东吴新产业精选股票型证券投资基金
2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 24 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 2021 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 12

4.1 基金管理人及基金经理情况 12

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 14

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17

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 17

§5 托管人报告 18

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18

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 18

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 18

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 19

6.1 资产负债表 19

6.2 利润表 20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 21

6.4 报表附注.....22
§7 投资组合报告.....48
7.1 期末基金资产组合情况.....48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....48
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.....49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....53
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.....54
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.....54
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.....54
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.....54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....54
7.12 投资组合报告附注.....55
§8 基金份额持有人信息.....56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....56
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.....56
§9 开放式基金份额变动.....58
§10 重大事件揭示.....59
10.1 基金份额持有人大会决议.....59
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.....59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....59
10.4 基金投资策略的改变.....59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....59
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.....59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....59
10.8 其他重大事件.....61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....66

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

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴新产业精选股票型证券投资基金	
基金简称	东吴新产业精选股票	
基金主代码	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	
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	67,672,686.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	东吴新产业精选股票 A	东吴新产业精选股票 C
下属分级基金的交易代码：	580008	011470
报告期末下属分级基金的份额总额	67,624,570.80 份	48,115.27 份

2.2 基金产品说明

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。

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	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

基金级别	东吴新产业精选股票 A	东吴新产业精选股票 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	81,457,512.08	19,862.19
本期利润	22,259,909.75	24,429.47
加权平均基金份额本期利润	0.2078	0.5792
本期加权平均净值利润率	6.14%	17.16%
本期基金份额净值增长率	9.01%	5.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	107,574,797.54	132,606.22
期末可供分配基金份额利润	1.5908	2.7560
期末基金资产净值	254,166,822.48	180,721.49
期末基金份额净值	3.7585	3.7560
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	10.19%	5.61%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴新产业精选股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.50%	1.24%	2.11%	0.85%	3.39%	0.39%
过去三个月	21.42%	1.22%	9.38%	0.86%	12.04%	0.36%
过去六个月	9.01%	1.68%	5.63%	1.15%	3.38%	0.53%
自基金合同生效起至今	10.19%	1.68%	8.62%	1.15%	1.57%	0.53%

东吴新产业精选股票 C

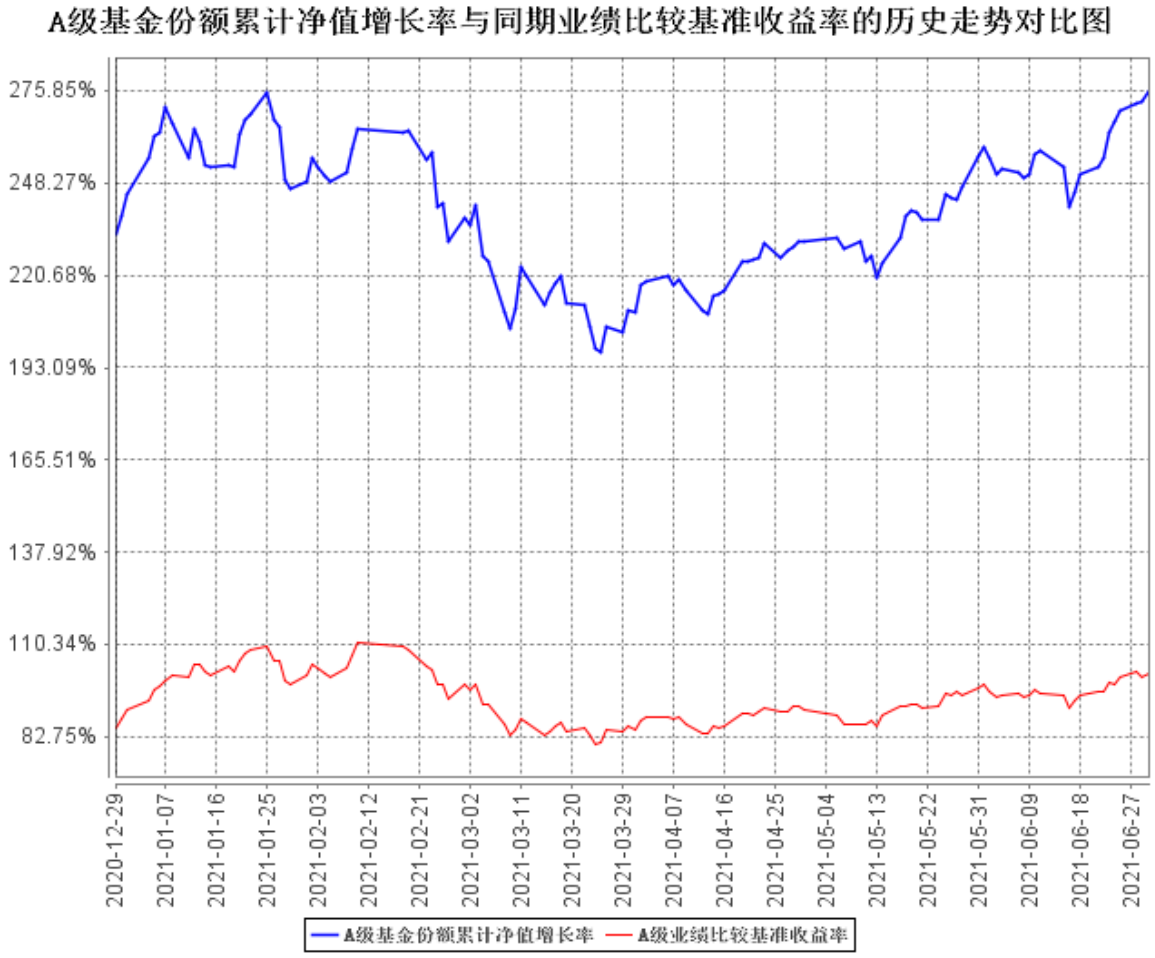
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.47%	1.24%	2.11%	0.85%	3.36%	0.39%
过去三个月	21.31%	1.22%	9.38%	0.86%	11.93%	0.36%
自基金合同生效起至今	5.61%	1.61%	0.40%	1.13%	5.21%	0.48%

