

东吴新经济混合型证券投资基金 2020 年年度报告

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

送出日期：二〇二一年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	61
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴新经济混合型证券投资基金
基金简称	东吴新经济混合
基金主代码	580006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,718,418.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	李申
	联系电话	021-50509888-8308	021-60637102
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	021-60637111

传真	021-50509888-8211	021-60635778
注册地址	上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	邓晖	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	7,045,344.41	3,623,109.35	-3,795,773.39
本期利润	9,864,938.86	6,117,022.30	-6,389,394.64
加权平均基金份额本期利润	0.4482	0.2138	-0.2147
本期加权平均净值利润率	42.92%	25.09%	-25.71%
本期基金份额净值增长率	51.73%	29.35%	-23.28%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	8,233,161.23	-2,067,433.14	-8,536,736.65
期末可供分配基金份额利润	0.3974	-0.0787	-0.2878
期末基金资产净值	28,951,579.62	24,215,186.59	21,124,543.17
期末基金份额净值	1.3974	0.9210	0.7120
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	93.65%	27.63%	-1.33%

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
过去三个月	21.10%	1.95%	10.53%	0.74%	10.57%	1.21%
过去六个月	31.50%	1.99%	18.99%	1.01%	12.51%	0.98%
过去一年	51.73%	1.93%	21.17%	1.07%	30.56%	0.86%
过去三年	50.58%	1.52%	26.39%	1.00%	24.19%	0.52%
过去五年	13.64%	1.44%	34.67%	0.93%	-21.03%	0.51%
自基金合同生效起至今	93.65%	1.54%	53.23%	1.09%	40.42%	0.45%

注：比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。（该基金原业绩比较基准“75%*沪深 300

指数+25%*中信标普全债指数”自 2015 年 9 月 28 日变更为“75%*沪深 300 指数+25%*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

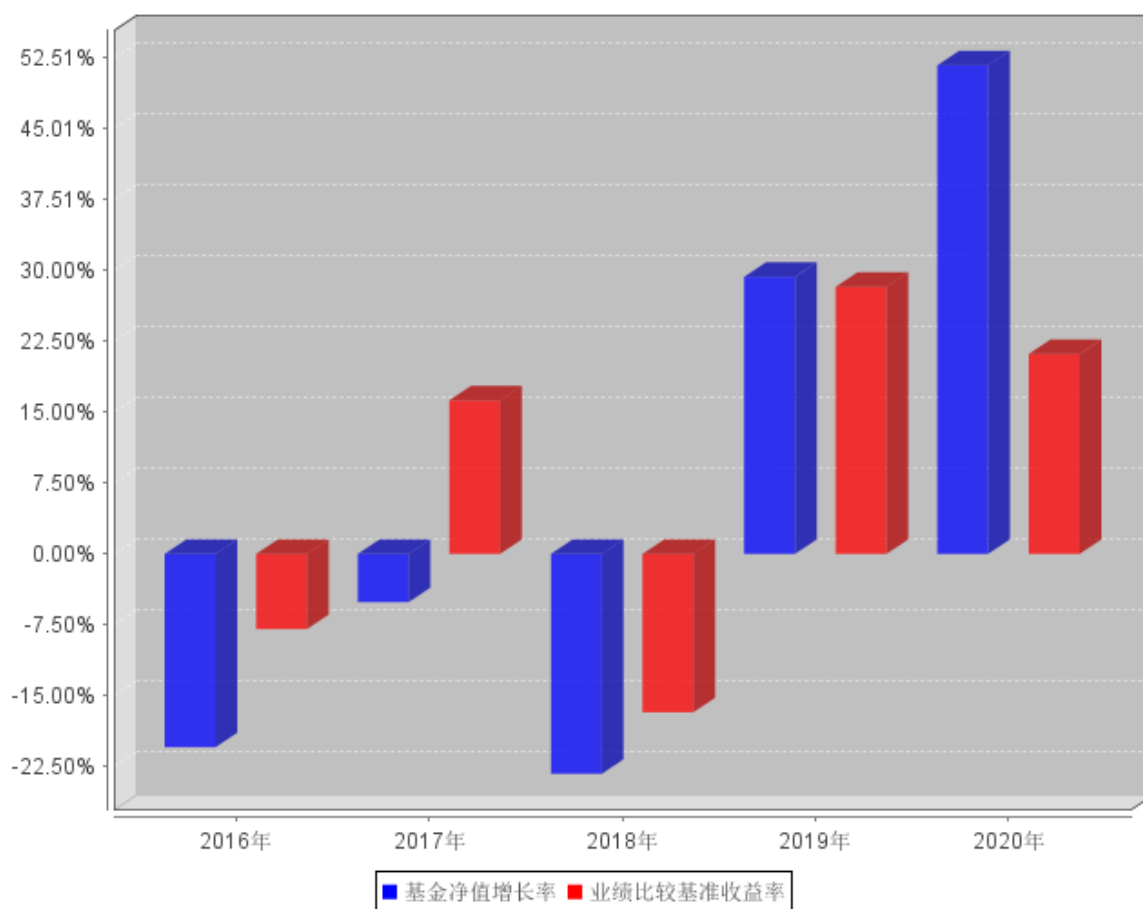
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。（该基金原业绩比较基准“75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数”自 2015 年 9 月 28 日变更为“75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数”）

