东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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 2020 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 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11

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 12

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13

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 13

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14

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 14

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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15

6.2 利润表 16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17

6.4 报表附注.....18
§7 投资组合报告.....38
7.1 期末基金资产组合情况.....38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....38
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.....39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....43
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.....43
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.....44
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.....44
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.....44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....44
7.12 投资组合报告附注.....44
§8 基金份额持有人信息.....46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....46
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.....46
§9 开放式基金份额变动.....47
§10 重大事件揭示.....48
10.1 基金份额持有人大会决议.....48
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.....48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....48
10.4 基金投资策略的改变.....48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....48
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.....48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....48
10.8 其他重大事件.....50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....54
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.....54

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 54
§12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金
基金简称	东吴嘉禾优势精选混合
基金主代码	580001
交易代码	580001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 2 月 1 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	510,499,781.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济成长，以中低风险水平获得中长期较高收益。
投资策略	在资产配置上，本基金根据各类别资产风险收益水平及本基金风险收益目标，确定大类资产配置比例。在平衡风险收益基础上，把握优势成长，追求中长期较高收益。在股票选择上，本基金根据个股在行业、企业、价格三方面比较优势的分析，精选出具有行业、企业、价格三重比较优势及具有企业、价格两重比较优势的个股作为投资对象。在股票具体操作策略上，将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在中长时间段上进行周期持有，同时根据指数及个股运行的时空和量价效应进行中短时间段上的波段操作。
业绩比较基准	65%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*中证全债指数。
风险收益特征	本基金定位于中低风险水平，力求通过选股方法、投资策略等，谋求中长期较高收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	郭明
	联系电话	021-50509888-8308	010-66105799
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95588
传真		021-50509888-8211	010-66105798
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号	北京市西城区复兴门内大街 55

	瑞明大厦 9 楼	号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	邓晖	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	79,587,193.06
本期利润	127,060,474.05
加权平均基金份额本期利润	0.2320
本期加权平均净值利润率	24.99%
本期基金份额净值增长率	28.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	27,881,060.37
期末可供分配基金份额利润	0.0546
期末基金资产净值	538,380,841.37
期末基金份额净值	1.0546
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	323.38%