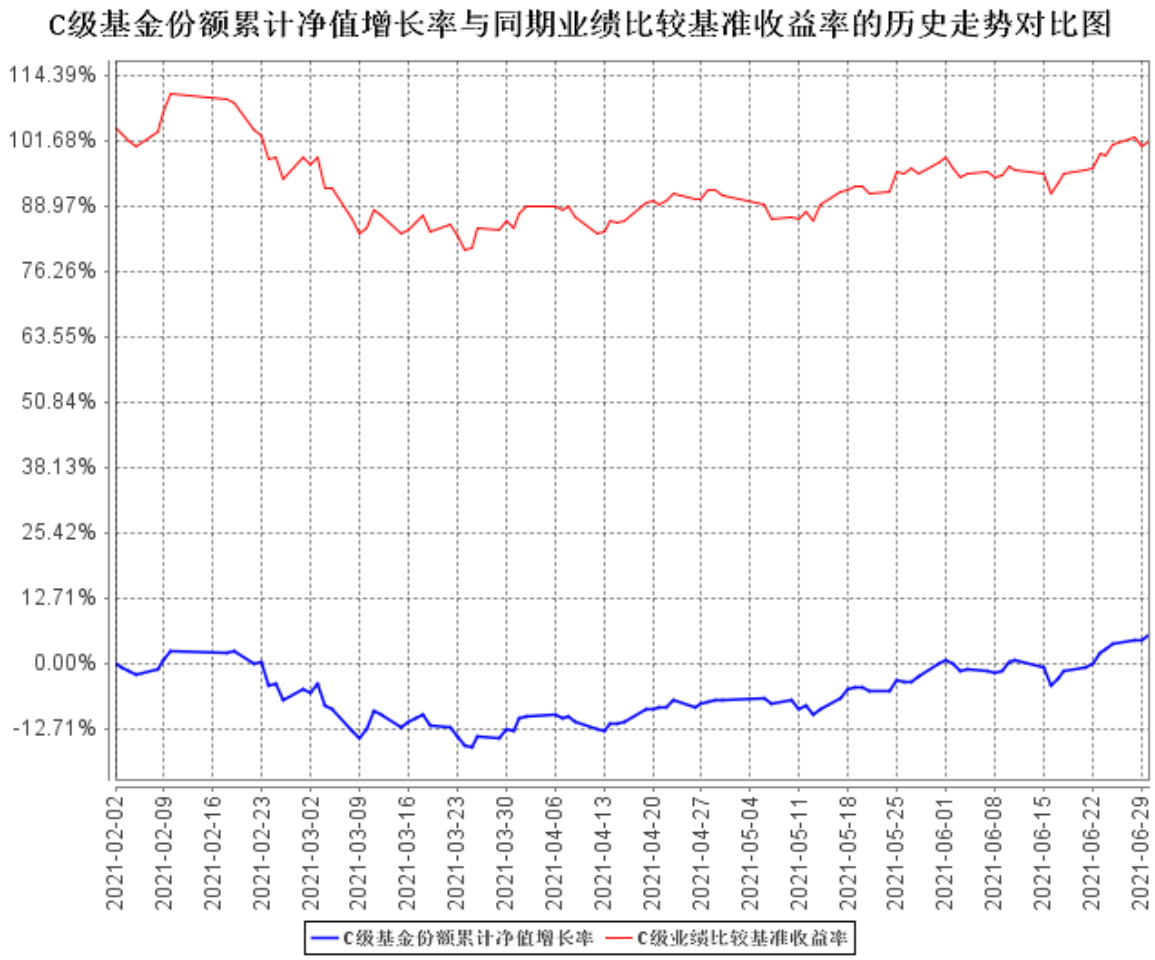
注：1.比较基准=中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%。

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）。截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