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2020 年年末, 公司整体资产管理规模为 322 亿元, 其中公募基金 154 亿元, 专户业务 157 亿元, 子公司 11 亿元; 旗下管理着 26 只公募基金, 45 只存续专户资产管理计划, 20 项存续专项资产管理计划(子公司)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘元海	权益投资总部副总经理、基金经理	2020 年 1 月 18 日	-	16 年	刘元海先生, 中国国籍, 同济大学管理学博士, 具备证券投资基金从业资格。曾任职东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理(2004 年 2 月-2015 年 6 月), 期间担任东吴新产业精选股票型证券投资基金、东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)、东吴内需增长混合型证券投资基金、东吴行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月再次加入东吴基金管理有

					限公司，现任权益投资总部副总经理、基金经理。2017 年 2 月 9 日至 2020 年 1 月 9 日担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月 27 日至今担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 29 日至今担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 1 月 18 日至今担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2020 年 4 月 1 日至今担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理。
徐 增	基金经理	2020 年 12 月 16 日	-	10 年	徐增先生，中国国籍，香港中文大学哲学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职埃森哲咨询公司上海分公司行业研究员。2011 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2015 年 5 月 12 日至 2018 年 11 月 20 日担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金（原东吴内需增长混合型证券投资基金）基金经理，2015 年 5 月 29 日至 2018 年 11 月 20 日担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金（原东吴新创业混合型证券投资基金）基金经理，2015 年 5 月 29 日至 2018 年 12 月 6 日担任东吴新经济混合型证

					券投资基金基金经理，2018年10月12日至今担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020年12月16日至今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，2020年12月16日至今担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2021年1月22日至今担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。
张能进	基金经理	2018年2月27日	2020年1月18日	12年	张能进先生，中国国籍，上海理工大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。2007年7月至2009年11月就职于东北证券，任行业研究员，2009年11月加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任基金经理助理、基金经理，现任研究员，其中2018年2月27日至2020年1月28日担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2016年5月10日至2018年3月3日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、此处的任职日期和离任日期均为公司对外公告日，自2021年3月1日起刘元海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。

4.1.1 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

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。

4.1.2 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

市场在过去一年里呈现上涨态势，上半年突发疫情，因此疫情受益的部分医药和消费类股票涨幅较好。下半年随着中国国内疫情受到控制，部分顺周期股票及行业景气度高的军工和新能源

股票表现强势。

报告期内，东吴新经济基金重点配置了消费、科技和新能源等白马龙头公司。

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 1.3974 元；本报告期基金份额净值增长率为 51.73%，业绩比较基准收益率为 21.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了新冠疫情冲击的 2020 年，2021 年我们将迎来后疫情时代。2021 年的我国宏观经济政策环境是“经济修复+政策先稳后紧”。经济向上修复的主要动力来自于出口、制造业投资和服务型消费。出口端，全球疫苗推出后疫情有望逐步修复，全球复苏将带动我国出口继续修复。投资端，由于企业盈利不断修复，叠加出口景气，制造业将从单纯的补库向扩产能演进，制造业投资有望继续加速。此外虽然房住不炒基调下地产调控频频，但房企基于回笼现金流考量仍有动力加快开工和销售，房地产投资仍有韧性。消费端，我国疫情修复后国内服务型消费也将逐步复苏。基数效应导致国内 GDP 同比增速高点在一季度出现后逐季回落，但全年真实的经济修复动能可能仍然持续超预期。

2021 年政策端全年来看相对 2020 年将有所收敛。在去年末中央经济工作会议定调宏观政策“不急转弯”指引下，一季度我国货币政策仍然以稳为主，但二季度通胀预期大概率升温，叠加疫苗逐步推进，货币政策边际上可能会有所调整。信用端全年社融增速逐步回落也成为市场共识。以美联储为代表的海外央行货币政策调整节奏整体上要滞后于中国，美联储在 2021 年下半年可能会逐步考虑缩减购债规模，美联储加息则可能要等到 2023 年后。

基于自上而下的宏观经济政策预判，我们对 2021 年 A 股有三个判断：一是全年估值大概率收缩，收益预期需要适当降低。本轮市场涨幅由流动性驱动，流动性的边际调整使得估值可能很难像过去两年那样明显扩张；二是市场上半年大概率优于下半年。综合通胀和疫苗节奏，国内流动性边际调整的时点大概率在二季度或之后；三是业绩确定性重于想象空间。流动性从过去的极度宽松转向收敛，高估值但无业绩支撑的标的估值收缩压力较大，长期逻辑顺畅且业绩确定性的品种相对更优。

2021 年我们重点看好新能源汽车。从投资主线来看，由于去年疫情导致的低基数效应，今年一季度大部分行业都将获得较快的业绩增长，新能源汽车也属于其中的佼佼者。但如果综合匹配短期的业绩高增长与长期的成长确定性，我们认为新能源汽车仍是目前前景比较好的赛道。短期来看，中国和欧洲都是新一轮车型周期带动市场化需求，特斯拉、大众、新势力是其中的引领者，最终反映到今年产业链诸多环节量价齐升的强劲基本面上，长期来看，全球碳减排要求提高确定

了行业未来 10 年的高成长性，新能源汽车也将引领绿色能源经济时代。短期我们也认为新能源汽车板块估值已经不再便宜，行情可能会有震荡，但选择一个好赛道是获得长期超额收益的基础。

东吴新经济基金将继续深挖具备竞争力和成长性潜力的优质公司，陪伴公司成长，力争长期享受好赛道+好公司的双重阿尔法收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