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

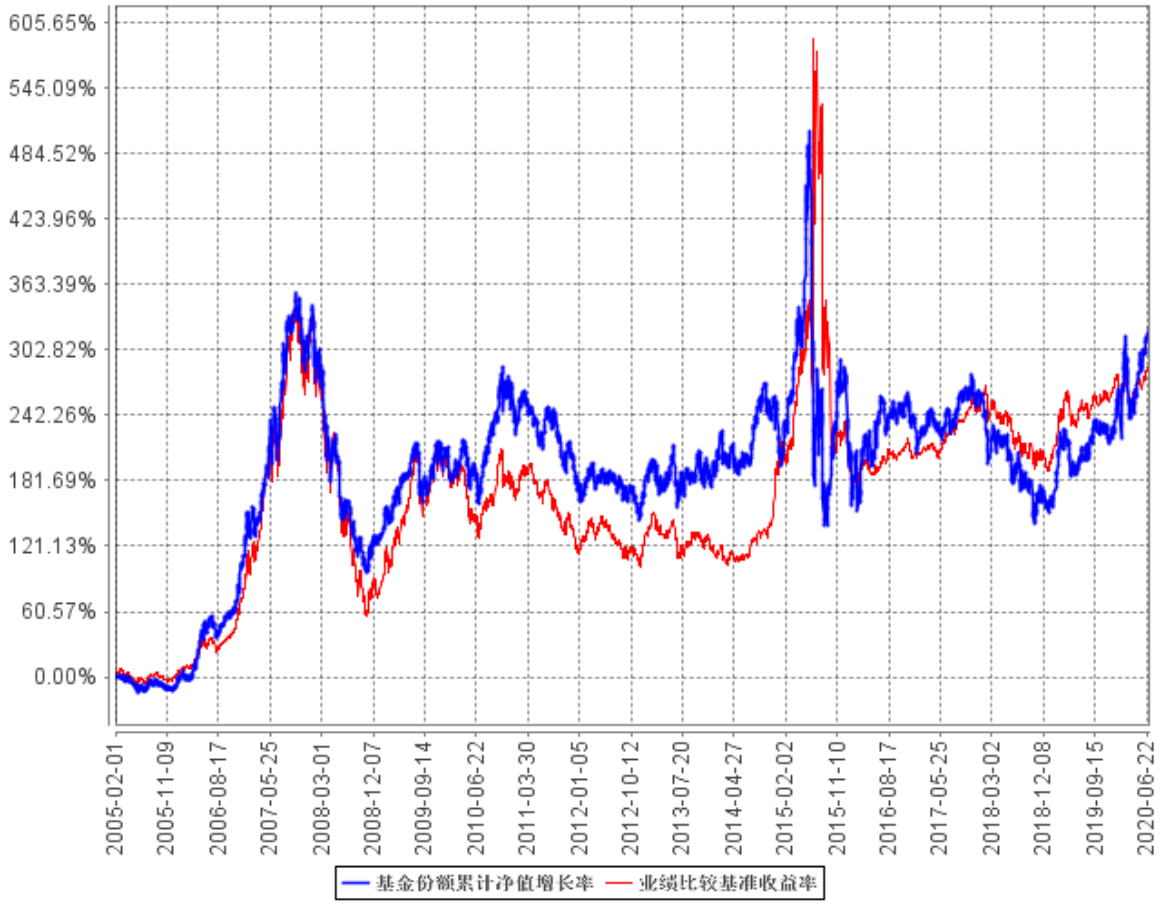
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.92%	1.08%	5.25%	0.57%	3.67%	0.51%
过去三个月	24.22%	1.25%	9.41%	0.60%	14.81%	0.65%
过去六个月	28.37%	2.01%	3.93%	0.99%	24.44%	1.02%
过去一年	41.42%	1.57%	11.44%	0.80%	29.98%	0.77%
过去三年	22.36%	1.44%	19.13%	0.83%	3.23%	0.61%
自基金合同生效起至今	323.38%	1.68%	289.12%	1.12%	34.26%	0.56%

注：比较基准=65%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*中证全债指数。

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

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.东吴嘉禾基金于 2005 年 2 月 1 日成立。

2.比较基准=65%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*中证全债指数。

§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 9 楼。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，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 2020 年 6 月末，公司旗下管理着 29 只公募产品，资产管理总规模 437 亿元（包括专户、专项资产管理规模），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。自 2015 年以来，公司在成长股投资的传统优势基础上，进一步引入了量化投资策略，谋求穿越牛熊的长期业绩回报。

经过多年积累和布局，公司的公募业务已形成三大投研“特色”：权益投资坚持自下而上精选优质成长股，把握中国经济转型升级机遇；绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念，借助量化模型进行择时和选股；固定收益以稳健为本，兼顾流动性与收益率，为大类资产配置提供基础性工具。

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		
彭敢	深圳业务总部总经理、基金经理	2017 年 7 月 14 日	-	18 年	彭敢，硕士研究生。曾任大鹏证券研究所研究员、银华基金有限公司投资部研究员、银华基金管理有限公司投资管理部研究员、万联证券有限责任公司研发中心首席分析师、财富证券有限责任公司证券投资部投资经理、宝盈基金管理有限公司基金经理等职，2017 年 2 月 28 日加入我司，现任深圳业务总部总经理、基金经理，

					自 2017 年 7 月 14 日起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，自 2017 年 12 月 5 日起担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
胡启聪	基金经理	2019 年 6 月 21 日	-	5.5 年	胡启聪，2012 年 11 月毕业于香港科技大学，获硕士学位。2012 年 08 月至 2014 年 06 月就职于国信证券深圳红岭分公司，从事机构相关业务；2014 年 06 月至 2014 年 09 月实业企业学习深造；2014 年 09 月至 2016 年 12 月就职于宝盈基金管理有限公司，任投资部投资秘书。2016 年 12 月至今就职于东吴基金管理有限公司，从事投资研究工作，现任基金经理，其中，自 2019 年 6 月 21 日起任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期和离职日期均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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，无损害基金持有人利益的行为。