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

3.2.2 自基金转型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





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）。截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司自成立以来，始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化，追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来，在泛资管大背景下，公司积极推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展，构建了涵盖股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、REITS 等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 2021 年半年度，公司整体资产管理规模为 399.71 亿元，其中公募基金 261.93 亿元，专户业务 128.82 亿元，子公司 8.96 亿元；旗下管理着 28 只公募基金，40 只存续专户资产管理计划，12 项存续专项资产管理计划。

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		
刘瑞	基金经理	2018 年 3 月 8 日	-	8 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。

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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，开展对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，未发现投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年各宽基指数表现差异较大，表现靠后的是上证 50 和沪深 300，表现靠前的是创业板指，中证 500、中证 1000 和恒生综指表现居中。在上半年中，坚守长期稳健价值投资的新产业精选基金收益率跑赢了上述除创业板外的所有其他主要市场宽基指数，同时也跑赢了本基金的业绩比较基准。

本报告期中，我们对组合的前十大重仓进行了小幅调整，有三个股票发生了变化。持仓调整的原因如下：

1.我们仍对贵金属中长期表现持积极观点，但考虑到基金投资人短期的持有感受，我们适当调整了贵金属的总体头寸

2.我们认为高端白酒未来中长期保持中高速成长可能是大概率事件，但结合高企的估值考虑，其在我们关注股票池的排序稍向后调整，随之调降了一些仓位

3.寿险当前估值较低，在看好 A 股未来中长期行情的背景下，作为组合配置头寸值得考虑。在横向比较找到性价比更佳标的的情况下，我们出于更进取的角度，进行了仓位的置换

为了不辜负身处的这个好时代，我们时刻保持着紧迫感和危机意识，坚定执行“投资一代、储备研究一代”的战略。我们始终在努力破除、突破自己的能力圈。

通过一段时间的学习研究，我们将自己的能力圈延展到了广义的化工新材料领域，其包含石化的大炼化链条、化工基础材料、新能源材料制造、医药提纯分离材料等细分领域。基于此，我们对于化工、制造业的产业布局特征、商业模式、成长特点都有了更深刻的认识，了解其可能具备的行业认知的正外部性。

除此之外，我们还在持续关注未来比较长期看好的医疗器械、新一代创新诊疗药物和技术，争取把握住这些长期赛道，做到独立思考，有较深刻的认知。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴新产业精选股票 A 基金份额净值为 3.7585 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.01%，同期业绩比较基准收益率为 5.63%；截至本报告期末东吴新产业精选股票 C 基金份额净值为 3.7560 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，中国经济在后疫情时代开启了温和修复。从上半年经济各项数据来看，经济修复比较有韧性，整体经济并不差。经济修复的动力主要来源于出口、房地产投资、制造业投资等。出口端，2021 年上半年中国出口增长强劲，持续超出市场预期，是中国经济修复主要的驱动

力之一。2021 年下半年伴随着全球疫苗推出疫情逐步控制，全球复苏将有望继续带动我国出口修复。投资端，上半年制造业投资增速由负转正、房地产投资维持高位有韧性，投资端也为中国经济修复贡献了积极因素。由于企业盈利不断修复，叠加出口景气，制造业将有望从单纯的补库向扩产能演进，2021 年下半年制造业投资也有望继续加速。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可能有动力加快开工和销售，预计 2021 年下半年房地产投资仍有望具有韧性。消费端，我国疫情修复后国内消费也逐步复苏，但由于疫情扰动消费修复略偏缓慢，但逐步改善的趋势没有变化。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，但在出口和制造业投资的驱动下，预计 2021 年下半年真实的经济动能仍然有望具有韧性。

2021 年上半年市场对全球主要央行的货币政策存在一定的紧缩预期，尤其是国内外 PPI 同比增速持续超预期，引发了市场对工业领域通胀的密切关注。但全球主要央行将通胀均定义为暂时性通胀，不认为有长期通胀基础，并且保持短端流动性处于偏宽松的区间。2021 年 7 月 9 日，中国央行在官网公告，决定于 2021 年 7 月 15 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点（不含已执行 5%存款准备金率的金融机构）。央行全面降准这一行为显著超出市场预期，这意味着下半年对于国内市场来说流动性有望宽裕。美联储在 2021 年下半年可能会逐步考虑缩减购债规模，但考虑到中国货币政策的独立性，美国的货币政策对中国或许只能形成扰动而不会干扰中国下半年流动性稳健的整体格局。

基于自上而下的宏观经济政策和自下而上的行业景气度，就 2021 年下半年我们判断如下：A 股大势研判方面，考虑到央行全面降准一定程度上缓解了对于后续流动性收紧的后顾之忧，在流动性偏宽松的背景下积极把握做多中国权益市场的机会。但 2021 年下半年的流动性偏宽松并不是 2020 年全球的全面性流动性大宽松，因此下半年的行情更多的可能是结构性行情而非全面性行情。风格层面，预计下半年有望还是成长风格更优，一是本轮成长股的高景气度有望持续。以成长性的新能车行业为例，在市场自发需求的驱动下，2021 年下半年到 2022 年包括中欧美在内的全球主要市场需求都有望会比较旺盛。二是央行全面降准意味着流动性偏宽松预期，本轮成长股在流动性推动下有望继续演绎“戴维斯双击”。