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

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

（3）加强宣传推介材料审核，保证合规推介。公司根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》等法规及相关监管要求，严格审核对外宣传材料，包括但不限于宣传单页、一页通、海报、PPT、视频、文章等，重点对宣传材料中涉及到的业绩引用、基金评价引用、风险揭示等内容作出合规风险提示。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营副总经理、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60469066_B06 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴新经济混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东吴新经济混合型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的东吴新经济混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴新经济混合型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴新经济混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	东吴新经济混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估东吴新经济混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的

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

	进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈 露	张亚旋
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	4,239,602.36	3,233,571.10
结算备付金		212,502.37	309,931.55
存出保证金		25,043.78	26,772.97
交易性金融资产	7.4.7.2	24,881,006.27	20,914,164.00
其中：股票投资		24,881,006.27	20,914,164.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,878,264.86	-
应收利息	7.4.7.5	472.07	1,099.10
应收股利		-	-
应收申购款		56,592.94	42,783.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		31,293,484.65	24,528,321.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,983,052.03	-
应付赎回款		151,807.06	15,964.58
应付管理人报酬		31,743.04	30,573.14
应付托管费		5,290.51	5,095.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	117,469.48	213,472.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	52,542.91	48,029.47
负债合计		2,341,905.03	313,135.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	20,718,418.39	26,282,619.73
未分配利润	7.4.7.10	8,233,161.23	-2,067,433.14
所有者权益合计		28,951,579.62	24,215,186.59
负债和所有者权益总计		31,293,484.65	24,528,321.96

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3974 元，基金份额总额 20,718,418.39 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		11,182,980.10	7,208,247.43
1. 利息收入		21,996.05	43,859.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,996.05	43,859.24
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）		8,328,186.53	4,667,437.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,219,074.73	4,482,305.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	109,111.80	185,131.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,819,594.45	2,493,912.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,203.07	3,038.17
减：二、费用		1,318,041.24	1,091,225.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	344,046.89	365,057.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	57,341.07	60,842.94
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	843,795.33	597,702.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	72,857.95	67,622.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,864,938.86	6,117,022.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,864,938.86	6,117,022.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新经济混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	26,282,619.73	-2,067,433.14	24,215,186.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,864,938.86	9,864,938.86
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）	-5,564,201.34	435,655.51	-5,128,545.83
其中：1. 基金申购款	9,091,749.07	1,072,208.52	10,163,957.59
2. 基金赎回款	-14,655,950.41	-636,553.01	-15,292,503.42
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）	20,718,418.39	8,233,161.23	28,951,579.62
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	29,661,279.82	-8,536,736.65	21,124,543.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,117,022.30	6,117,022.30
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）	-3,378,660.09	352,281.21	-3,026,378.88
其中：1. 基金申购款	2,215,195.72	-337,326.11	1,877,869.61
2. 基金赎回款	-5,593,855.81	689,607.32	-4,904,248.49
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）	26,282,619.73	-2,067,433.14	24,215,186.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓晖</u>	<u>徐明</u>	<u>吴婷</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

融工具，将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

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

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

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

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

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1、印花税

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

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发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

4、企业所得税

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

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

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

5、个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	4,239,602.36	3,233,571.10
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	4,239,602.36	3,233,571.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,094,034.11	24,881,006.27	3,786,972.16
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	21,094,034.11	24,881,006.27	3,786,972.16
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,946,786.29	20,914,164.00	967,377.71
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	19,946,786.29	20,914,164.00	967,377.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	354.59	932.34
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	105.16	153.45
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	12.32	13.31
合计	472.07	1,099.10

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	117,469.48	213,472.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	117,469.48	213,472.69

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	42.91	29.47
应付证券出借违约金	—	—
应付转换费	—	—
应付账户维护费	4,500.00	—
应付审计费	48,000.00	48,000.00
应付信息披露费	—	—
合计	52,542.91	48,029.47

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,282,619.73	26,282,619.73
本期申购	9,091,749.07	9,091,749.07
本期赎回（以“-”号填列）	-14,655,950.41	-14,655,950.41
- 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	20,718,418.39	20,718,418.39

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。

7.4.7.10 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	11,228,669.03	-13,296,102.17	-2,067,433.14
本期利润	7,045,344.41	2,819,594.45	9,864,938.86
本期基金份额交易产生的变动数	-2,351,984.11	2,787,639.62	435,655.51
其中：基金申购款	5,283,126.06	-4,210,917.54	1,072,208.52
基金赎回款	-7,635,110.17	6,998,557.16	-636,553.01
本期已分配利润	—	—	—
本期末	15,922,029.33	-7,688,868.10	8,233,161.23

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	17,891.85	41,465.97
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	3,527.78	2,114.91
其他	576.42	278.36
合计	21,996.05	43,859.24

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	282,310,062.16	198,391,898.01
减：卖出股票成本总额	274,090,987.43	193,909,592.24
买卖股票差价收入	8,219,074.73	4,482,305.77

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	109,111.80	185,131.30
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	109,111.80	185,131.30

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,819,594.45	2,493,912.95
——股票投资	2,819,594.45	2,493,912.95
——债券投资	-	-
——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	2,819,594.45	2,493,912.95

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	13,138.25	2,990.54
基金转换费收入	64.82	47.63
合计	13,203.07	3,038.17

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	843,795.33	597,702.01
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-

其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	843,795.33	597,702.01

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	48,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	22,500.00	18,000.00
银行汇划费	2,357.95	1,622.37
其他费用	-	-
合计	72,857.95	67,622.37

