	198,555,515.02
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	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

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。

6.4.13.4.1.2 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	213.04	5,133.36
基准利率增加 25 个基点	-212.99	-5,111.35	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	174,042,108.60	87.65	145,418,877.84	84.29
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	174,042,108.60	87.65	145,418,877.84	84.29

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
	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）	
分析		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
1. 业绩基准下跌 1%	-2,918,766.07	-1,518,111.47	
2. 业绩基准下跌 5%	-14,593,830.35	-7,590,557.36	
3. 业绩基准下跌 10%	-29,187,660.71	-15,181,114.72	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	173,739,147.58	144,711,941.34
第二层次	1,924,747.28	10,079,532.80
第三层次	210,575.77	676,022.15
合计	175,874,470.63	155,467,496.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	174,042,108.60	82.04
	其中：股票	174,042,108.60	82.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,832,362.03	0.86
	其中：债券	1,832,362.03	0.86
	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	33,502,408.13	15.79
8	其他各项资产	2,776,225.21	1.31
9	合计	212,153,103.97	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	146,823,573.99	73.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	2,084.20	0.00
F	批发和零售业	13,958.42	0.01
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	27,147,437.70	13.67
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	8,179.62	0.00

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,427.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	174,042,108.60	87.65

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688111	金山办公	32,997	15,581,843.34	7.85
2	002920	德赛西威	94,200	14,677,302.00	7.39
3	002475	立讯精密	423,200	13,732,840.00	6.92
4	603501	韦尔股份	138,700	13,598,148.00	6.85
5	601138	工业富联	504,800	12,720,960.00	6.41
6	300394	天孚通信	116,700	12,467,061.00	6.28
7	601689	拓普集团	147,800	11,927,460.00	6.01
8	000063	中兴通讯	260,000	11,840,400.00	5.96
9	300308	中际旭创	80,000	11,796,000.00	5.94
10	600941	中国移动	123,800	11,550,540.00	5.82
11	002050	三花智控	322,300	9,752,798.00	4.91
12	002126	银轮股份	465,900	8,246,430.00	4.15
13	000938	紫光股份	250,100	7,965,685.00	4.01
14	603728	鸣志电器	75,600	6,070,680.00	3.06
15	603290	斯达半导	18,200	3,916,640.00	1.97
16	600519	贵州茅台	2,300	3,889,300.00	1.96
17	688498	源杰科技	7,197	2,051,145.00	1.03
18	002371	北方华创	6,100	1,937,665.00	0.98
19	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
20	688249	晶合集成	840	15,170.40	0.01
21	301293	三博脑科	160	11,427.20	0.01
22	301301	川宁生物	1,207	10,814.72	0.01
23	688361	中科飞测	163	10,541.21	0.01
24	301419	阿莱德	230	10,085.50	0.01
25	301325	曼恩斯特	91	9,823.45	0.00
26	301317	鑫磊股份	347	9,080.99	0.00

