

东吴兴享成长混合型证券投资基金

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：兴业银行股份有限公司

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。

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

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	52
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴兴享成长混合型证券投资基金	
基金简称	东吴兴享成长混合	
基金主代码	010330	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 11 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,658,509,490.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴兴享成长混合 A	东吴兴享成长混合 C
下属分级基金的交易代码:	010330	011462
报告期末下属分级基金的份额总额	1,617,196,976.85 份	41,312,513.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注企业的成长性，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金将通过深入研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对各类资产风险收益特征进行深入分析，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行动态调整，以期达到风险和收益的优化平衡。 （二）股票投资策略 1、行业配置策略 本基金将自上而下地进行行业遴选，根据宏观经济运行特征、经济景气周期以及行业周期轮动特征，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个维度把握不同行业的景气度变化情况和趋势，精选符合盈利趋势向好、发展前景良好、具有良好投资价值的行业进行重点配置。 2、个股选择策略 本基金通过定量和定性相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业的成长空间及基本面进行综合的研判，精选具有较高成长预期的优质成长型上市公司。 3、港股通标的股票投资策略 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有相对优势的上市公司纳入本基金的股票投资组合。 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。 （三）债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳

	健的投资收益。 （四）资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值。 （五）股指期货投资策略 本基金将以股指期货为主的金融衍生工具与资产配置策略进行搭配，以套期保值为主要目的，并利用股指期货灵活快速进出的优势，控制仓位风险，同时可以降低交易成本，为实际的投资操作提供多一项选择。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	林兴盛
	联系电话	021-50509888-8308	021-52629999-213707
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	zhengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95561
传真		021-50509888-8211	021-62159217
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		邓晖	高建平

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴兴享成长混合 A	东吴兴享成长混合 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	291,394.85	971,023.60
本期利润	204,153,090.74	5,363,736.42
加权平均基金份额本期利润	0.0756	0.2653
本期加权平均净值利润率	7.44%	25.63%
本期基金份额净值增长率	9.43%	6.02%
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	22,555,447.51	2,356,449.36
期末可供分配基金份额利润	0.0139	0.0570
期末基金资产净值	1,811,544,475.96	46,193,618.74
期末基金份额净值	1.1202	1.1182
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	12.02%	6.02%

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

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

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

4、本基金于 2021 年 2 月 10 日开始分为 A、C 两类。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴兴享成长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.64%	1.14%	0.70%	0.55%	1.94%	0.59%
过去三个月	16.14%	1.05%	6.45%	0.53%	9.69%	0.52%
过去六个月	9.43%	1.02%	5.57%	0.77%	3.86%	0.25%
自基金合同生效起至今	12.02%	0.90%	6.93%	0.76%	5.09%	0.14%