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
海澜集团有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份有限公司	16,088,093.20	2.89%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

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交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份有限公司	14,661.01	2.86%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	344,046.89	365,057.81

其中：支付销售机构的客户维护费	107,794.04	115,185.96
-----------------	------------	------------

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

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

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,341.07	60,842.94

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期及上年度可比期间均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,239,602.36	17,891.85	3,233,571.10	41,465.97

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2020 年度获得的利息收入为人民币 3,527.78 元（2019 年度：人民币 2,114.91 元），2020 年末结算备付金余额为人民币 212,502.37 元（2019 年末：人民币 309,931.55 元）。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	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
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	152	2,321.04	2,321.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金,本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券、权证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。

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

本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,根据自上而下对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,在遵循本基金资产配置总体比例限制范围内,确定基金资产在股票、债券、现金和其他金融工具上的具体投资比例。根据科学技术和产业的发展趋势对与新经济相关创新技术、典型产业进行识别。随后自下而上地精选代表新经济的典型上市公司和与新经济密切相关的上市公司,针对两类公司的不同特征,充分考虑公司的成长性,运用东吴基金企业竞争优势评价

体系进行评价，构建股票池。投资其中具有成长优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。

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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

7.4.13.2.1 按短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短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《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，未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	4,239,602.36	-	-	-	-	-	4,239,602.36

结算备付金	212,502.37	-	-	-	-	-	212,502.37
存出保证金	25,043.78	-	-	-	-	-	25,043.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	24,881,006.27	24,881,006.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,878,264.86	1,878,264.86
应收利息	-	-	-	-	-	472.07	472.07
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	56,592.94	56,592.94
资产总计	4,477,148.51	-	-	-	-	26,816,336.14	31,293,484.65
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,983,052.03	1,983,052.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	151,807.06	151,807.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,743.04	31,743.04
应付托管费	-	-	-	-	-	5,290.51	5,290.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	117,469.48	117,469.48
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	52,542.91	52,542.91
负债总计	-	-	-	-	-	2,341,905.03	2,341,905.03
利率敏感度缺口	4,477,148.51	-	-	-	-	24,474,431.11	28,951,579.62
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	3,233,571.10	-	-	-	-	-	3,233,571.10
结算备付金	309,931.55	-	-	-	-	-	309,931.55
存出保证金	26,772.97	-	-	-	-	-	26,772.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	20,914,164.00	20,914,164.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,099.10	1,099.10
应收申购款	-	-	-	-	-	42,783.24	42,783.24
资产总计	3,570,275.62	-	-	-	-	20,958,046.34	24,528,321.96
负债	-	-	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-	15,964.58	15,964.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,573.14	30,573.14
应付托管费	-	-	-	-	-	5,095.49	5,095.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	213,472.69	213,472.69
其他负债	-	-	-	-	-	48,029.47	48,029.47
负债总计	-	-	-	-	-	313,135.37	313,135.37
利率敏感度缺口	3,570,275.62	-	-	-	-	-20,644,910.97	24,215,186.59

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)，银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	24,881,006.27	85.94	20,914,164.00	86.37
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	24,881,006.27	85.94	20,914,164.00	86.37
----	---------------	-------	---------------	-------

注：本基金投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中属于新经济范畴的股票类资产投资比例不低于股票类资产的 80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	1. 业绩基准下跌 1%	-425, 588. 22	-261, 524. 02
	2. 业绩基准下跌 5%	-2, 127, 941. 10	-1, 307, 620. 08
	3. 业绩基准下跌 10%	-4, 255, 882. 20	-2, 615, 240. 15

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 24,878,685.23 元，属于第二层次的余额为人民币 2,321.04 元，无属于第三层次的余额。（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 19,425,222.00 元，属于第二层次的余额为人民币 1,488,942.00 元，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确

定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 28,951,579.62 元，已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。本基金资产管理人将继续尽职尽责，积极采取措施，力争改变这一状况。

除此之外，本基金无其他需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,881,006.27	79.51
	其中：股票	24,881,006.27	79.51
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	4,452,104.73	14.23
8	其他各项资产	1,960,373.65	6.26
9	合计	31,293,484.65	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	24,874,654.25	85.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,352.02	0.02
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	—	—