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

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，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；2、公司研究策划部的研究工作实行

信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，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。

4.3.2 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。

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

2020 年二季度，市场整体走出了向上的趋势，主要指数均录得正收益，其中上证指数上涨 8.52%，沪深 300 上涨 12.96%，创业板指上涨 30.25%，东吴嘉禾基金净值二季度内录得 24.22%正收益。表现弱于创业板指数的原因，主要在于我们二季度减配了医药行业的相关标的，短期我们认为医药行业已经充分反应疫情刺激的利好，部分受益公司股价开始泡沫化，因此我们整体性降低了医药板块仓位。同时，基于下半年业绩复苏和确定性考虑，加配了部分计算机、新能源车行业的标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0546 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.37%，业绩比较基准收益率为 3.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 7 月份以来，指数走出了一波飙升行情，但管理人认为这种情况不会持久，但核心优质资产持续走出结构性的行情仍然是未来的主线。在组合配置上，我们坚持科技成长和新兴消费两大主要方向，同时看好周期性行业中，具有成长属性、且中期有业绩、中长期成长逻辑和空间大的标的。

一方面，我国坚持科技创新、升级的经济发展战略不会改变，在国内外形势影响下，我们正在加快形成以国内大循环为主体、国内国际双循环互相促进的经济发展格局，进一步发挥超大规模的内需市场来驱动“自主可控”的科技周期发展。因此，在国内互联网、计算机、半导体、电动车、5G 等行业新技术新产品的应用、国产自主研发的核心技术与设备都会是未来科技发展的主线，同时，满足人们提高生活品质和精神需求的新消费方式和产品也会是未来经济发展的一大看点。

另一方面，国内生产生活逐步恢复，周期品中大宗商品的价格和 PMI 在回升，这表明实体经济主动补库存的开始，下半年工业企业利润有望企稳，先进制造业的业绩弹性将得到体现。因此，我们也看好周期行业中估值有相对优势、业绩确定性强且具有成长属性的优质标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营副总经理、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、固定收益部、专户投资部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

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

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

报告截止日： 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	35,245,959.51	3,764,358.31
结算备付金		888,389.95	1,191,737.23
存出保证金		177,652.35	199,593.67
交易性金融资产	6.4.7.2	498,492,234.61	460,243,454.68
其中：股票投资		498,492,234.61	435,228,454.68
基金投资		-	-
债券投资		-	25,015,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,958,267.52	6,160,645.18
应收利息	6.4.7.5	3,543.85	553,823.30
应收股利		-	-
应收申购款		106,174.36	7,930.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		542,872,222.15	472,121,542.93
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,899,248.53	956,072.72
应付管理人报酬		650,303.60	594,580.06
应付托管费		108,383.92	99,096.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	605,934.24	753,501.41
应交税费		-	0.12

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,510.49	195,204.33
负债合计		4,491,380.78	2,598,455.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	510,499,781.00	571,538,504.34
未分配利润	6.4.7.10	27,881,060.37	-102,015,416.73
所有者权益合计		538,380,841.37	469,523,087.61
负债和所有者权益总计		542,872,222.15	472,121,542.93

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0546 元，基金份额总额 510,499,781.00 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		134,317,983.32	74,408,666.29
1.利息收入		149,331.92	518,843.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	124,014.69	268,976.90
债券利息收入		25,317.23	231,155.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	18,711.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		86,663,131.53	38,688,921.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	84,941,483.76	36,526,830.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	64,712.24	175,431.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,656,935.53	1,986,659.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	47,473,280.99	35,178,797.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	32,238.88	22,103.16
减：二、费用		7,257,509.27	11,311,004.41
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,787,409.73	3,545,987.17
2．托管费	6.4.10.2.2	631,234.94	590,997.83