27	301310	鑫宏业	128	8,375.04	0.00
28	301358	湖南裕能	180	7,720.20	0.00
29	688478	晶升股份	173	7,330.01	0.00
30	301260	格力博	286	6,758.18	0.00
31	301141	中科磁业	149	6,360.81	0.00
32	301303	真兰仪表	281	6,271.92	0.00
33	301399	英特科技	121	6,239.97	0.00
34	301382	蜂助手	186	6,108.24	0.00
35	688484	南芯科技	161	5,910.31	0.00
36	688543	国科军工	110	5,835.50	0.00
37	301307	美利信	179	5,702.94	0.00
38	301408	华人健康	332	5,627.40	0.00
39	688535	华海诚科	108	5,532.84	0.00
40	301280	珠城科技	152	5,435.52	0.00
41	301429	森泰股份	255	5,360.10	0.00
42	688523	航天环宇	221	5,270.85	0.00
43	688146	中船特气	136	5,185.68	0.00
44	301428	世纪恒通	169	5,171.40	0.00
45	301387	光大同创	110	4,989.60	0.00
46	301246	宏源药业	155	4,760.05	0.00
47	688593	新相微	326	4,756.34	0.00
48	001287	中电港	220	4,624.40	0.00
49	688570	天玛智控	177	4,483.41	0.00
50	301332	德尔玛	323	4,434.79	0.00
51	688433	华曙高科	140	4,410.00	0.00
52	301322	绿通科技	81	4,312.44	0.00
53	301305	朗坤环境	218	4,292.42	0.00
54	301373	凌玮科技	132	4,204.20	0.00
55	301281	科源制药	158	3,965.80	0.00
56	301386	未来电器	165	3,925.35	0.00
57	301203	国泰环保	113	3,887.20	0.00
58	301439	泓淋电力	228	3,853.20	0.00
59	301323	新莱福	97	3,817.92	0.00
60	301157	华塑科技	72	3,810.96	0.00
61	688479	友车科技	128	3,774.72	0.00
62	601061	中信金属	489	3,706.62	0.00
63	001380	华纬科技	102	3,139.56	0.00
64	603135	中重科技	164	2,933.96	0.00
65	301345	涛涛车业	60	2,798.40	0.00

66	601065	江盐集团	183	2,166.72	0.00
67	601133	柏诚股份	170	2,084.20	0.00
68	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
69	001328	登康口腔	64	1,631.36	0.00
70	001360	南矿集团	93	1,382.91	0.00
71	603125	常青科技	54	1,324.62	0.00
72	001367	海森药业	30	1,184.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603019	中科曙光	61,714,949.01	35.77
2	603986	兆易创新	60,451,825.60	35.04
3	002463	沪电股份	51,363,252.98	29.77
4	603501	韦尔股份	50,630,050.30	29.35
5	000938	紫光股份	49,471,506.06	28.68
6	002230	科大讯飞	48,891,832.00	28.34
7	688111	金山办公	47,533,681.37	27.55
8	000063	中兴通讯	42,084,064.09	24.39
9	300394	天孚通信	41,893,227.20	24.28
10	600941	中国移动	40,110,518.89	23.25
11	002475	立讯精密	39,751,008.73	23.04
12	300502	新易盛	36,905,622.28	21.39
13	688041	海光信息	35,660,365.34	20.67
14	002236	大华股份	34,228,502.82	19.84
15	600519	贵州茅台	34,161,760.98	19.80
16	600584	长电科技	33,854,390.04	19.62
17	000568	泸州老窖	31,208,621.00	18.09
18	300033	同花顺	30,170,741.00	17.49
19	000858	五粮液	30,109,055.50	17.45
20	300782	卓胜微	29,488,216.55	17.09
21	002555	三七互娱	28,428,654.49	16.48
22	002156	通富微电	26,104,880.63	15.13
23	300308	中际旭创	25,072,019.44	14.53
24	603005	晶方科技	24,020,481.82	13.92

25	688981	中芯国际	23,905,827.15	13.86
26	300750	宁德时代	22,563,305.60	13.08
27	688256	寒武纪	20,682,869.09	11.99
28	300347	泰格医药	20,267,670.32	11.75
29	002050	三花智控	19,527,669.65	11.32
30	002439	启明星辰	19,272,994.40	11.17
31	002624	完美世界	19,152,740.20	11.10
32	002436	兴森科技	19,026,656.00	11.03
33	300413	芒果超媒	18,077,737.00	10.48
34	300170	汉得信息	17,718,696.89	10.27
35	688012	中微公司	17,155,792.44	9.94
36	300017	网宿科技	16,605,789.00	9.63
37	002916	深南电路	16,332,822.73	9.47
38	600570	恒生电子	16,004,203.22	9.28
39	600309	万华化学	15,889,601.00	9.21
40	601138	工业富联	15,481,962.00	8.97
41	002920	德赛西威	14,512,883.00	8.41
42	002153	石基信息	14,469,850.16	8.39
43	601318	中国平安	14,451,341.00	8.38
44	002415	海康威视	14,331,511.52	8.31
45	603444	吉比特	14,264,355.00	8.27
46	300226	上海钢联	13,763,160.72	7.98
47	601398	工商银行	13,516,267.00	7.83
48	300059	东方财富	13,323,950.40	7.72
49	300015	爱尔眼科	13,313,612.60	7.72
50	002126	银轮股份	13,084,512.15	7.58
51	600900	长江电力	13,067,866.00	7.58
52	601728	中国电信	12,380,414.00	7.18
53	002517	恺英网络	12,267,626.00	7.11
54	000977	浪潮信息	12,027,358.80	6.97
55	601689	拓普集团	11,838,120.00	6.86
56	002410	广联达	11,333,188.05	6.57
57	002371	北方华创	10,834,040.96	6.28
58	603893	瑞芯微	10,622,637.00	6.16
59	600933	爱柯迪	9,988,905.61	5.79
60	300364	中文在线	9,944,960.70	5.76