0	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	24,881,006.27	85.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688567	孚能科技	41,437	1,895,742.75	6.55
2	300750	宁德时代	5,000	1,755,550.00	6.06
3	300769	德方纳米	10,300	1,722,160.00	5.95
4	603596	伯特利	46,200	1,580,964.00	5.46
5	300014	亿纬锂能	17,100	1,393,650.00	4.81
6	300073	当升科技	21,400	1,387,790.00	4.79
7	603348	文灿股份	50,200	1,375,480.00	4.75
8	002126	银轮股份	97,700	1,345,329.00	4.65
9	300124	汇川技术	13,800	1,287,540.00	4.45
10	603799	华友钴业	16,200	1,284,660.00	4.44
11	002466	天齐锂业	32,400	1,272,348.00	4.39
12	688388	嘉元科技	13,897	1,224,881.58	4.23
13	002756	永兴材料	16,800	910,896.00	3.15
14	688116	天奈科技	14,479	897,698.00	3.10
15	600660	福耀玻璃	18,000	864,900.00	2.99
16	002920	德赛西威	9,900	832,986.00	2.88
17	002050	三花智控	32,800	808,520.00	2.79
18	600563	法拉电子	7,400	795,870.00	2.75
19	002709	天赐材料	7,400	768,120.00	2.65
20	600885	宏发股份	14,100	764,502.00	2.64
21	688339	亿华通	2,556	696,075.48	2.40
22	003028	振邦智能	160	6,670.40	0.02
23	003029	吉大正元	243	6,352.02	0.02
24	003031	中瓷电子	152	2,321.04	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300782	卓胜微	9,123,531.68	37.68
2	300059	东方财富	8,389,226.16	34.64
3	600584	长电科技	7,597,536.00	31.38
4	600703	三安光电	5,784,232.00	23.89
5	000568	泸州老窖	5,629,293.22	23.25
6	603986	兆易创新	5,400,541.00	22.30
7	000858	五粮液	5,161,183.57	21.31
8	300033	同花顺	4,809,945.00	19.86
9	603501	韦尔股份	4,458,187.00	18.41
10	002600	领益智造	4,396,486.00	18.16
11	002460	赣锋锂业	4,343,645.00	17.94
12	002273	水晶光电	4,208,934.00	17.38
13	603799	华友钴业	4,197,503.00	17.33
14	002463	沪电股份	3,999,529.00	16.52
15	603160	汇顶科技	3,971,861.20	16.40
16	002456	欧菲光	3,967,943.00	16.39
17	300136	信维通信	3,877,382.00	16.01
18	300750	宁德时代	3,774,852.00	15.59
19	002371	北方华创	3,766,226.32	15.55
20	000063	中兴通讯	3,673,973.70	15.17
21	002466	天齐锂业	3,628,013.92	14.98
22	002475	立讯精密	3,296,401.12	13.61
23	300433	蓝思科技	3,230,795.94	13.34
24	000651	格力电器	3,134,013.00	12.94
25	000977	浪潮信息	3,044,059.74	12.57
26	002555	三七互娱	3,015,079.00	12.45
27	000661	长春高新	3,010,554.00	12.43
28	603348	文灿股份	2,820,887.00	11.65
29	603019	中科曙光	2,811,877.59	11.61
30	002507	涪陵榨菜	2,802,275.00	11.57
31	300037	新宙邦	2,801,787.92	11.57

32	600104	上汽集团	2,725,304.00	11.25
33	603259	药明康德	2,702,287.16	11.16
34	300122	智飞生物	2,645,921.00	10.93
35	000725	京东方 A	2,563,176.00	10.58
36	300769	德方纳米	2,551,734.05	10.54
37	002230	科大讯飞	2,502,211.00	10.33
38	600570	恒生电子	2,407,374.60	9.94
39	300759	康龙化成	2,389,605.00	9.87
40	000636	风华高科	2,164,090.28	8.94
41	600276	恒瑞医药	2,123,110.40	8.77
42	002050	三花智控	2,091,761.00	8.64
43	002241	歌尔股份	2,037,836.00	8.42
44	002624	完美世界	2,007,837.38	8.29
45	300383	光环新网	1,958,333.00	8.09
46	002916	深南电路	1,916,110.00	7.91
47	603883	老百姓	1,894,355.12	7.82
48	600600	青岛啤酒	1,889,193.00	7.80
49	601318	中国平安	1,848,126.00	7.63
50	300463	迈克生物	1,801,257.00	7.44
51	300347	泰格医药	1,778,636.00	7.35
52	002709	天赐材料	1,768,383.00	7.30
53	300601	康泰生物	1,750,569.00	7.23
54	601668	中国建筑	1,708,732.00	7.06
55	601186	中国铁建	1,702,666.18	7.03
56	002938	鹏鼎控股	1,689,589.69	6.98
57	603596	伯特利	1,642,195.00	6.78
58	300124	汇川技术	1,599,896.00	6.61
59	600183	生益科技	1,592,273.00	6.58
60	601628	中国人寿	1,543,279.17	6.37
61	300253	卫宁健康	1,502,741.00	6.21
62	000333	美的集团	1,478,110.00	6.10
63	600031	三一重工	1,463,346.92	6.04
64	002156	通富微电	1,461,638.00	6.04
65	002340	格林美	1,441,297.00	5.95
66	002415	海康威视	1,430,559.00	5.91
67	600030	中信证券	1,417,950.00	5.86

68	002223	鱼跃医疗	1,417,878.00	5.86
69	688567	孚能科技	1,401,622.55	5.79
70	300015	爱尔眼科	1,379,988.56	5.70
71	300760	迈瑞医疗	1,342,711.00	5.54
72	601689	拓普集团	1,332,946.10	5.50
73	300073	当升科技	1,320,928.00	5.45
74	002812	恩捷股份	1,288,069.00	5.32
75	601601	中国太保	1,216,789.00	5.02
76	600036	招商银行	1,214,738.00	5.02
77	600522	中天科技	1,192,100.00	4.92
78	002126	银轮股份	1,180,167.00	4.87
79	300014	亿纬锂能	1,177,306.00	4.86
80	000596	古井贡酒	1,172,506.23	4.84
81	002661	克明面业	1,132,572.00	4.68
82	600867	通化东宝	1,120,733.00	4.63
83	000002	万科 A	1,087,001.00	4.49
84	601888	中国中免	1,025,049.00	4.23
85	600305	恒顺醋业	992,942.00	4.10
86	600519	贵州茅台	982,177.00	4.06
87	601012	隆基股份	977,473.00	4.04
88	688396	华润微	952,909.68	3.94
89	000526	紫光学大	942,929.00	3.89
90	600837	海通证券	932,834.00	3.85
91	603517	绝味食品	927,396.00	3.83
92	002007	华兰生物	893,529.00	3.69
93	002351	漫步者	893,438.00	3.69
94	688388	嘉元科技	892,799.93	3.69
95	603659	璞泰来	868,248.00	3.59
96	600438	通威股份	866,809.00	3.58
97	002756	永兴材料	846,170.00	3.49
98	002497	雅化集团	844,065.00	3.49
99	002920	德赛西威	841,941.20	3.48
100	600660	福耀玻璃	838,960.00	3.46
101	300316	晶盛机电	795,166.00	3.28
102	603658	安图生物	782,108.00	3.23
103	300003	乐普医疗	763,416.00	3.15

