东吴新产业精选股票型证券投资基金
（原东吴新产业精选混合型证券投资基金）
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 12 月 29 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。（注：东吴新产业精选混合型证券投资基金报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 28 日止）。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东吴新产业精选股票
基金主代码	580008
交易代码	580008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 29 日
报告期末基金份额总额	121,032,913.70 份
投资目标	本基金为股票型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态调整股票、债券、现金等大类资产的配置。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

转型前：

基金简称	东吴新产业精选混合
基金主代码	580008
交易代码	580008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 28 日
报告期末基金份额总额	121,192,577.92 份
投资目标	本基金为混合型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享新兴产业所带来的投资机会，追求超越市场的收益。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。
业绩比较基准	75%*中证新兴产业指数+25%*中国债券综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：上表中“报告期末”为 2020 年 12 月 28 日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2020 年 12 月 29 日 － 2020 年 12 月 31 日 ）
1.本期已实现收益	1,429,185.87
2.本期利润	4,498,353.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0371
4.期末基金资产净值	417,314,961.45
5.期末基金份额净值	3.4479

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020 年 10 月 1 日 － 2020 年 12 月 28 日)
1.本期已实现收益	21,914,868.15
2.本期利润	61,285,000.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.5065
4.期末基金资产净值	413,361,148.79
5.期末基金份额净值	3.4108