3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.18	2,713,916.33	7,063,481.45
5．利息支出		504.49	-
其中：卖出回购金融资产支出		504.49	-
6．税金及附加		-	73.61
7．其他费用	6.4.7.19	124,443.78	110,464.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		127,060,474.05	63,097,661.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		127,060,474.05	63,097,661.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	571,538,504.34	-102,015,416.73	469,523,087.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	127,060,474.05	127,060,474.05
三、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）	-61,038,723.34	2,836,003.05	-58,202,720.29
其中：1.基金申购款	28,343,343.96	-2,426,128.91	25,917,215.05
2.基金赎回款	-89,382,067.30	5,262,131.96	-84,119,935.34
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	510,499,781.00	27,881,060.37	538,380,841.37
项目	**上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日**		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	641,689,369.80	-228,381,955.30	413,307,414.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,097,661.88	63,097,661.88
三、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）	32,272,857.19	-6,136,843.14	26,136,014.05
其中：1.基金申购款	75,589,794.36	-16,374,564.84	59,215,229.52
2.基金赎回款	-43,316,937.17	10,237,721.70	-33,079,215.47
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	673,962,226.99	-171,421,136.56	502,541,090.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓晖　　徐明　　吴婷

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金（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”）证监基金字[2004]201 号文《关于同意东吴嘉禾优势精选混合型开放式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 2005 年 2 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 1,029,352,840.95 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人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资范围为法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金整体业绩比较基准=65%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

3.城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

5.个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	35,245,959.51
定期存款	-
其他存款	-

合计：	35,245,959.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		440,553,899.33	498,492,234.61	57,938,335.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		440,553,899.33	498,492,234.61	57,938,335.28

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,112.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	359.82
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	71.91
合计	3,543.85

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	605,934.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	605,934.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,542.71
应付证券出借违约金	-
预提费用	-
应付审计费	37,295.44
应付信息披露费	179,672.34
预提银行间账户维护费	9,000.00
合计	227,510.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	571,538,504.34	571,538,504.34
本期申购	28,343,343.96	28,343,343.96
本期赎回(以"-"号填列)	-89,382,067.30	-89,382,067.30
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	510,499,781.00	510,499,781.00

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,228,592.89	-117,244,009.62	-102,015,416.73
本期利润	79,587,193.06	47,473,280.99	127,060,474.05
本期基金份额交易产生的变动数	-7,315,310.23	10,151,313.28	2,836,003.05
其中：基金申购款	2,177,278.70	-4,603,407.61	-2,426,128.91
基金赎回款	-9,492,588.93	14,754,720.89	5,262,131.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,500,475.72	-59,619,415.35	27,881,060.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	111,116.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,407.55
其他	1,491.12
合计	124,014.69

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	919,827,296.23
减：卖出股票成本总额	834,885,812.47
买卖股票差价收入	84,941,483.76

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,588,714.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,946,500.00
减：应收利息总额	577,502.16
买卖债券差价收入	64,712.24

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未进行权证投资交易。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他投资交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,656,935.53
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	1,656,935.53

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	47,473,280.99
——股票投资	47,549,780.99
——债券投资	-76,500.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估	-

增值税	
合计	47,473,280.99

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	31,910.42
转换费收入	328.46
合计	32,238.88

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,713,916.33
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	2,713,916.33

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	37,295.44
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划费	476.00
账户维护费	27,000.00
其他费用	-
数字证书服务费	-
合计	124,443.78

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
中国工商银行股份有限公司	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	-	-	1,082,768,436.51	23.00%

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 2020年1月1日至2020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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	996,987.99	23.28%	6,273.62	0.49%

注：股票交易佣金为成交金额的 1‰扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,787,409.73	3,545,987.17
其中：支付销售机构的客户维护费	914,651.72	844,511.83

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×1.50%÷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本给基金管理人。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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	631,234.94	590,997.83

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×0.25%÷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

本基金不收取销售服务费。

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	35,245,959.51	111,116.02	29,293,311.59	229,634.99

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（ 2020 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	可流通日	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
688520	神州细胞	2020 年 6 月 11 日	2020 年 12 月 22 日	新股限售	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-
688157	松井股份	2020 年 5 月 29 日	2020 年 12 月 9 日	新股限售	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-
688516	奥特维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	新股限售	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪	2020 年	2021	新股	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