东吴兴享成长混合 C

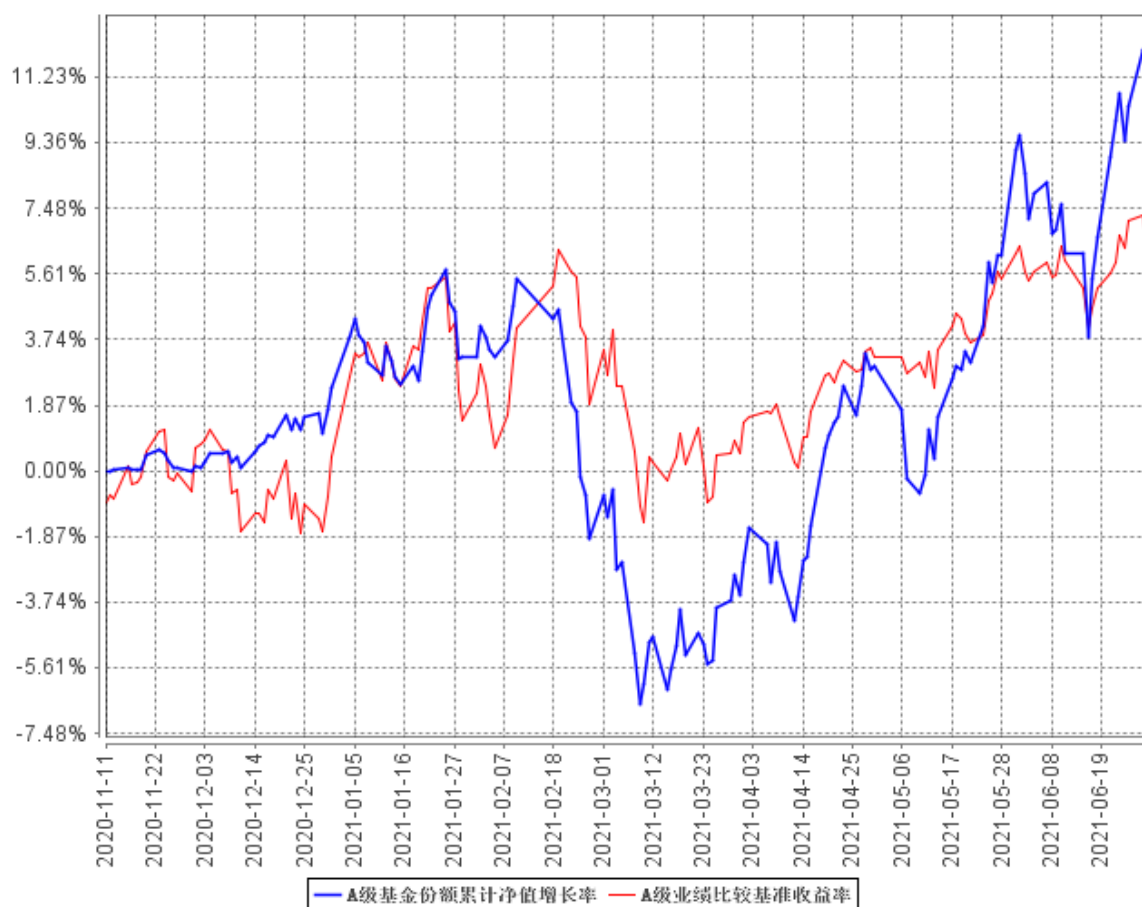
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.61%	1.14%	0.70%	0.55%	1.91%	0.59%
过去三个月	16.02%	1.05%	6.45%	0.53%	9.57%	0.52%
自基金合同生效起至今	6.02%	1.11%	3.72%	0.74%	2.30%	0.37%

注：1. 比较基准=中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）收益率×20%。

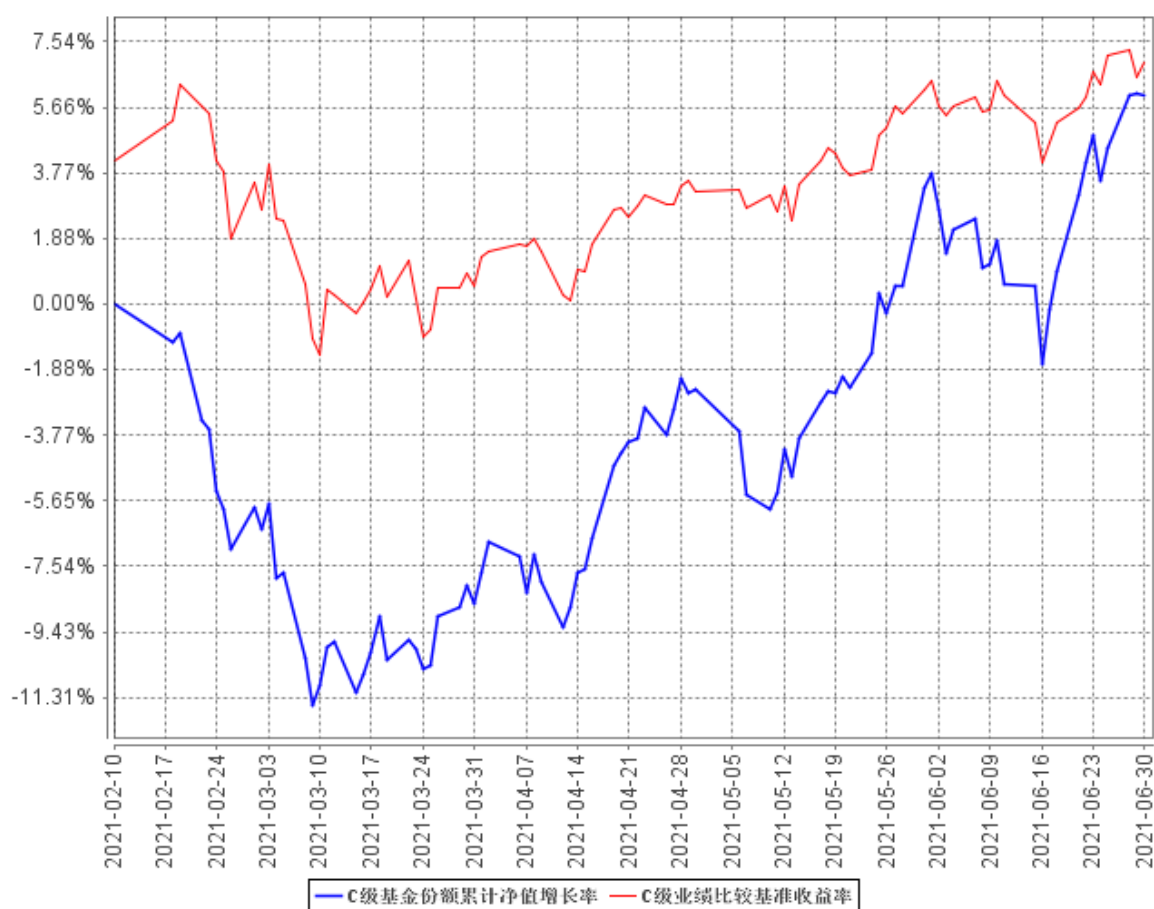
2. 本基金于 2021 年 2 月 10 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 比较基准=中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）收益率×20%。