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、所列数据截止到 2020 年 12 月 28 日。

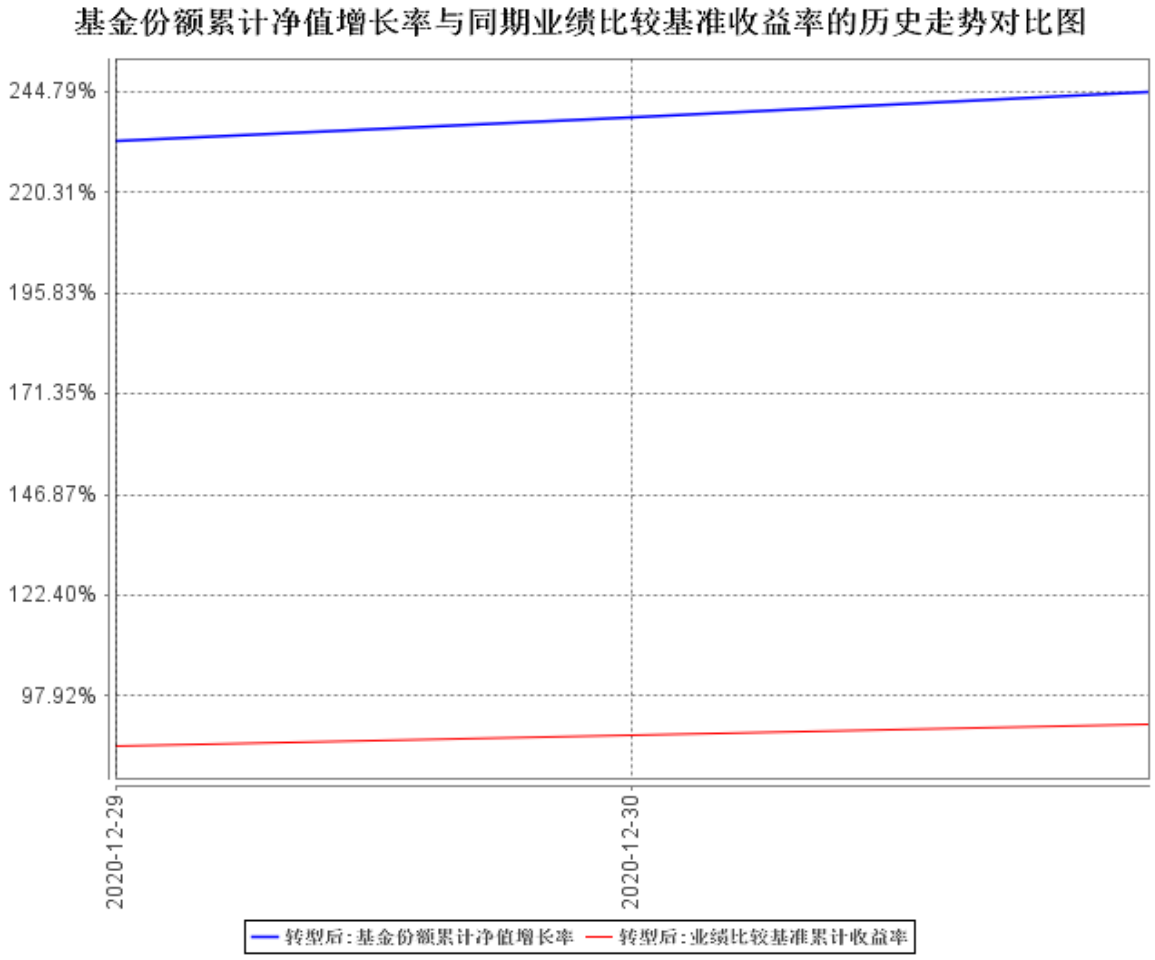
3.2 基金净值表现（转型后）

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	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	1.09%	2.43%	2.80%	0.83%	-1.71%	1.60%

注：比较基准=中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1. 比较基准=中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%。

2. 东吴新产业精选股票型证券投资基金由东吴新产业精选混合型证券投资基金变更而来，变更日期为 2020 年 12 月 29 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末仍处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	17.41%	1.20%	8.85%	0.95%	8.56%	0.25%
过去六个月	40.37%	1.49%	15.87%	1.20%	24.50%	0.29%
过去一年	63.51%	1.53%	31.47%	1.31%	32.04%	0.22%
过去三年	93.91%	1.40%	24.29%	1.17%	69.62%	0.23%

过去五年	36.21%	1.52%	13.68%	1.12%	22.53%	0.40%
自基金合同生效起至今	241.08%	1.77%	85.71%	1.26%	155.37%	0.51%

注：1.比较基准=75%*中证新兴产业指数+25%*中国债券综合全价指数。

2.过去三个月：2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 28 日，过去六个月：2020 年 7 月 1 日至 2020 年 12 月 28 日，过去一年：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 28 日，过去三年：2018 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 28 日，过去五年：2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 28 日，自基金合同生效起至今：2011 年 9 月 28 日至 2020 年 12 月 28 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注：1.比较基准=75%*中证新兴产业指数+25%*中国债券综合全价指数。

2.本基金转型日为 2020 年 12 月 29 日，图示日期为 2011 年 9 月 28 日至 2020 年 12 月 28 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘瑞	基金经理	2018 年 3 月 8 日	-	7 年	刘瑞先生，中国国籍，美国哥伦比亚大学计算机科学与技术硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职国泰君安期货投资经理助理；上海陆宝投资管理有限公司投资经理；嘉实基金管理有限公司策略研究员。 2018 年 1 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2018 年 11 月 20 日至 2020 年 12 月 16 日担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 11 月 20 日至 2020 年 12 月 16 日担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 3 月 8 日至今担任东吴新产业精选股票型证券投资基金(原东吴新产业精选混合型证券投资基金)基金经理，2019 年 4 月 29 日至今担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

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。

4.1.1 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（转型前）

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘瑞	基金经理	2020 年 12 月 29 日	-	7 年	刘瑞先生，中国国籍，美国哥伦比亚大学计算机科学与技术硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职国泰君安期货投资经理助理；上海陆宝投资管理有限公司投资经理；嘉实基金管理有限公司策略研究员。 2018 年 1 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2018 年 11 月 20 日至 2020 年 12 月 16 日担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 11 月 20 日至 2020 年 12 月 16 日担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 3 月 8 日至今担任东吴新产业精选股票型证券投资基金(原东吴新产业精选混合型证券投资基金)基金经理，2019 年 4 月 29 日至今担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