61	600276	恒瑞医药	9,783,421.80	5.67
62	002409	雅克科技	9,692,342.92	5.62
63	688668	鼎通科技	9,250,109.01	5.36
64	000333	美的集团	8,939,827.00	5.18
65	300223	北京君正	8,917,366.00	5.17
66	002028	思源电气	8,817,818.00	5.11
67	600036	招商银行	8,478,244.00	4.91
68	300570	太辰光	8,256,239.40	4.79
69	688036	传音控股	8,245,591.78	4.78
70	600373	中文传媒	7,960,336.48	4.61
71	688498	源杰科技	7,785,002.87	4.51
72	300687	赛意信息	7,262,401.00	4.21
73	000596	古井贡酒	7,220,365.00	4.19
74	002384	东山精密	7,219,628.75	4.18
75	688123	聚辰股份	7,203,260.14	4.18
76	600436	片仔癀	7,156,476.25	4.15
77	600019	宝钢股份	7,133,596.00	4.14
78	300896	爱美客	6,969,868.38	4.04
79	600050	中国联通	6,902,496.00	4.00
80	603806	福斯特	6,781,779.71	3.93
81	601012	隆基绿能	6,643,015.00	3.85
82	000988	华工科技	6,342,038.92	3.68
83	600271	航天信息	6,177,060.00	3.58
84	300408	三环集团	6,161,049.16	3.57
85	601288	农业银行	5,954,000.00	3.45
86	603728	鸣志电器	5,840,729.00	3.39
87	000681	视觉中国	5,816,928.00	3.37
88	300054	鼎龙股份	5,797,846.00	3.36
89	002027	分众传媒	5,631,212.00	3.26
90	688183	生益电子	5,609,707.10	3.25
91	002271	东方雨虹	5,559,168.78	3.22
92	601088	中国神华	5,537,862.00	3.21
93	603035	常熟汽饰	5,518,688.00	3.20
94	688008	澜起科技	5,503,852.88	3.19
95	300327	中颖电子	5,483,401.00	3.18
96	601899	紫金矿业	5,373,978.00	3.12