2. 本基金于 2020 年 11 月 11 日成立。

3. 本基金于 2021 年 2 月 10 日开始分为 A、C 两类。

§ 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		
陈军	常务副总经理、基金经理	2020 年 11 月 11 日	-	22 年	陈军先生, 中国国籍, 上海交通大学工商管理硕士, 美国伊利诺伊大学香槟分校金融学硕士, 具备证券投资基金从业资格。曾任职中国出口商品基地建设金桥公司项目经理; 中信证券资产管理部投资经理; 中银基金管理有限公司研究员、基金经理、助理执行总裁、副执行总裁（分管投研）, 自 2020 年 6 月 1 日起加入东吴基金管理有限公司, 现任东吴基金管理有限公司常务副总经理、基金经理。2020 年 11 月 11 日至今担任东

					吴兴享成长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，通过投资交易系统内的公平交易模块，尽可能确保公平对待各投资组合，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，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

经历过春节前后的大幅震荡之后，市场机会开始呈现从茅指数扩散到优质赛道中小盘公司以及没有太多筹码压力的次新股的趋势。机会把握越来越需要长远的眼光，深度的研究和适度的交易。

美国经济复苏并不牢固，就如大病之后体质仍弱，虽然货币政策很可能马上退出，但是 FED

还是比较鸽派。中国最早走出疫情，但消费复苏不强，政策仍将以稳为主。因此，资本市场总体震荡，需找结构性机会。

本基金坚持，在长期景气赛道中寻找优质公司，并力争以合理的价格购买成长。

汽车电动化智能化是中国汽车产业百年一遇的大机会，各个细分赛道都可能有机会。目前而言，本基金更看好有国际供货能力，在电动或智能化中收入比重高，估值偏低的核心汽车零部件企业。

光伏已经进入平价时代，下半年也将有望进入旺季。本基金将长期关注因技术迭代而不断受益的设备公司，尤其是光伏产业链上有核心竞争力的公司。

随着人口老龄化和医药产业不断升级需求，医疗服务行业将有望不断获得成长机会。虽然这些公司估值比较贵，但是这是不断累积品牌，累积技术，累积客户的赛道，空间较大而龙头市占率较小的赛道。

积极看好新消费，新时代人群的爱美、偷懒、缺爱都有望会带来新机会。

因为市场偏震荡，即使优质公司股价有时也会大幅波动，本基金积极根据市场情况，调整布局，以期获得超额收益机会。

展望下半年，经济增速将可能缓慢下移。中美关系也许再也回不到过去。投资机会更多可能要在存量中找增量，创新是永远的主题。所以，成长的机会更看重新产品，新技术，新生代和新领域。

感谢兴享成长基金持有人的信任，本基金管理人将继续为大家做好服务。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴兴享成长混合 A 基金份额净值为 1.1202 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.43%；同期业绩比较基准收益率为 5.57%；截至本报告期末东吴兴享成长混合 C 基金份额净值为 1.1182 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.02%；同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