站在中长期维度，我们对 A 股持比较积极的观点，这与过去三年我们一贯的观点不变。我们认为，这一点再怎么强调都不为过。

未来中长期看：

1.从国内来讲，过去二十余年，居民资产和产业链相关资产蓄水池之一的地产，作为投资资产而言，收益风险比相较之前显著下降或是大概率事件；

2.从全球范围来讲，中国不仅是确定的拥有较高增速的经济体之一，而且增长足够稳健，体

量足够大，政治、营商环境比较稳定可预期。这对海外数以万亿美金计、积累传承数百年的大钱、长钱，是有吸引力的。这些聪明钱，在过去几个世纪中，经历了“欧洲-英国-美国-日本-欧美”的流转配置，拉长时间来看，他们大概率不会错过本世纪的时代强音：中国。

或许，未来比较长一段时间，结构性成长带来的投资机会凸显是个常态，这与中国资本市场前二十五年中常见的指数涨跌有所区别，作为资本市场终身学习迭代的中生代来讲，我们需要适应它。这意味着，以短期宏观预测和简单均值回归方式指导投资的方式，可能需要进一步迭代。

往后看，我们会坚守本分，对长期难而重要的事情耐得住性子，守得住原则，识得出诱惑。继续做到：独立思考、踏实研究、不抱团赌方向、聚焦结构性成长、识别动态价值，集中长期持股。

我们欣慰地看到，时隔六年之后，新产业精选基金净值超越了其在 2015 年创下的业绩，实现了新的历史新高。这是在我们不抱团赌方向、踏实自下而上选股、耐心长期持股的情况下，历经过去几年时间实现的。

我们在这里感谢所有陪我们一路走来的持有人的耐心和信任。在未来的征程中，我们力争不辱使命，争取继续为投资者创造良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营副总经理、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、专户投资总部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主任，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。同时，基金资产估值委员会主任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，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遵规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴新产业精选股票型证券投资基金

报告截止日： 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,052,591.05	33,950,807.62
结算备付金		9,312,010.17	5,442,026.31
存出保证金		111,624.41	1,298,884.86
交易性金融资产	6.4.7.2	245,188,167.41	391,174,454.00
其中：股票投资		227,887,667.41	369,696,962.50
基金投资		-	-
债券投资		17,300,500.00	21,477,491.50
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		1,539,741.46	624,521.14
应收利息	6.4.7.5	318,307.86	188,989.81
应收股利		248,922.87	-
应收申购款		48,443.06	192,945.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		261,819,808.29	432,872,629.34
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**	**上年度末 2020 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		6,020,980.66	13,666,074.46
应付赎回款		560,330.29	808,291.46
应付管理人报酬		394,699.64	501,341.00
应付托管费		65,783.31	83,556.80
应付销售服务费		83.28	-
应付交易费用	6.4.7.7	333,746.18	268,524.38
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,640.96	229,879.79
负债合计		7,472,264.32	15,557,667.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	67,672,686.07	121,032,913.70
未分配利润	6.4.7.10	186,674,857.90	296,282,047.75
所有者权益合计		254,347,543.97	417,314,961.45
负债和所有者权益总计		261,819,808.29	432,872,629.34

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，东吴新产业精选股票 A 基金份额净值 3.7585 元，基金份额总额 67,624,570.80 份；东吴新产业精选股票 C 基金份额净值 3.7560 元，基金份额总额 48,115.27 份。东吴新产业精选股票份额总额合计为 67,672,686.07 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴新产业精选股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		27,360,309.49
1.利息收入		234,045.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	52,648.37
债券利息收入		181,397.05
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）		86,276,734.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	84,311,200.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	142,514.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
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	1,823,019.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-59,193,035.05
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	42,564.76
减：二、费用		5,075,970.27

1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,717,261.44
2．托管费	6.4.10.2.2	452,876.95
3．销售服务费	6.4.10.2.3	224.11
4．交易费用	6.4.7.18	1,802,476.27
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	6.4.7.19	103,131.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,284,339.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,284,339.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新产业精选股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	121,032,913.70	296,282,047.75	417,314,961.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,284,339.22	22,284,339.22
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）	-53,360,227.63	-131,891,529.07	-185,251,756.70
其中：1.基金申购款	18,198,375.01	40,658,641.11	58,857,016.12
2.基金赎回款	-71,558,602.64	-172,550,170.18	-244,108,772.82
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）	67,672,686.07	186,674,857.90	254,347,543.97

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	骆银
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴新产业精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由东吴新产业精选混合型证券投资基金转型而来，原东吴新产业精选混合型证券投资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[2011]1021 号《关于同意东吴新产业精选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 2011 年 9 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 281,594,106.37 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“东吴新产业精选股票型证券投资基金”更名为“东吴新产业精选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”。