97	601019	山东出版	5,363,043.00	3.11
98	688099	晶晨股份	5,337,402.19	3.09
99	002185	华天科技	5,296,086.00	3.07
100	601117	中国化学	5,239,495.00	3.04
101	300274	阳光电源	5,217,429.00	3.02
102	300133	华策影视	5,167,784.00	3.00
103	002472	双环传动	5,152,334.00	2.99
104	600131	国网信通	5,143,173.00	2.98
105	300182	捷成股份	5,118,224.12	2.97
106	301195	北路智控	5,084,924.00	2.95
107	300661	圣邦股份	4,483,883.00	2.60
108	600563	法拉电子	4,408,614.00	2.56
109	000661	长春高新	4,225,766.00	2.45
110	600763	通策医疗	4,151,217.00	2.41
111	300002	神州泰岳	4,072,112.90	2.36
112	300770	新媒股份	3,956,529.00	2.29
113	601949	中国出版	3,952,282.00	2.29
114	603290	斯达半导	3,940,157.00	2.28
115	300418	昆仑万维	3,905,998.00	2.26
116	603096	新经典	3,814,842.62	2.21
117	002268	电科网安	3,813,848.00	2.21
118	601939	建设银行	3,799,510.00	2.20
119	601006	大秦铁路	3,788,640.00	2.20
120	600938	中国海油	3,784,666.00	2.19
121	601988	中国银行	3,783,797.00	2.19
122	601390	中国中铁	3,783,313.00	2.19
123	600028	中国石化	3,780,623.00	2.19
124	601857	中国石油	3,773,447.00	2.19
125	600690	海尔智家	3,739,941.33	2.17
126	002396	星网锐捷	3,684,200.00	2.14
127	600745	闻泰科技	3,639,702.90	2.11
128	600377	宁沪高速	3,610,503.00	2.09
129	603915	国茂股份	3,603,677.00	2.09
130	601985	中国核电	3,598,488.00	2.09
131	600350	山东高速	3,593,307.76	2.08
132	000651	格力电器	3,563,876.00	2.07

133	603345	安井食品	3,557,477.00	2.06
134	600406	国电南瑞	3,548,011.71	2.06
135	002304	洋河股份	3,547,400.00	2.06
136	600176	中国巨石	3,539,787.86	2.05
137	000807	云铝股份	3,534,117.00	2.05
138	603589	口子窖	3,520,834.85	2.04
139	603611	诺力股份	3,512,283.80	2.04
140	002594	比亚迪	3,499,660.00	2.03
141	002121	科陆电子	3,497,263.00	2.03
142	603606	东方电缆	3,484,644.00	2.02
143	300776	帝尔激光	3,461,694.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603019	中科曙光	65,442,087.58	37.93
2	603986	兆易创新	57,862,064.88	33.54
3	002463	沪电股份	52,440,526.66	30.40
4	002230	科大讯飞	51,151,967.20	29.65
5	300502	新易盛	43,431,166.40	25.18
6	600519	贵州茅台	42,446,645.10	24.60
7	000938	紫光股份	41,977,546.33	24.33
8	000858	五粮液	38,920,158.00	22.56
9	603501	韦尔股份	37,606,746.92	21.80
10	688041	海光信息	36,921,494.14	21.40
11	002236	大华股份	35,614,897.32	20.64
12	688111	金山办公	34,139,029.65	19.79
13	300394	天孚通信	34,135,065.00	19.79
14	000063	中兴通讯	33,545,772.00	19.45
15	600584	长电科技	33,258,369.73	19.28
16	000568	泸州老窖	32,241,964.40	18.69
17	002475	立讯精密	30,194,953.00	17.50
18	300033	同花顺	29,518,597.13	17.11
19	002555	三七互娱	29,126,226.46	16.88
20	600941	中国移动	28,643,416.60	16.60

21	002156	通富微电	27,725,340.00	16.07
22	300782	卓胜微	27,493,688.28	15.94
23	300308	中际旭创	27,354,850.41	15.86
24	600570	恒生电子	24,948,355.66	14.46
25	688981	中芯国际	22,567,010.56	13.08
26	603005	晶方科技	22,540,981.04	13.07
27	300750	宁德时代	22,403,571.58	12.99
28	002415	海康威视	22,266,877.07	12.91
29	688256	寒武纪	21,359,876.24	12.38
30	002410	广联达	21,069,707.00	12.21
31	300015	爱尔眼科	20,668,720.90	11.98
32	300347	泰格医药	20,246,335.40	11.74
33	002436	兴森科技	19,570,959.00	11.34
34	002439	启明星辰	19,221,307.12	11.14
35	300170	汉得信息	18,525,909.65	10.74
36	002624	完美世界	18,322,873.30	10.62
37	300413	芒果超媒	17,743,395.44	10.29
38	300017	网宿科技	16,678,607.00	9.67
39	688012	中微公司	16,402,507.65	9.51
40	002916	深南电路	16,015,938.00	9.28
41	600309	万华化学	15,942,960.00	9.24
42	601318	中国平安	14,571,320.00	8.45
43	002153	石基信息	13,918,915.80	8.07
44	300059	东方财富	13,690,738.48	7.94
45	603444	吉比特	13,387,212.16	7.76
46	601398	工商银行	13,283,757.00	7.70
47	300226	上海钢联	13,229,610.00	7.67
48	600900	长江电力	12,984,054.00	7.53
49	601728	中国电信	12,492,778.00	7.24
50	000977	浪潮信息	12,329,872.00	7.15
51	600036	招商银行	12,285,755.00	7.12
52	002517	恺英网络	11,510,835.26	6.67
53	002050	三花智控	11,349,050.00	6.58
54	600276	恒瑞医药	10,724,161.80	6.22
55	600933	爱柯迪	10,623,839.00	6.16
56	601012	隆基绿能	10,474,705.72	6.07
57	603893	瑞芯微	10,350,540.00	6.00
58	002384	东山精密	10,322,069.00	5.98