	科技	6 月 23 日	年 1 月 3 日	未上市						
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
601816	京沪高铁	2020 年 1 月 8 日	2020 年 7 月 16 日	新股限售	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688298	东方生物	2020 年 1 月 20 日	2020 年 8 月 5 日	新股限售	21.25	144.17	5,286	112,327.50	762,082.62	-
688085	三友医疗	2020 年 3 月 30 日	2020 年 10 月 9 日	新股限售	20.96	67.62	8,807	184,594.72	595,529.34	-
688566	吉贝尔	2020 年 5 月 8 日	2020 年 11 月 18 日	新股限售	23.69	38.43	9,882	234,104.58	379,765.26	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

基金本报告期末未持有因暂时性停牌而流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 2020 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 2020 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，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现以中低风险水平获得中长期较高收益的风险收益目标。

本基金投资目标为通过个股精选、科学的操作策略及严密的风险控制等手段来降低投资风险，力争将本基金的风险水平控制在比较基准的一定幅度范围内；同时，本基金通过对中国经济成长规律的准确把握和对具有价值成长比较优势股票的前瞻性投资来分享中国经济成长，获得中长期较高收益。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。

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。

本基金基金合同约定投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	25,015,000.00
合计	-	25,015,000.00

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，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。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	35,245,959.51	-	-	-	-	-	35,245,959.51

结算备付金	888,389.95	-	-	-	-	-	888,389.95
存出保证金	177,652.35	-	-	-	-	-	177,652.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	498,492,234.61	498,492,234.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,958,267.52	7,958,267.52
应收利息	-	-	-	-	-	3,543.85	3,543.85
应收申购款	-	-	-	-	-	106,174.36	106,174.36
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	36,312,001.81	-	-	-	-	506,560,220.34	542,872,222.15
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,899,248.53	2,899,248.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	650,303.60	650,303.60
应付托管费	-	-	-	-	-	108,383.92	108,383.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	605,934.24	605,934.24
其他负债	-	-	-	-	-	227,510.49	227,510.49
负债总计	-	-	-	-	-	4,491,380.78	4,491,380.78
利率敏感度缺口	36,312,001.81	-	-	-	-	502,068,839.56	538,380,841.37
上年度末 2019 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	3,764,358.31	-	-	-	-	-	3,764,358.31
结算备付金	1,191,737.23	-	-	-	-	-	1,191,737.23
存出保证金	199,593.67	-	-	-	-	-	199,593.67
交易性金融资产	25,015,000.00	-	-	-	-	435,228,454.68	460,243,454.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,160,645.18	6,160,645.18
应收利息	-	-	-	-	-	553,823.30	553,823.30
应收申购款	-	-	-	-	-	7,930.56	7,930.56
资产总计	30,170,689.21	-	-	-	-	441,950,853.72	472,121,542.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	956,072.72	956,072.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	594,580.06	594,580.06
应付托管费	-	-	-	-	-	99,096.68	99,096.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	753,501.41	753,501.41
应交税费	-	-	-	-	-	0.12	0.12
其他负债	-	-	-	-	-	195,204.33	195,204.33
负债总计	-	-	-	-	-	2,598,455.32	2,598,455.32
利率敏感度缺口	30,170,689.21	-	-	-	-	439,352,398.40	469,523,087.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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（ 2020 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	基准利率减少 25 个基点	-	2,891.33
	基准利率增加 25 个基点	-	-2,883.84

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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	498,492,234.61	92.59	435,228,454.68	92.70
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	498,492,234.61	92.59	435,228,454.68	92.70

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-95%，投资债券资产不高于基金资产的 60%，现金类资产最低比例为 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；基金股票资产的 80%以上投资于三重比较优势选股模型选出的股票；本基金投资于其他工具的比例依照

法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩基准下跌 1%	-9,313,988.56	-5,962,943.21
	2.业绩基准下跌 5%	-46,569,942.78	-29,814,716.06
	3.业绩基准下跌 10%	-93,139,885.56	-59,629,432.13

6.4.14 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	498,492,234.61	91.82
	其中：股票	498,492,234.61	91.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,134,349.46	6.66
8	其他各项资产	8,245,638.08	1.52
9	合计	542,872,222.15	100.00