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。以成长性的新能源车行业为例，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可能会比较旺盛。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”。2021 年下半年我们将继续沿着高景气主线，在科技成长、消费成长和价值成长三大领域，持续挖掘业绩增速与估值相对匹配的公司作为重点关注对象。从行业投资机会看，2021 年下半年相对看好新能源车、新能源、TMT、军工、医药和食品饮料等领域。

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

本基金本报告期末进行利润分配。

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合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：东吴兴享成长混合型证券投资基金

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	13,708,777.28	646,378,304.25
结算备付金		25,707,828.68	44,802,570.57
存出保证金		914,033.78	1,341,449.53
交易性金融资产	6.4.7.2	1,658,007,322.42	1,461,706,697.35
其中：股票投资		1,450,773,222.42	1,250,253,184.35
基金投资		-	-
债券投资		207,234,100.00	211,453,513.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	130,600,000.00	1,296,000,000.00
应收证券清算款		99,907,003.02	24,736,838.16
应收利息	6.4.7.5	4,301,083.81	5,245,902.37
应收股利		-	-
应收申购款		629,070.63	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,933,775,119.62	3,480,211,762.23
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		10,129,777.88	10,677,263.05
应付赎回款		60,339,654.41	-
应付管理人报酬		2,541,588.67	4,331,353.21
应付托管费		423,598.10	721,892.21
应付销售服务费		12,637.38	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,469,701.95	1,450,768.20
应交税费		3.77	3,567.94

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	120,062.76	111,033.85
负债合计		76,037,024.92	17,295,878.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,658,509,490.38	3,382,594,365.11
未分配利润	6.4.7.10	199,228,604.32	80,321,518.66
所有者权益合计		1,857,738,094.70	3,462,915,883.77
负债和所有者权益总计		1,933,775,119.62	3,480,211,762.23

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，东吴兴享成长混合 A 基金份额净值 1.1202 元，基金份额总额 1,617,196,976.85 份；东吴兴享成长混合 C 基金份额净值 1.1182 元，基金份额总额 41,312,513.53 份。东吴兴享成长混合份额总额合计为 1,658,509,490.38 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴兴享成长混合型证券投资基金

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		242,156,796.13
1.利息收入		13,656,312.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,201,911.83
债券利息收入		2,466,838.88
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		7,987,561.54
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,859,898.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,077,951.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,996,701.16
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
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	5,785,246.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	208,254,408.71
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	2,386,176.50
减：二、费用		32,639,968.97

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,748,233.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,458,038.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,822.39
4. 交易费用	6.4.7.18	8,274,901.00
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3.59
7. 其他费用	6.4.7.19	127,969.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		209,516,827.16
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		209,516,827.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴兴享成长混合型证券投资基金

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）	3,382,594,365.11	80,321,518.66	3,462,915,883.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	209,516,827.16	209,516,827.16
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）	-1,724,084,874.73	-90,609,741.50	-1,814,694,616.23
其中：1.基金申购款	136,900,783.81	-1,272,604.32	135,628,179.49
2.基金赎回款	-1,860,985,658.54	-89,337,137.18	-1,950,322,795.72
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）	1,658,509,490.38	199,228,604.32	1,857,738,094.70

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：

<u>邓晖</u>	<u>徐明</u>	<u>骆银</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴兴享成长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”）证监基金字[2020]2239 号《关于同意东吴兴享成长混合型证券投资基金注册的批复》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 2020 年 11 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 3,382,594,365.11 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货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）。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）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 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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期自 2021 年 1 月 31 日起至 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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和债券投资等；

(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。

6.4.4.4 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、债券等，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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后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；

- 3、每一基金份额享有同等分配权；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

收个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	13,708,777.28
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：	13,708,777.28

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		1,172,756,465.06	1,450,773,222.42	278,016,757.36
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	106,817,127.60	107,069,100.00	251,972.40
	银行间市场	100,049,620.00	100,165,000.00	115,380.00
	合计	206,866,747.60	207,234,100.00	367,352.40
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—

其他	-	-	-
合计	1,379,623,212.66	1,658,007,322.42	278,384,109.76

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	130,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	130,600,000.00	-

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	2,788.44
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	11,467.36
应收债券利息	4,280,759.72
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,591.41
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	476.88
合计	4,301,083.81

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	2,469,701.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,469,701.95