59	300364	中文在线	10,000,536.00	5.80
60	002409	雅克科技	9,177,227.00	5.32
61	300408	三环集团	9,126,229.62	5.29
62	601899	紫金矿业	9,061,335.00	5.25
63	300223	北京君正	8,820,068.07	5.11
64	000333	美的集团	8,771,707.48	5.08
65	002371	北方华创	8,758,862.00	5.08
66	002028	思源电气	8,707,743.00	5.05
67	600373	中文传媒	8,675,792.01	5.03
68	300570	太辰光	8,624,007.00	5.00
69	688668	鼎通科技	8,596,408.97	4.98
70	600563	法拉电子	7,530,766.00	4.37
71	688036	传音控股	7,472,326.67	4.33
72	002352	顺丰控股	7,171,572.00	4.16
73	300687	赛意信息	7,165,693.44	4.15
74	600436	片仔癀	7,128,343.00	4.13
75	600019	宝钢股份	7,038,491.58	4.08
76	300012	华测检测	7,010,421.72	4.06
77	002179	中航光电	6,920,114.26	4.01
78	603806	福斯特	6,918,703.00	4.01
79	300896	爱美客	6,904,192.30	4.00
80	600050	中国联通	6,878,197.00	3.99
81	000596	古井贡酒	6,862,813.00	3.98
82	300124	汇川技术	6,795,884.80	3.94
83	600885	宏发股份	6,663,766.00	3.86
84	688123	聚辰股份	6,648,808.95	3.85
85	000988	华工科技	6,292,206.28	3.65
86	600763	通策医疗	6,172,725.10	3.58
87	601138	工业富联	6,053,182.00	3.51
88	300054	鼎龙股份	5,964,571.00	3.46
89	600271	航天信息	5,929,596.00	3.44
90	688498	源杰科技	5,917,381.55	3.43
91	601288	农业银行	5,917,360.00	3.43
92	688008	澜起科技	5,714,233.52	3.31
93	000681	视觉中国	5,578,424.00	3.23
94	002271	东方雨虹	5,474,173.00	3.17
95	601019	山东出版	5,428,823.00	3.15
96	000661	长春高新	5,387,579.00	3.12