104	300776	帝尔激光	746,582.80	3.08
105	002304	洋河股份	745,627.00	3.08
106	688116	天奈科技	707,524.87	2.92
107	601127	小康股份	707,232.00	2.92
108	002410	广联达	702,017.00	2.90
109	300502	新易盛	696,987.54	2.88
110	002993	奥海科技	690,353.00	2.85
111	300017	网宿科技	686,542.00	2.84
112	600885	宏发股份	681,667.00	2.82
113	600563	法拉电子	681,467.00	2.81
114	688339	亿华通	677,357.60	2.80
115	688981	中芯国际	675,600.00	2.79
116	300364	中文在线	663,979.00	2.74
117	002833	弘亚数控	648,655.80	2.68
118	002459	晶澳科技	644,293.00	2.66
119	688111	金山办公	635,788.85	2.63
120	603589	口子窖	635,728.00	2.63
121	600480	凌云股份	634,669.00	2.62
122	002508	老板电器	629,744.00	2.60
123	300166	东方国信	628,200.00	2.59
124	002439	启明星辰	591,540.45	2.44
125	002292	奥飞娱乐	583,681.00	2.41
126	601899	紫金矿业	581,000.00	2.40
127	688008	澜起科技	580,324.48	2.40
128	688012	中微公司	569,468.00	2.35
129	002405	四维图新	562,472.00	2.32
130	603233	大参林	560,662.00	2.32
131	603387	基蛋生物	553,641.00	2.29
132	601138	工业富联	553,200.00	2.28
133	002745	木林森	532,725.00	2.20
134	300496	中科创达	518,945.80	2.14
135	300618	寒锐钴业	515,749.00	2.13
136	688029	南微医学	515,648.29	2.13
137	603866	桃李面包	509,300.00	2.10
138	603228	景旺电子	507,936.00	2.10
139	603833	欧派家居	501,200.00	2.07

140	603127	昭衍新药	488,544.00	2.02
141	603369	今世缘	487,034.00	2.01
142	300685	艾德生物	486,907.00	2.01
143	688369	致远互联	484,837.00	2.00
144	600048	保利地产	484,800.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	9,417,880.00	38.89
2	300782	卓胜微	9,130,307.76	37.70
3	600584	长电科技	7,998,480.00	33.03
4	300033	同花顺	6,453,083.92	26.65
5	000858	五粮液	6,284,604.00	25.95
6	000568	泸州老窖	6,096,857.00	25.18
7	600703	三安光电	5,953,877.00	24.59
8	603986	兆易创新	5,504,129.34	22.73
9	603799	华友钴业	4,676,200.00	19.31
10	002460	赣锋锂业	4,532,267.00	18.72
11	603501	韦尔股份	4,414,738.00	18.23
12	002463	沪电股份	4,321,065.00	17.84
13	002600	领益智造	4,235,910.00	17.49
14	002273	水晶光电	4,200,915.99	17.35
15	002456	欧菲光	3,985,685.00	16.46
16	002371	北方华创	3,975,171.08	16.42
17	300136	信维通信	3,880,639.00	16.03
18	300037	新宙邦	3,798,262.00	15.69
19	603160	汇顶科技	3,769,836.00	15.57
20	300433	蓝思科技	3,651,862.96	15.08
21	000661	长春高新	3,599,953.00	14.87
22	300122	智飞生物	3,594,424.06	14.84
23	000063	中兴通讯	3,574,385.00	14.76
24	002475	立讯精密	3,403,209.00	14.05
25	002555	三七互娱	3,171,342.43	13.10
26	603259	药明康德	3,130,460.20	12.93

27	000725	京东方 A	3,076,240.00	12.70
28	601628	中国人寿	3,049,711.07	12.59
29	000977	浪潮信息	2,998,906.50	12.38
30	002230	科大讯飞	2,983,163.00	12.32
31	000651	格力电器	2,980,409.00	12.31
32	603019	中科曙光	2,933,121.00	12.11
33	002507	涪陵榨菜	2,830,341.90	11.69
34	600104	上汽集团	2,828,189.00	11.68
35	300759	康龙化成	2,687,355.00	11.10
36	300750	宁德时代	2,551,933.00	10.54
37	002466	天齐锂业	2,500,916.00	10.33
38	600305	恒顺醋业	2,492,904.00	10.29
39	600570	恒生电子	2,298,522.00	9.49
40	000636	风华高科	2,234,166.00	9.23
41	002916	深南电路	2,154,449.00	8.90
42	002241	歌尔股份	2,148,969.00	8.87
43	600276	恒瑞医药	2,083,487.00	8.60
44	600600	青岛啤酒	2,060,934.00	8.51
45	002624	完美世界	2,026,339.00	8.37
46	300463	迈克生物	1,991,086.00	8.22
47	300383	光环新网	1,971,264.00	8.14
48	603883	老百姓	1,944,787.00	8.03
49	600183	生益科技	1,856,932.00	7.67
50	601318	中国平安	1,835,570.26	7.58
51	300347	泰格医药	1,822,821.00	7.53
52	300253	卫宁健康	1,801,201.00	7.44
53	002938	鹏鼎控股	1,780,421.89	7.35
54	000002	万科 A	1,722,211.00	7.11
55	002709	天赐材料	1,687,693.00	6.97
56	300015	爱尔眼科	1,669,324.00	6.89
57	300601	康泰生物	1,620,560.00	6.69
58	002156	通富微电	1,493,102.00	6.17
59	600031	三一重工	1,481,981.52	6.12
60	601689	拓普集团	1,473,025.00	6.08
61	603348	文灿股份	1,461,325.00	6.03
62	300769	德方纳米	1,442,316.04	5.96
63	002415	海康威视	1,440,340.00	5.95
64	601668	中国建筑	1,436,119.00	5.93