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了基金份额持有人大会，基金份额持有人大会审议了《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》，内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、投资组合比例并相应变更基金名称、基金类别，变更基金份额持有人大会程序、基金合同当事人权利义务、估值方法、基金费用等事项。该次基金份额持有人大会于 2020 年 12 月 28 日表决通过了《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》，该次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《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》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》、《东吴新产业精选混合型证券投资基金托管协议》修订为《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》、《东吴新产业精选股票型证券投资基金托管协议》，并据此制作了《东吴新产业精选股票型证券投资基金招募说明书》以及基金产品资料概要。上述文件于 2020 年 12 月 29 日起生效。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括内地依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允

许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券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，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：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%。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

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

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

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

2.增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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.境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,052,591.05
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：	5,052,591.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		181,441,396.89	227,887,667.41	46,446,270.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,269,651.00	2,269,000.00	-651.00
	银行间市场	15,035,280.00	15,031,500.00	-3,780.00
	合计	17,304,931.00	17,300,500.00	-4,431.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		198,746,327.89	245,188,167.41	46,441,839.52

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,397.20
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	1,720.81
应收债券利息	315,126.80
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	63.05
合计	318,307.86

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	333,371.18
银行间市场应付交易费用	375.00
合计	333,746.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	401.11
应付证券出借违约金	-
应付审计费	32,232.48
应付信息披露费	59,507.37
应付账户维护费	4,500.00
合计	96,640.96

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴新产业精选股票 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	121,032,913.70	121,032,913.70
本期申购	18,052,932.69	18,052,932.69
本期赎回(以"-"号填列)	-71,461,275.59	-71,461,275.59
- 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	67,624,570.80	67,624,570.80

金额单位：人民币元

东吴新产业精选股票 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	145,442.32	145,442.32
本期赎回(以"-"号填列)	-97,327.05	-97,327.05
- 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	48,115.27	48,115.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东吴新产业精选股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,198,819.66	203,083,228.09	296,282,047.75
本期利润	81,457,512.08	-59,197,602.33	22,259,909.75
本期基金份额交易产生的变动数	-67,081,534.20	-64,918,171.62	-131,999,705.82
其中：基金申购款	20,754,827.19	19,557,419.38	40,312,246.57
基金赎回款	-87,836,361.39	-84,475,591.00	-172,311,952.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,574,797.54	78,967,454.14	186,542,251.68

单位：人民币元

东吴新产业精选股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	19,862.19	4,567.28	24,429.47
本期基金份额交易产生的变动数	125,544.25	-17,367.50	108,176.75
其中：基金申购款	391,099.54	-44,705.00	346,394.54
基金赎回款	-265,555.29	27,337.50	-238,217.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	145,406.44	-12,800.22	132,606.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,245.79
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	21,718.62
其他	3,683.96
合计	52,648.37

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	626,044,141.35
减：卖出股票成本总额	541,732,941.31
买卖股票差价收入	84,311,200.04

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	142,514.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	142,514.37

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,540,198.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,091,586.00
减：应收利息总额	306,098.34
买卖债券差价收入	142,514.37

6.4.7.13.3 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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,823,019.95
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	1,823,019.95

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-59,193,035.05
——股票投资	-59,138,698.55
——债券投资	-54,336.50
——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	-59,193,035.05

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	41,888.01
转换费 580008	676.75
合计	42,564.76

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,802,101.27
银行间市场交易费用	375.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,802,476.27

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	2,341.65
其他费用	50.00
合计	103,131.50

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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	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	351,363,656.34	32.56%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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 2021年1月1日至2021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	177,168.91	20.91%	59,025.77	17.71%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,717,261.44
其中：支付销售机构的客户维护费	300,668.53

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×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 5 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	452,876.95

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×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 5 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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无关联方收取销售服务费。

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未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

中国建设银行股份有限公司	5,052,591.05	27,245.79

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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
688575	亚辉龙	2021 年 5 月 10 日	2021 年 11 月 17 日	新股流通受限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-
688456	有研粉材	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 17 日	新股流通受限	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28	2021 年 7 月	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-

		日	6 日							
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	47.33	251.96	252	11,927.16	63,493.92	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	444	14,749.68	38,850.00	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	306	8,653.68	35,407.26	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰	2021 年	2021	新股流	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-

	生物	4 月 8 日	年 10 月 19 日	通受限						
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 23 日	2021 年 7 月 2 日	新股流通受限	24.60	163.00	427	10,504.20	69,601.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	990	99,000.00	99,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 2021 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 2021 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

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括内地依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券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。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。

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。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	17,201,500.00	21,476,491.50
合计	17,201,500.00	21,476,491.50

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	99,000.00	-
AAA 以下	-	1,000.00
未评级	-	-
合计	99,000.00	1,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 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。