97	601658	邮储银行	5,305,656.00	3.08
98	300327	中颖电子	5,303,953.00	3.07
99	002185	华天科技	5,295,916.00	3.07
100	002027	分众传媒	5,276,598.00	3.06
101	002126	银轮股份	5,268,197.00	3.05
102	002472	双环传动	5,267,922.00	3.05
103	688183	生益电子	5,242,543.67	3.04
104	601088	中国神华	5,217,973.00	3.02
105	603035	常熟汽饰	5,194,274.00	3.01
106	600745	闻泰科技	5,184,164.00	3.01
107	300661	圣邦股份	5,176,606.00	3.00
108	002837	英维克	5,164,496.00	2.99
109	601166	兴业银行	5,155,437.00	2.99
110	601117	中国化学	5,137,445.00	2.98
111	300274	阳光电源	5,124,039.00	2.97
112	688099	晶晨股份	5,114,996.00	2.96
113	600131	国网信通	5,101,172.00	2.96
114	002180	纳思达	5,069,771.00	2.94
115	002335	科华数据	5,045,244.00	2.92
116	301195	北路智控	4,952,828.00	2.87
117	300133	华策影视	4,840,768.80	2.81
118	300182	捷成股份	4,673,964.00	2.71
119	601949	中国出版	4,165,517.00	2.41
120	601857	中国石油	3,860,136.00	2.24
121	300418	昆仑万维	3,708,271.00	2.15
122	300002	神州泰岳	3,693,486.73	2.14
123	300770	新媒股份	3,688,731.00	2.14
124	603915	国茂股份	3,640,283.00	2.11
125	002268	电科网安	3,637,628.40	2.11
126	603096	新经典	3,629,036.00	2.10
127	600938	中国海油	3,616,400.00	2.10
128	601988	中国银行	3,616,245.00	2.10
129	300776	帝尔激光	3,608,667.60	2.09
130	601006	大秦铁路	3,607,111.00	2.09
131	002396	星网锐捷	3,598,805.00	2.09
132	002960	青鸟消防	3,586,950.58	2.08
133	002304	洋河股份	3,583,861.00	2.08
134	600406	国电南瑞	3,531,058.00	2.05

135	601939	建设银行	3,512,554.00	2.04
136	000651	格力电器	3,506,889.00	2.03
137	603589	口子窖	3,477,386.00	2.02
138	002594	比亚迪	3,462,410.00	2.01
139	601985	中国核电	3,454,136.00	2.00
140	000807	云铝股份	3,454,049.00	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,977,117,423.53
卖出股票收入（成交）总额	1,977,427,514.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	1,832,362.03	0.92
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,832,362.03	0.92

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019679	22 国债 14	18,000	1,832,362.03	0.92

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	685,505.86
2	应收清算款	2,031,258.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59,460.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,776,225.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东吴行业轮动混合 A	17,145	13,752.53	13,528,432.65	5.74%	222,258,680.73	94.26%
东吴行业轮动混合 C	613	5,043.27	5,808.55	0.19%	3,085,715.56	99.81%
合计	17,758	13,451.89	13,534,241.20	5.67%	225,344,396.29	94.33%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴行业轮动混合 A	172,776.56	0.0733%
	东吴行业轮动混合 C	-	-
	合计	172,776.56	0.0723%

注：持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	东吴行业轮动混合 A	-
	东吴行业轮动混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴行业轮动混合 A	10~50
	东吴行业轮动混合 C	-
	合计	10~50

§ 9 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	232,938,722.85	427,684.62
本报告期基金总申购份额	18,822,116.83	6,771,633.97
减：本报告期基金总赎回份额	15,973,726.30	4,107,794.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	235,787,113.38	3,091,524.11

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

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

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

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍刚先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	1	1,262,477,808.04	31.95%	1,163,121.88	31.80%	-
东吴证券	2	1,047,464,597.24	26.51%	972,928.76	26.60%	-
安信证券	1	757,303,939.60	19.17%	705,277.98	19.28%	-
国泰君安	1	367,366,542.59	9.30%	338,455.60	9.25%	-
国盛证券	2	261,463,769.60	6.62%	241,510.40	6.60%	-
华福证券	2	173,299,534.01	4.39%	160,740.91	4.39%	-
国信证券	1	81,865,172.08	2.07%	75,422.21	2.06%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期交易单元无变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,884,159.08	100.00%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2022 年年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2023 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司旗下基金 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
3	东吴行业轮动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
4	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
5	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
6	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
7	东吴基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2023 年 3 月 8 日

	经营证券期货业务许可证（副本）遗失公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
8	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 3 月 31 日
9	东吴行业轮动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
10	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
11	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
12	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
13	东吴行业轮动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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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、	2023 年 6 月 28 日

		中证信息网站	
19	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准东吴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。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日