65	002812	恩捷股份	1,405,279.29	5.80
66	002223	鱼跃医疗	1,383,057.00	5.71
67	002340	格林美	1,370,071.00	5.66
68	002050	三花智控	1,366,733.00	5.64
69	600258	首旅酒店	1,361,056.00	5.62
70	601186	中国铁建	1,342,275.00	5.54
71	000333	美的集团	1,335,272.00	5.51
72	300760	迈瑞医疗	1,331,793.80	5.50
73	600030	中信证券	1,299,287.00	5.37
74	002661	克明面业	1,281,657.00	5.29
75	600522	中天科技	1,247,919.00	5.15
76	002202	金风科技	1,241,632.00	5.13
77	000596	古井贡酒	1,109,848.00	4.58
78	600036	招商银行	1,093,476.00	4.52
79	000001	平安银行	1,083,255.00	4.47
80	601009	南京银行	1,074,226.00	4.44
81	688396	华润微	1,069,030.59	4.41
82	002332	仙琚制药	1,044,176.00	4.31
83	601601	中国太保	1,030,147.00	4.25
84	601012	隆基股份	1,029,700.00	4.25
85	601888	中国中免	1,028,099.00	4.25
86	600519	贵州茅台	1,018,127.00	4.20
87	600867	通化东宝	992,969.00	4.10
88	603517	绝味食品	986,834.00	4.08
89	000526	紫光学大	977,391.00	4.04
90	603833	欧派家居	972,969.00	4.02
91	603659	璞泰来	916,978.00	3.79
92	600837	海通证券	914,252.12	3.78
93	600048	保利地产	888,172.00	3.67
94	002351	漫步者	878,381.00	3.63
95	002007	华兰生物	867,869.70	3.58
96	600438	通威股份	860,754.00	3.55
97	002497	雅化集团	854,727.00	3.53
98	300316	晶盛机电	797,145.00	3.29
99	603658	安图生物	786,959.00	3.25
100	600887	伊利股份	783,848.00	3.24
101	601111	中国国航	763,938.00	3.15
102	002304	洋河股份	758,210.00	3.13

103	600176	中国巨石	746,981.00	3.08
104	002833	弘亚数控	744,533.00	3.07
105	600029	南方航空	744,399.37	3.07
106	300776	帝尔激光	719,481.00	2.97
107	300003	乐普医疗	716,823.00	2.96
108	601933	永辉超市	696,725.00	2.88
109	002410	广联达	692,639.00	2.86
110	300502	新易盛	690,059.00	2.85
111	002292	奥飞娱乐	683,797.00	2.82
112	601899	紫金矿业	674,400.00	2.79
113	601127	小康股份	669,669.00	2.77
114	002459	晶澳科技	665,357.00	2.75
115	300364	中文在线	661,731.00	2.73
116	300017	网宿科技	654,668.00	2.70
117	002508	老板电器	643,183.12	2.66
118	688111	金山办公	631,818.99	2.61
119	603589	口子窖	627,546.00	2.59
120	600480	凌云股份	620,408.00	2.56
121	603233	大参林	616,982.00	2.55
122	300166	东方国信	616,714.90	2.55
123	002993	奥海科技	615,484.00	2.54
124	688981	中芯国际	608,320.00	2.51
125	300618	寒锐钴业	605,269.00	2.50
126	603387	基蛋生物	601,965.00	2.49
127	002745	木林森	594,368.14	2.45
128	601138	工业富联	556,241.00	2.30
129	002405	四维图新	549,555.00	2.27
130	002439	启明星辰	548,259.00	2.26
131	603939	益丰药房	546,114.00	2.26
132	300496	中科创达	532,354.00	2.20
133	002271	东方雨虹	529,937.00	2.19
134	603197	保隆科技	523,615.00	2.16
135	688008	澜起科技	520,800.00	2.15
136	603228	景旺电子	502,090.00	2.07
137	603866	桃李面包	498,303.00	2.06
138	603127	昭衍新药	489,384.00	2.02
139	300685	艾德生物	486,156.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	275,238,235.25
卖出股票收入（成交）总额	282,310,062.16

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一

年受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,043.78
2	应收证券清算款	1,878,264.86
3	应收股利	—
4	应收利息	472.07
5	应收申购款	56,592.94
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,960,373.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,684	7,719.23	0.00	0.00%	20,718,418.39	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	151.36	0.0007%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2009 年 12 月 30 日 ）基金份额总额	800,855,129.16
本报告期期初基金份额总额	26,282,619.73
本报告期基金总申购份额	9,091,749.07
减:本报告期基金总赎回份额	14,655,950.41
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	20,718,418.39