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、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	5,052,591.05	-	-	-	-	-	5,052,591.05
结算备付金	9,312,010.17	-	-	-	-	-	9,312,010.17
存出保证金	111,624.41	-	-	-	-	-	111,624.41
交易性金融资产	2,170,000.00	-	15,031,500.00	-	99,000.00	227,887,667.41	245,188,167.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,539,741.46	1,539,741.46
应收利息	-	-	-	-	-	318,307.86	318,307.86
应收股利	-	-	-	-	-	248,922.87	248,922.87
应收申购款	-	-	-	-	-	48,443.06	48,443.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,646,225.63	-	15,031,500.00	-	99,000.00	230,043,082.66	261,819,808.29
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,020,980.66	6,020,980.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	560,330.29	560,330.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	394,699.64	394,699.64
应付托管费	-	-	-	-	-	65,783.31	65,783.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83.28	83.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	333,746.18	333,746.18
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	96,640.96	96,640.96
负债总计	-	-	-	-	-	7,472,264.32	7,472,264.32
利率敏感度缺口	16,646,225.63	-	15,031,500.00	-	99,000.00	222,570,818.34	254,347,543.97
上年度末 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	33,950,807.62	-	-	-	-	-	33,950,807.62
结算备付金	5,442,026.31	-	-	-	-	-	5,442,026.31

存出保证金	1,298,884.86	-	-	-	-	-	1,298,884.86
交易性金融资产	-	-	21,476,491.50	-	1,000.00	369,696,962.50	391,174,454.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	624,521.14	624,521.14
应收利息	-	-	-	-	-	188,989.81	188,989.81
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	192,945.60	192,945.60
资产总计	40,691,718.79	-	21,476,491.50	-	1,000.00	370,703,419.05	432,872,629.34
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,666,074.46	13,666,074.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	808,291.46	808,291.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	501,341.00	501,341.00
应付托管费	-	-	-	-	-	83,556.80	83,556.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	268,524.38	268,524.38
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	229,879.79	229,879.79
负债总计	-	-	-	-	-	15,557,667.89	15,557,667.89
利率敏感度缺口	40,691,718.79	-	21,476,491.50	-	1,000.00	355,145,751.16	417,314,961.45

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、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。		
	2、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。		
	3、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（ 2021 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31

			日 ）
	基准利率减少 25 个基点	14,704.51	23,046.48
	基准利率增加 25 个基点	-14,658.09	-22,995.98

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	68,473,474.36	-	68,473,474.36
资产合计	-	68,473,474.36	-	68,473,474.36
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	68,473,474.36	-	68,473,474.36
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,886,390.90	-	13,886,390.90
资产合计	-	13,886,390.90	-	13,886,390.90
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,886,390.90	-	13,886,390.90

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
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（ 2021 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	1.港币相对人民币贬值 1%	-807,987.00	-138,863.91
	2.港币相对人民币贬值 5%	-4,039,934.99	-694,319.55
	3.港币相对人民币贬值 10%	-8,079,869.97	-1,388,639.09

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	227,887,667.41	89.60	369,696,962.50	88.59
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	227,887,667.41	89.60	369,696,962.50	88.59

注:本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中对港股通标的股票的投资比

例不超过股票资产的 50%；本基金投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 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（ 2021 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	1. 业绩基准下跌 1%	-3,001,301.02	-12,143,865.38
	2. 业绩基准下跌 5%	-15,006,505.09	-60,719,326.89
	3. 业绩基准下跌 10%	-30,013,010.19	-121,438,653.78

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	227,887,667.41	87.04
	其中：股票	227,887,667.41	87.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,300,500.00	6.61
	其中：债券	17,300,500.00	6.61
	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	14,364,601.22	5.49
8	其他各项资产	2,267,039.66	0.87
9	合计	261,819,808.29	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	51,775.46	0.02
C	制造业	155,755,062.14	61.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	82,472.34	0.03
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	103,072.86	0.04
J	金融业	3,347,454.46	1.32
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	39,030.68	0.02

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	159,414,193.05	62.68

7.2.2 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	13,960,996.03	5.49
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	24,325,474.63	9.56
G 工业	-	-
H 信息技术	29,859,197.46	11.74
I 电信服务	-	-
J 公用事业	327,806.24	0.13
K 房地产	-	-
合计	68,473,474.36	26.92

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	601012	隆基股份	281,192	24,981,097.28	9.82
2	00853	微创医疗	419,382	24,305,020.44	9.56
3	00700	腾讯控股	41,677	20,252,301.33	7.96
4	002408	齐翔腾达	1,336,818	16,603,279.56	6.53
5	300750	宁德时代	30,400	16,257,920.00	6.39
6	01818	招金矿业	2,273,500	13,960,996.03	5.49
7	300776	帝尔激光	91,214	13,623,723.04	5.36
8	300487	蓝晓科技	147,800	12,503,880.00	4.92
9	300861	美畅股份	122,485	10,326,710.35	4.06
10	601799	星宇股份	40,987	9,251,585.64	3.64
11	600399	抚顺特钢	486,500	8,825,110.00	3.47
12	000568	泸州老窖	33,831	7,982,086.14	3.14
13	002709	天赐材料	74,700	7,961,526.00	3.13
14	600346	恒力石化	293,400	7,698,816.00	3.03
15	03690	美团－W	24,100	6,425,022.21	2.53