7.2 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	7,063,898.00	1.31
B	采矿业	3,910,000.00	0.73
C	制造业	284,560,337.68	52.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,163,236.82	2.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	22,116,776.00	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,327.12	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,463,401.90	21.63
J	金融业	5,335,021.49	0.99
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	26,297,333.60	4.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,988,902.00	2.97
S	综合	-	-
	合计	498,492,234.61	92.59

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	300001	特锐德	2,255,500	47,230,170.00	8.77
2	002405	四维图新	2,153,540	35,511,874.60	6.60
3	002549	凯美特气	3,380,120	26,297,333.60	4.88
4	300792	壹网壹创	142,163	24,759,108.08	4.60
5	300624	万兴科技	293,600	23,634,800.00	4.39
6	300755	华致酒行	651,740	21,116,376.00	3.92
7	603043	广州酒家	625,000	20,325,000.00	3.78
8	688023	安恒信息	59,203	18,228,603.70	3.39
9	002653	海思科	631,200	16,796,232.00	3.12
10	300252	金信诺	1,738,669	16,639,062.33	3.09
11	600567	山鹰纸业	5,500,000	16,225,000.00	3.01
12	300413	芒果超媒	245,200	15,987,040.00	2.97
13	688299	长阳科技	540,426	15,504,821.94	2.88
14	002291	星期六	620,000	14,322,000.00	2.66
15	300078	思创医惠	999,997	13,529,959.41	2.51
16	688598	金博股份	134,645	12,434,465.75	2.31
17	601139	深圳燃气	1,715,457	11,150,470.50	2.07
18	300142	沃森生物	210,000	10,995,600.00	2.04
19	002594	比亚迪	151,000	10,841,800.00	2.01
20	300454	深信服	50,000	10,298,000.00	1.91
21	688036	传音控股	139,667	9,916,357.00	1.84
22	000157	中联重科	1,518,560	9,764,340.80	1.81
23	603659	璞泰来	90,000	9,271,800.00	1.72
24	600201	生物股份	310,000	8,630,400.00	1.60
25	688116	天奈科技	177,158	8,282,136.50	1.54
26	600332	白云山	250,000	8,082,500.00	1.50
27	603983	丸美股份	90,000	7,742,700.00	1.44
28	000584	哈工智能	1,250,000	6,912,500.00	1.28

29	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	1.04
30	601128	常熟银行	692,899	5,203,671.49	0.97
31	603605	珀莱雅	26,000	4,680,520.00	0.87
32	300498	温氏股份	201,000	4,381,800.00	0.81
33	600273	嘉化能源	500,530	4,374,632.20	0.81
34	600028	中国石化	1,000,000	3,910,000.00	0.73
35	300088	长信科技	300,266	3,362,979.20	0.62
36	002368	太极股份	70,000	3,058,300.00	0.57
37	600975	新五丰	290,900	2,682,098.00	0.50
38	600118	中国卫星	61,800	1,905,294.00	0.35
39	002518	科士达	139,806	1,733,594.40	0.32
40	603883	老百姓	10,000	1,000,400.00	0.19
41	000938	紫光股份	20,000	859,600.00	0.16
42	688298	东方生物	5,286	762,082.62	0.14
43	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.13
44	688085	三友医疗	8,807	595,529.34	0.11
45	300253	卫宁健康	20,000	458,800.00	0.09
46	688566	吉贝尔	9,882	379,765.26	0.07
47	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.05
48	688039	当虹科技	2,805	261,958.95	0.05
49	300750	宁德时代	1,500	261,540.00	0.05
50	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.04
51	600161	天坛生物	5,128	232,452.24	0.04
52	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.03
53	002142	宁波银行	5,000	131,350.00	0.02
54	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
55	688363	华熙生物	800	118,320.00	0.02
56	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
57	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
58	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
59	300122	智飞生物	600	60,090.00	0.01
60	002773	康弘药业	600	29,760.00	0.01
61	300037	新宙邦	500	27,530.00	0.01
62	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
63	000800	一汽解放	2,000	21,480.00	0.00
64	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
65	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
66	300699	光威复材	200	12,546.00	0.00
67	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00