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

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，吕晖同志不再担任公司督察长职务；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。

2020 年 11 月 18 日经东吴基金管理有限公司第三届董事会第七次会议审议通过，聘任葛艳同志为东吴基金管理有限公司首席信息官，2020 年 12 月 23 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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内应支付审计费 48000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。公司高度重视，按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程，制定相关整改措施，落实整改工作。截至本报告日，公司已完成整改工作并向监管部门提交了整改报告。

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
海通证券	2	252,075,426.53	45.22%	230,769.41	45.07%	—
招商证券	1	104,131,330.31	18.68%	94,894.90	18.53%	—
兴业证券	1	89,028,606.43	15.97%	82,911.91	16.19%	—
国泰君安	2	45,846,815.52	8.22%	42,079.52	8.22%	—
东方证券	1	19,216,269.75	3.45%	17,896.02	3.50%	—
广发证券	1	18,241,016.54	3.27%	16,987.68	3.32%	—
东吴证券	2	16,088,093.20	2.89%	14,661.01	2.86%	—
天风证券	2	7,109,852.28	1.28%	6,479.21	1.27%	—
国盛证券	1	5,744,299.40	1.03%	5,349.67	1.04%	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
中银国际	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
长城证券	2	—	—	—	—	—

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

本基金本报告期新增 1 个交易单元，为广发证券的交易单元，退租 3 个交易单元，分别为中信证券的交易单元和恒泰证券的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 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	2020 年 1 月 7 日
5	东吴新经济混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 1 月 18 日
6	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

7	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 1 月 21 日
8	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
9	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
10	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
11	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 3 月 16 日
12	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
13	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
14	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、	2020 年 4 月 14 日

		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
16	东吴基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金提高估值精度并修改基金合同的公告	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 24 日
17	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
18	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 4 月 29 日
19	东吴基金管理有限公司关于参加华安证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 5 月 9 日
20	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

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 5 月 21 日
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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

27	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
28	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
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	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 7 月 1 日
30	东吴基金管理有限公司管理的基金 2020 年半年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2020 年 7 月 1 日
31	东吴基金管理有限公司关于参加长城国瑞证券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 7 月 3 日
32	东吴基金管理有限公司关于暂停成都华羿恒信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 7 月 3 日
33	东吴基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2020 年 7 月 3 日

		中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	
34	东吴基金管理有限公司关于旗下基金开通在大连网金基金销售有限公司的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 7 月 15 日
35	东吴基金管理有限公司关于参加大连网金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 7 月 15 日
36	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 7 月 21 日
37	东吴基金管理有限公司住所变更公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 7 月 31 日
38	东吴基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告	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	2020 年 8 月 20 日
39	东吴基金管理有限公司关于参加招商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	2020 年 8 月 21 日

40	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2020 年 8 月 28 日
41	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 8 月 28 日
42	东吴基金管理有限公司关于参加恒泰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	2020 年 8 月 31 日
43	东吴基金管理有限公司关于暂停手机 APP、微信服务号认购、申购（含定期定额）及转换转入业务的公告	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	2020 年 8 月 31 日
44	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在中国人寿保险股份有限公司的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	2020 年 8 月 31 日
45	东吴基金管理有限公司关于参加中国人寿保险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	2020 年 8 月 31 日
46	东吴基金管理有限公司关于参加江苏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	2020 年 9 月 11 日
47	东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2020 年 10 月 22 日

	定期定额投资) 金额、单笔最低赎回份额、转换转出及最低持有份额的公告	券日报、公司网站、 中证信息网站	
48	东吴基金管理有限公司关于参加海通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	2020 年 10 月 23 日
49	东吴基金管理有限公司关于参加华鑫证券有限责任公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2020 年 10 月 23 日
50	东吴基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2020 年 10 月 26 日
51	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2020 年 10 月 28 日
52	东吴基金管理有限公司关于参加方德保险代理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	2020 年 10 月 28 日
53	东吴基金管理有限公司关于参加北京肯特瑞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	2020 年 10 月 31 日
54	东吴基金管理有限公司关于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	2020 年 11 月 3 日

		券日报、公司网站、 中证信息网站	
55	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台暂停农行网银直连支付开户与签约业务的公告	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	2020 年 11 月 26 日
56	东吴基金管理有限公司关于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	2020 年 12 月 1 日
57	东吴基金管理有限公司关于参加宁波银行股份有限公司同业基金销售平台费率优惠的公告	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	2020 年 12 月 12 日
58	东吴基金管理有限公司关于参加信达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	2020 年 12 月 12 日
59	东吴新经济混合型证券投资基金基金经理变更	证券时报、公司网站、 中证信息网站	2020 年 12 月 16 日
60	东吴新经济混合型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	证券时报、公司网站、 中证信息网站	2020 年 12 月 18 日
61	东吴基金管理有限公司首席信息官任职公告	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 12 月 23 日
62	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2020 年 12 月 30 日

	股份有限公司个人电子银行基金 申购费率优惠活动的公告	券日报、公司网站、 中证信息网站	
63	东吴基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加交通银行股份有限 公司基金申购及定期定额投资手 续费率优惠的公告	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	2020 年 12 月 30 日
64	东吴基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加中国工商银行股份 有限公司“2021 倾心回馈”基金 定投优惠活动的公告	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 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666 / 400-821-0588。

东吴基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日