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	1,362.19
应付证券出借违约金	-
应付账户维护费	9,000.00
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	50,193.20
合计	120,062.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴兴享成长混合 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	3,382,594,365.11	3,382,594,365.11
本期申购	95,306,138.79	95,306,138.79
本期赎回(以“-”号填列)	-1,860,703,527.05	-1,860,703,527.05
— 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	1,617,196,976.85	1,617,196,976.85

金额单位：人民币元

东吴兴享成长混合 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	41,594,645.02	41,594,645.02
本期赎回(以“-”号填列)	-282,131.49	-282,131.49
- 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	41,312,513.53	41,312,513.53

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

东吴兴享成长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,191,817.61	70,129,701.05	80,321,518.66
本期利润	291,394.85	203,861,695.89	204,153,090.74
本期基金份额交易产生的变动数	12,072,235.05	-102,199,345.34	-90,127,110.29
其中：基金申购款	-971,884.37	170,763.99	-801,120.38
基金赎回款	13,044,119.42	-102,370,109.33	-89,325,989.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,555,447.51	171,792,051.60	194,347,499.11

单位：人民币元

东吴兴享成长混合 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	971,023.60	4,392,712.82	5,363,736.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,385,425.76	-1,868,056.97	-482,631.21
其中：基金申购款	1,392,801.55	-1,864,285.49	-471,483.94
基金赎回款	-7,375.79	-3,771.48	-11,147.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,356,449.36	2,524,655.85	4,881,105.21

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	151,741.68
定期存款利息收入	2,688,000.00
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	350,155.63
其他	12,014.52
合计	3,201,911.83

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	2,690,564,477.77
减：卖出股票成本总额	2,681,486,526.69
买卖股票差价收入	9,077,951.08

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	2,996,701.16
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	2,996,701.16

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	8,092,275.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,090,765.03
减：应收利息总额	4,809.41
买卖债券差价收入	2,996,701.16

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	5,785,246.43
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	5,785,246.43

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	208,254,408.71
——股票投资	208,612,156.68
——债券投资	-357,747.97
——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	208,254,408.71

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	2,386,124.39
转换费收入 010330	52.11
合计	2,386,176.50

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	8,274,901.00
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	8,274,901.00

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	39,159.35
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划费	9,503.04
账户维护费	19,500.00
其他费用	300.00
合计	127,969.76

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
兴业银行股份有限公司	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	1,478,668,096.43	27.66%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	1,587,200,000.00	4.12%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,100,371.64	23.59%	764,619.99	30.96%

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。

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	20,748,233.39
其中：支付销售机构的客户维护费	8,374,364.15

本基金的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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	3,458,038.84

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴兴享成长混合 A	东吴兴享成长混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	30,390.64	30,390.64
兴业银行股份有限公司	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	60.88	60.88

合计	-	30,451.52	30,451.52
----	---	-----------	-----------

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	13,708,777.28	151,741.68

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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
688677	海泰新光	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 26 日	新股限售	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688315	诺禾致源	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股限售	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
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	-
688217	睿昂基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 17 日	新股限售	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2022 年 1 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 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-

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	新股限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易	2021 年	2021	新股限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

	购	1 月 20 日	年 7 月 27 日	售						
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股限售	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股限售	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	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工	2021 年	2021	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

	修复	3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	售						
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 7 日	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股限售	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 7 日	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲	2021 年	2021	新股限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

	特材	3 月 30 日	年 10 月 11 日	售						
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	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	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注
----	----	----	----	----	----	-----	----	----	--------	----

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	值单价	(单位: 张)	成本总额		
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	老股 东配 债	100.00	100.00	12,291	1,229,100.00	1,229,100.00	-

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 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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 (含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货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)。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

基金重点关注企业的成长性, 在科学严格管理风险的前提下, 谋求基金资产的中长期稳健增值。

本基金将通过深入研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素, 对各类资产风

险收益特征进行深入分析，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行动态调整，以期达到风险和收益的优化平衡。

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	176,002,000.00	175,868,408.00
合计	176,002,000.00	175,868,408.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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	—	—
AAA 以下	1,229,100.00	5,555,105.00
未评级	30,003,000.00	30,030,000.00
合计	31,232,100.00	35,585,105.00

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、债券投资及买入返售资产等。

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	13,708,777.28	-	-	-	-	-	13,708,777.28
结算备付金	25,707,828.68	-	-	-	-	-	25,707,828.68
存出保证金	914,033.78	-	-	-	-	-	914,033.78
交易性金融资产	155,845,000.00	-	50,160,000.00	-	1,229,100.00	1,450,773,222.42	1,658,007,322.42
买入返售金融资产	130,600,000.00	-	-	-	-	-	130,600,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	99,907,003.02	99,907,003.02
应收利息	-	-	-	-	-	4,301,083.81	4,301,083.81
应收申购款	-	-	-	-	-	629,070.63	629,070.63