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。

4.1.1 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（转型后）

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

转眼一挥间，公募基金又收获了一个丰收的年份。2020 年 A 股上市公司股票涨幅中位数为 2.79%，然而，同期普通股票型基金和混合型基金的平均收益率分别为 45.94%和 47.47%。

新产业精选基金在 2020 年年末完成了基金的转型工作，本次转型工作主要涉及两点：

第一，将港股通所涉及的上市公司纳入到基金的可投资范围内，这为新产业精选基金未来投资更具性价比和更优质的行业头部上市公司提供了可能性。

第二，新产业精选基金从混合型变更为股票型，权益资产投资仓位下限从 60%提升至 80%。由于基金长期高仓位运作，这一变更对基金当前的投资影响不大。

报告期内我们遵循了基于中长期大类资产配置角度对 A 股权益投资价值和周期的积极判断，组合始终高仓位运行。

由于基金刚完成转型，因此年报中所显示的持仓情况是我们调仓过程中的结果。整体而言，我们的主要持仓头寸较为稳定，仍然集中于：新能源（光伏、电动化/智能化）、寿险、高端白酒、贵金属等领域，其中绝大部分是我们近三年来的长期持仓。

四季度中，持仓的一些变化主要来自贵金属、医疗器械领域持仓标的的结构调整，以及增配了一些高性价比的金融股和长期看好的新能源领域公司。

纵观全年，从可比公募基金相对排名来看，新产业精选基金在上半年排名相对靠后，下半年有些许进步。回顾这一过程，我们一度感受到了一些压力，幸运的是，凭借对长期性和价值投资的信仰，我们的投资理念和操作没有在压力之下变形，我们十分清楚，这也得益于持有人给予我们的宽容和耐心，感谢你们。

这一年的经历促使我们对组合管理深入思考，期间有幸得到一位优秀的 FOF 管理人同时也是

我们最大的机构持有人的点拨，我们更深刻地认识到，基金净值的表现是组合中所有股票按照它们各自权重发挥了功效后的合力结果，作为基金经理，我们不但需要考虑个股的收益风险比，还要结合市场环境，综合考虑整个组合收益兑现久期的长短和确定性。

我们将会在价值投资信仰的指引下，持续打磨迭代研究和组合管理方法，做好价值成长投资，为持有人长期稳健创造价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，东吴新产业精选股票型证券投资基金份额净值为 3.4479 元；本报告期内（2020 年 12 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日）基金份额净值增长率为 1.09%，业绩比较基准收益率为 2.80%。

截至 2020 年 12 月 28 日，东吴新产业精选混合型证券投资基金份额净值为 3.4108 元；本报告期内（2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 28 日）基金份额净值增长率为 17.41%，业绩比较基准收益率为 8.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	369,696,962.50	85.41
	其中：股票	369,696,962.50	85.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,477,491.50	4.96
	其中：债券	21,477,491.50	4.96
	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	39,392,833.93	9.10
8	其他资产	2,305,341.41	0.53
9	合计	432,872,629.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	56,877,955.68	13.63
C	制造业	219,507,816.78	52.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,089.84	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	282,640.56	0.07
J	金融业	79,048,546.76	18.94
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
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	18,493.82	0.00
S	综合	-	-
	合计	355,810,571.60	85.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	11,873,903.41	2.85
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	2,012,487.49	0.48
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	13,886,390.90	3.33

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	176,831	39,992,098.96	9.58
2	601012	隆基股份	427,523	39,417,620.60	9.45
3	600547	山东黄金	1,594,317	37,657,767.54	9.02
4	601318	中国平安	411,962	35,832,454.76	8.59
5	000030	富奥股份	2,792,680	20,498,271.20	4.91
6	601799	星宇股份	100,587	20,167,693.50	4.83
7	600988	赤峰黄金	1,073,154	19,220,188.14	4.61
8	002497	雅化集团	786,415	17,261,809.25	4.14
9	601601	中国太保	437,700	16,807,680.00	4.03
10	002142	宁波银行	433,800	15,330,492.00	3.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,536,491.50	1.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,940,000.00	3.58
	其中：政策性金融债	14,940,000.00	3.58
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）	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,477,491.50	5.15