16	002460	赣锋锂业	44,300	5,364,287.00	2.11
17	603501	韦尔股份	16,500	5,313,000.00	2.09
18	600480	凌云股份	435,586	3,989,967.76	1.57
19	605499	东鹏饮料	15,432	3,870,345.60	1.52
20	601398	工商银行	628,800	3,250,896.00	1.28
21	00981	中芯国际	160,000	3,181,873.92	1.25
22	00371	北控水务集团	134,000	327,806.24	0.13
23	300274	阳光电源	1,000	115,060.00	0.05
24	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.04
25	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.04
26	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
27	300919	中伟股份	427	69,601.00	0.03
28	300957	贝泰妮	252	63,493.92	0.02
29	601318	中国平安	962	61,837.36	0.02
30	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
31	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
32	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
33	600988	赤峰黄金	3,454	51,775.46	0.02
34	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
35	603387	基蛋生物	2,100	47,208.00	0.02
36	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
37	300979	华利集团	444	38,850.00	0.02
38	300642	透景生命	450	38,614.50	0.02
39	300973	立高食品	306	35,407.26	0.01
40	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
41	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
42	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
43	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
44	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
45	09996	沛嘉医疗－B	680	20,454.19	0.01
46	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
47	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
48	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
49	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
50	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
51	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
52	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
53	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
54	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01

55	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
56	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
57	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
58	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
59	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
60	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
61	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
62	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
63	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
64	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
65	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
66	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
67	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
68	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
69	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
70	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
71	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
72	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
73	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
74	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
75	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
76	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
77	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
78	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
79	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
80	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
81	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
82	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
83	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
84	000030	富奥股份	780	4,968.60	0.00
85	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
86	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
87	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
88	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
89	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
90	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	00853	微创医疗	48,214,467.85	11.55
2	00700	腾讯控股	32,501,852.58	7.79
3	01787	山东黄金	22,755,524.26	5.45
4	600346	恒力石化	16,174,097.92	3.88
5	002408	齐翔腾达	14,837,277.42	3.56
6	300750	宁德时代	14,739,838.00	3.53
7	01818	招金矿业	13,774,609.79	3.30
8	300487	蓝晓科技	13,533,196.64	3.24
9	300776	帝尔激光	13,268,035.00	3.18
10	03690	美团－W	11,975,580.70	2.87
11	300861	美畅股份	10,536,850.60	2.52
12	02899	紫金矿业	10,122,050.91	2.43
13	603113	金能科技	10,084,731.26	2.42
14	601601	中国太保	10,007,878.86	2.40
15	002475	立讯精密	9,389,679.00	2.25
16	03606	福耀玻璃	9,369,627.53	2.25
17	002709	天赐材料	8,592,239.00	2.06
18	002812	恩捷股份	8,519,689.00	2.04
19	01478	丘钛科技	8,260,837.53	1.98
20	00175	吉利汽车	8,256,702.26	1.98

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	00853	微创医疗	37,079,951.98	8.89
2	600547	山东黄金	36,173,084.60	8.67
3	000568	泸州老窖	35,062,033.90	8.40
4	601012	隆基股份	32,811,844.30	7.86

5	601318	中国平安	32,295,834.00	7.74
6	000030	富奥股份	27,044,882.17	6.48
7	601601	中国太保	25,578,437.00	6.13
8	600988	赤峰黄金	18,992,379.38	4.55
9	01787	山东黄金	17,789,367.40	4.26
10	002497	雅化集团	16,961,463.44	4.06
11	300274	阳光电源	16,860,033.00	4.04
12	002142	宁波银行	15,367,017.09	3.68
13	601799	星宇股份	12,224,554.70	2.93
14	002126	银轮股份	11,823,959.61	2.83
15	000725	京东方 A	11,389,396.00	2.73
16	600030	中信证券	11,384,408.00	2.73
17	02899	紫金矿业	10,490,755.01	2.51
18	300769	德方纳米	10,418,661.00	2.50
19	002459	晶澳科技	10,272,868.00	2.46
20	600438	通威股份	10,189,693.84	2.44
21	603113	金能科技	9,150,571.00	2.19
22	002709	天赐材料	8,863,098.40	2.12
23	00700	腾讯控股	8,794,747.19	2.11
24	03606	福耀玻璃	8,778,602.79	2.10
25	002475	立讯精密	8,663,583.38	2.08
26	00883	中国海洋石油	8,433,408.59	2.02
27	002812	恩捷股份	8,418,494.43	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	459,062,344.77
卖出股票收入（成交）总额	626,044,141.35

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,170,000.00	0.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,031,500.00	5.91

	其中：政策性金融债	15,031,500.00	5.91
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）	99,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,300,500.00	6.80