68	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
69	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
70	300655	晶瑞股份	200	8,230.00	0.00
71	002023	海特高新	500	7,685.00	0.00
72	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
73	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
74	300451	创业慧康	300	5,547.00	0.00
75	002675	东诚药业	200	4,190.00	0.00
76	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
77	000681	视觉中国	100	1,862.00	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	300792	壹网壹创	35,376,691.92	7.53
2	300755	华致酒行	34,613,579.80	7.37
3	603043	广州酒家	29,998,212.00	6.39
4	300001	特锐德	28,385,943.00	6.05
5	300252	金信诺	27,069,629.72	5.77
6	688036	传音控股	27,049,208.14	5.76
7	300624	万兴科技	23,345,750.60	4.97
8	688116	天奈科技	21,380,533.74	4.55
9	688023	安恒信息	20,812,199.63	4.43
10	601128	常熟银行	20,682,853.80	4.41
11	002368	太极股份	20,291,130.00	4.32
12	600567	山鹰纸业	19,988,700.00	4.26
13	002653	海思科	19,916,166.80	4.24
14	300498	温氏股份	18,757,216.00	3.99
15	688299	长阳科技	18,491,105.00	3.94
16	603659	璞泰来	17,719,642.00	3.77
17	002405	四维图新	16,577,402.35	3.53
18	002518	科士达	15,952,835.40	3.40
19	600118	中国卫星	15,296,154.40	3.26
20	002291	星期六	15,199,645.91	3.24
21	300142	沃森生物	14,823,038.00	3.16

22	300413	芒果超媒	14,294,508.75	3.04
23	000651	格力电器	14,050,426.00	2.99
24	000584	哈工智能	14,020,677.64	2.99
25	000800	一汽解放	13,607,027.00	2.90
26	600837	海通证券	13,309,800.00	2.83
27	600332	白云山	12,471,193.00	2.66
28	300088	长信科技	12,242,694.06	2.61
29	601139	深圳燃气	12,227,749.98	2.60
30	300078	思创医惠	11,921,988.57	2.54
31	002212	南洋股份	11,876,685.00	2.53
32	300454	深信服	11,800,524.00	2.51
33	000100	TCL 科技	11,779,000.00	2.51
34	688598	金博股份	11,351,624.38	2.42
35	000157	中联重科	11,198,947.60	2.39
36	002142	宁波银行	10,887,549.10	2.32
37	000681	视觉中国	9,735,665.00	2.07
38	002594	比亚迪	9,589,738.00	2.04

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300624	万兴科技	49,795,263.05	10.61
2	603043	广州酒家	37,535,233.00	7.99
3	300454	深信服	31,046,859.00	6.61
4	002675	东诚药业	30,375,223.30	6.47
5	603983	丸美股份	28,545,482.89	6.08
6	002405	四维图新	27,619,217.64	5.88
7	600975	新五丰	27,363,241.92	5.83
8	601128	常熟银行	26,667,251.91	5.68
9	300755	华致酒行	25,647,418.15	5.46
10	000938	紫光股份	24,191,292.02	5.15
11	300252	金信诺	22,001,722.78	4.69
12	300037	新宙邦	20,440,624.00	4.35
13	300792	壹网壹创	19,438,063.00	4.14

14	300078	思创医惠	19,003,135.48	4.05
15	002368	太极股份	18,783,461.00	4.00
16	300618	寒锐钴业	18,720,245.80	3.99
17	002518	科士达	17,660,461.92	3.76
18	688116	天奈科技	16,347,086.99	3.48
19	002212	南洋股份	15,006,503.00	3.20
20	688036	传音控股	14,729,206.44	3.14
21	002653	海思科	14,469,339.06	3.08
22	000584	哈工智能	14,214,846.35	3.03
23	000800	一汽解放	14,044,281.00	2.99
24	600118	中国卫星	13,248,595.00	2.82
25	000651	格力电器	13,222,157.46	2.82
26	000977	浪潮信息	13,149,864.91	2.80
27	300498	温氏股份	12,118,132.00	2.58
28	600201	生物股份	12,017,759.00	2.56
29	603605	珀莱雅	11,438,348.10	2.44
30	300699	光威复材	11,426,968.80	2.43
31	002142	宁波银行	11,268,713.12	2.40
32	000681	视觉中国	11,044,391.00	2.35
33	600837	海通证券	10,412,491.46	2.22
34	603127	昭衍新药	10,292,660.00	2.19
35	300142	沃森生物	10,013,482.07	2.13
36	300088	长信科技	9,922,021.00	2.11
37	603659	璞泰来	9,746,952.00	2.08
38	000100	TCL 科技	9,745,000.00	2.08