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200211	20 国开 11	150,000	14,940,000.00	3.58
2	019640	20 国债 10	65,450	6,536,491.50	1.57
3	127027	靖远转债	10	1,000.00	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,298,884.86
2	应收证券清算款	624,521.14
3	应收股利	-
4	应收利息	188,989.81
5	应收申购款	192,945.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,305,341.41

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	364,571,494.16	87.72
	其中：股票	364,571,494.16	87.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,460,910.00	5.16
	其中：债券	21,460,910.00	5.16
	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	14,815,279.00	3.56
8	其他资产	14,740,257.71	3.55
9	合计	415,587,940.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	61,387,238.70	14.85
C	制造业	226,315,517.56	54.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,509.44	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	17,874.78	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	331,239.33	0.08

J	金融业	76,444,037.44	18.49
K	房地产业	11,327.11	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,787.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,865.30	0.00
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	18,096.70	0.00
S	综合	-	-
	合计	364,571,494.16	88.20

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	176,831	39,756,913.73	9.62
2	601012	隆基股份	427,523	39,396,244.45	9.53
3	600547	山东黄金	1,594,317	37,721,540.22	9.13
4	601318	中国平安	411,962	34,860,224.44	8.43
5	600988	赤峰黄金	1,306,054	23,665,698.48	5.73
6	000030	富奥股份	2,792,680	21,587,416.40	5.22
7	601799	星宇股份	100,587	18,367,186.20	4.44
8	601601	中国太保	437,700	15,866,625.00	3.84
9	002497	雅化集团	786,415	15,854,126.40	3.84
10	002142	宁波银行	433,800	15,174,324.00	3.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,531,910.00	1.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,928,000.00	3.61
	其中：政策性金融债	14,928,000.00	3.61
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）	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	21,460,910.00	5.19

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200211	20 国开 11	150,000	14,928,000.00	3.61
2	019640	20 国债 10	65,450	6,531,910.00	1.58
3	127027	靖远转债	10	1,000.00	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	84,974.10
2	应收证券清算款	14,368,343.40
3	应收股利	-
4	应收利息	184,745.67
5	应收申购款	102,194.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,740,257.71

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（ 2020 年 12 月 29 日 ）基金份额总额	121,192,577.92
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	236,861.72
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	396,525.94
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	121,032,913.70

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、报告周期为 2020 年 12 月 29 日到 2020 年 12 月 31 日。

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	118,003,094.69
报告期期间基金总申购份额	18,965,855.29
减:报告期期间基金总赎回份额	15,776,372.06
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	121,192,577.92

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

3、报告周期为 2020 年 10 月 1 日到 2020 年 12 月 28 日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20201230-20201231	25,347,835.87	0.00	0.00	25,347,835.87	20.94%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
1. 巨额赎回风险 （1）本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响； （2）单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险 单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险； 3.流动性风险 单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； 4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 12 月 28 日东吴新产业精选混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于东吴新产业精选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括东吴新产业精选混合型证券投资基金调整投资目标、投资范围、投资策略、投资组合比例等，并同意将“东吴新产业精选混合型证券投资基金”更名为“东吴新产业精选股票型证券投资基金”。自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起（即 2020 年 12 月 29 日），《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》生效，《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴新产业精选股票型证券投资基金设立的文件；

2、中国证监会批准东吴新产业精选混合型证券投资基金变更注册的批复文件；

3、《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》；

4、《东吴新产业精选混合型证券投资基金托管协议》；

5、《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》；

6、《东吴新产业精选股票型证券投资基金托管协议》；

7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

8、报告期内东吴新产业精选股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 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。

9.3 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
2021 年 1 月 22 日