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200314	20 进出 14	150,000	15,031,500.00	5.91
2	019640	20 国债 10	21,700	2,170,000.00	0.85
3	113050	南银转债	990	99,000.00	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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	111,624.41
2	应收证券清算款	1,539,741.46
3	应收股利	248,922.87
4	应收利息	318,307.86
5	应收申购款	48,443.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,267,039.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东吴新产业精选股票 A	4,291	15,759.63	44,444,433.02	65.72%	23,180,137.78	34.28%
东吴新产业精选股票 C	291	165.34	0.00	0.00%	48,115.27	100.00%
合计	4,582	14,769.25	44,444,433.02	65.68%	23,228,253.05	34.32%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴新产业精选股票 A	360,873.32	0.5336%
	东吴新产业精选股票 C	2.81	0.0058%
	合计	360,876.13	0.5333%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东吴新产业精选股票 A	-
	东吴新产业精选股票 C	-

	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴新产业精选股票 A	10~50
	东吴新产业精选股票 C	-
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴新产业精选股票 A	东吴新产业精选股票 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 29 日）基金份额总额	121,192,577.92	-
本报告期期初基金份额总额	121,032,913.70	-
本报告期基金总申购份额	18,052,932.69	145,442.32
减:本报告期基金总赎回份额	71,461,275.59	97,327.05
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	67,624,570.80	48,115.27

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

本报告期内管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的管理人、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	
东吴证券	2	351,363,656.34	32.56%	177,168.91	20.91%	-
兴业证券	1	169,153,110.77	15.67%	157,532.75	18.59%	-
海通证券	2	136,984,112.03	12.69%	124,834.10	14.73%	-
光大证券	1	129,826,756.17	12.03%	118,310.70	13.96%	-
东方证券	1	128,918,024.20	11.95%	120,062.72	14.17%	-
招商证券	1	59,918,991.14	5.55%	54,604.28	6.44%	-
国泰君安	2	56,142,388.56	5.20%	51,162.61	6.04%	-
广发证券	1	46,893,838.95	4.35%	43,672.30	5.15%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	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

本基金本报告期退租 1 个交易单元，为银河证券的交易单元。

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
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	458,549.60	4.88%	-	-	-	-
海通证券	988.80	0.01%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	8,942,944.50	95.08%	-	-	-	-
招商证券	1,090.09	0.01%	-	-	-	-
国泰君安	2,568.00	0.03%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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 2020 年年度资产净值公告	公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 6 日
3	东吴基金管理有限公司关于参加平安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	2021 年 1 月 8 日
4	东吴基金管理有限公司关于参加华宝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	2021 年 1 月 12 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 15 日
6	东吴基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	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	2021 年 1 月 20 日
7	东吴基金管理有限公司旗下基金 2020 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 21 日
8	东吴新产业精选股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 22 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 23 日
10	东吴基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2021 年 1 月 26 日

	旗下部分基金开通在北京植信基金销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在华瑞保险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	2021 年 1 月 26 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在湘财证券股份有限公司等代销机构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	2021 年 1 月 26 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金海九州基金销售有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 27 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在光大证券股份有限公司的定期定额业务的公告	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	2021 年 1 月 27 日
15	东吴基金管理有限公司关于东吴新产业精选股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 1 日
16	东吴新产业精选股票型证券投资基金托管协议	公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 1 日
17	东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同	公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 1 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构、部分代销机构开通转换业务的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 3 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴新产业精选股票型证券投资基金 C 类基金份额新增代销机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 3 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下新产业精选股票型证券	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 3 日

	投资基金 C 类基金份额净值和份额累计净值计算与披露方法的说明公告		
21	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 3 日
22	东吴新产业精选股票型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 4 日
23	东吴基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	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	2021 年 2 月 5 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 26 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金新增民生证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 2 日
26	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券有限责任公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 4 日
27	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增弘业期货股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 10 日
28	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东方财富证券股份有限公司的定期定额业务的公告	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	2021 年 3 月 17 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 23 日

30	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2020 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	2021 年 3 月 31 日
31	东吴新产业精选股票型证券投资基金 2020 年年度报告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 31 日
32	东吴基金管理有限公司关于暂停中民财富基金销售（上海）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	2021 年 4 月 1 日
33	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 2 日
34	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 2 日
35	东吴基金管理有限公司关于暂停上海汇付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	2021 年 4 月 10 日
36	东吴基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司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	2021 年 4 月 19 日
37	东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 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	2021 年 4 月 21 日
38	东吴新产业精选股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 21 日
39	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 5 月 27 日
40	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并	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	2021 年 6 月 11 日

	参加费率优惠的公告		
41	东吴基金管理有限公司关于恢复使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	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	2021 年 6 月 16 日
42	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台恢复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	2021 年 6 月 16 日
43	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 19 日
44	东吴基金关于在公司直销开展赎回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	2021 年 6 月 25 日
45	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示	公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 25 日
46	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	2021 年 6 月 30 日
47	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在深圳市金海九州基金销售有限公司的定期定额业务的公告	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	2021 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210101 - 20210311	25,347,835.87	0.00	25,347,835.87	0.00	0.00%
	2	20210310 - 20210630	16,618,693.08	7,084,244.57	0.00	23,702,937.65	35.03%
	3	20210507 - 20210627	20,000,000.00	0.00	8,188,000.00	11,812,000.00	17.45%
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。

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。

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

2021 年 8 月 27 日