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	850,599,811.41
卖出股票收入（成交）总额	919,827,296.23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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	177,652.35
2	应收证券清算款	7,958,267.52
3	应收股利	-
4	应收利息	3,543.85

5	应收申购款	106,174.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,245,638.08

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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
37,618	13,570.63	12,560,503.94	2.46%	497,939,277.06	97.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2005 年 2 月 1 日 ）基金份额总额	1,029,352,840.95
本报告期期初基金份额总额	571,538,504.34
本报告期基金总申购份额	28,343,343.96
减:本报告期基金总赎回份额	89,382,067.30
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	510,499,781.00

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

2020 年 6 月 18 日经东吴基金管理有限公司第三届董事会 2020 年第 1 次临时会议审议通过，聘任陈军同志为东吴基金管理有限公司常务副总经理，2020 年 6 月 24 日完成相关手续后，正式履职。

2020 年 4 月 16 日经东吴基金管理有限公司第三届董事会第六次会议审议通过，聘任刘婷婷同志为东吴基金管理有限公司督察长，2020 年 8 月 20 日完成相关手续后，正式履职。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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）上海分所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。本报告期内，公司已全面落实了整改要求，完成了相关整改工作。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	485,931,272.65	27.69%	452,545.80	28.32%	-
天风证券	1	387,306,402.46	22.07%	352,951.32	22.09%	-
东方财富	1	259,857,755.85	14.81%	236,807.74	14.82%	-
长江证券	1	196,870,173.92	11.22%	179,407.79	11.23%	-

兴业证券	1	125,188,514.57	7.13%	114,084.55	7.14%	-
国金证券	1	112,584,983.61	6.42%	104,849.17	6.56%	-
国泰君安	1	79,863,661.03	4.55%	74,376.25	4.66%	-
华宝证券	2	74,613,800.94	4.25%	53,073.08	3.32%	-
国盛证券	1	32,541,731.65	1.85%	29,655.36	1.86%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期减少 6 个交易单元，分别为中信证券，中山证券，江海证券。新增 3 个交易单元，为华宝证券，信达证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	11,214.40	100.00%	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2019 年年度资产净值公告	公司网站、中证信息网站	2020 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行股份有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	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	2020 年 1 月 2 日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加部分代销机构费率优惠的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 1 月 4 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国农业银行股份有限公司申购及定投费率优	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2020 年 1 月 7 日

	惠的公告	中证信息网站	
5	东吴基金管理有限公司旗下全部基金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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 1 月 18 日
6	东吴基金管理有限公司关于延迟开市的温馨提示	公司网站、中证信息网站	2020 年 1 月 31 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加华夏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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 2 月 14 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在北京唐鼎耀华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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 3 月 13 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 3 月 18 日
10	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2019 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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 3 月 26 日
11	东吴基金管理有限公司关于参加中信建投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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 4 月 14 日
12	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 4 月 22 日
13	东吴基金管理有限公司关于参加中信证券华南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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 4 月 28 日
14	东吴基金管理有限公司关于参加	中国证券报、上海证	2020 年 5 月 9 日

	华安证券股份有限公司费率优惠的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	
15	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 5 月 18 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 5 月 21 日
17	东吴基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 5 月 27 日
18	东吴基金管理有限公司关于参加北京汇成基金销售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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 6 月 3 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增泛华普益基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 6 月 5 日
20	东吴基金管理有限公司关于参加泛华普益基金销售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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 6 月 5 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 6 月 10 日
22	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 6 月 23 日

23	东吴基金管理有限公司关于聘任常务副总经理的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 6 月 24 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嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金设立的文件；

2、《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金合同》；

3、《东吴嘉禾优势精选混合型开放式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、报告期内东吴嘉禾优势精选混合型开放式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

2020 年 8 月 28 日