资产总计	326,775,639.74	-	50,160,000.00	-	1,229,100.00	1,555,610,379.88	1,933,775,119.62
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,129,777.88	10,129,777.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	60,339,654.41	60,339,654.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,541,588.67	2,541,588.67
应付托管费	-	-	-	-	-	423,598.10	423,598.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,637.38	12,637.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,469,701.95	2,469,701.95
应交税费	-	-	-	-	-	3.77	3.77
其他负债	-	-	-	-	-	120,062.76	120,062.76
负债总计	-	-	-	-	-	76,037,024.92	76,037,024.92
利率敏感度缺口	326,775,639.74	-	50,160,000.00	-	1,229,100.00	1,479,573,354.96	1,857,738,094.70
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	16,378,304.25	630,000,000.00	-	-	-	-	646,378,304.25
结算	44,802,570.57	-	-	-	-	-	44,802,570.57

备付金							
存出保证金	1,341,449.53	-	-	-	-	-	1,341,449.53
交易性金融资产	-	-211,453,513.00	-	-	-1,250,253,184.35	-	1,461,706,697.35
买入返售金融资产	1,296,000,000.00	-	-	-	-	-	1,296,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	24,736,838.16	24,736,838.16
应收利息	-	-	-	-	-	5,245,902.37	5,245,902.37
资产总计	1,358,522,324.35	630,000,000.00	211,453,513.00	-	-1,280,235,924.88	-	3,480,211,762.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,677,263.05	10,677,263.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,331,353.21	4,331,353.21
应付托管费	-	-	-	-	-	721,892.21	721,892.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,450,768.20	1,450,768.20
应交税费	-	-	-	-	-	3,567.94	3,567.94
其他负债	-	-	-	-	-	111,033.85	111,033.85
负债总计	-	-	-	-	-	17,295,878.46	17,295,878.46
利率敏感	1,358,522,324.35	630,000,000.00	211,453,513.00	-	-1,262,940,046.42	-	3,462,915,883.77

度缺 口							
---------	--	--	--	--	--	--	--

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	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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	83,651.67	400,012.17
	基准利率增加 25 个基点	-83,256.59	-397,627.35

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	-	204,928,424.06	-	204,928,424.06
资产合计	-	204,928,424.06	-	204,928,424.06
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	-	204,928,424.06	-	204,928,424.06
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	-	7,099,065.07	-	7,099,065.07
资产合计	-	7,099,065.07	-	7,099,065.07
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	-	7,099,065.07	-	7,099,065.07

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%	-2,991,954.99	-103,646.35
	2. 港币相对人民币 贬值 5%	-14,959,774.96	-518,231.75
	3. 港币相对人民币 贬值 10%	-29,919,549.91	-1,036,463.50

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	1,450,773,222.42	78.09	1,250,253,184.35	36.10
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,450,773,222.42	78.09	1,250,253,184.35	36.10

注：本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例为 60%–95%（其中投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 30%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，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	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（ 2021 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	1. 业绩基准下跌 1%	-27,122,976.18	-10,388,747.65
	2. 业绩基准下跌 5%	-135,614,880.91	-51,943,738.26
	3. 业绩基准下跌 10%	-271,229,761.83	-103,887,476.51

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	1,450,773,222.42	75.02
	其中：股票	1,450,773,222.42	75.02
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	207,234,100.00	10.72
	其中：债券	207,234,100.00	10.72
	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	130,600,000.00	6.75
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	39,416,605.96	2.04
8	其他各项资产	105,751,191.24	5.47
9	合计	1,933,775,119.62	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	—	—
C	制造业	1,020,598,218.36	54.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,477.64	0.00
J	金融业	56,342,814.84	3.03
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	91,966,766.50	4.95
N	水利、环境和公共设施管理业	2,105,438.33	0.11

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	74,670,180.00	4.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,245,844,798.36	67.06

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	-	-
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	204,928,424.06	11.03
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	204,928,424.06	11.03

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	300776	帝尔激光	963,015	143,835,920.40	7.74
2	603348	文灿股份	3,895,663	136,348,205.00	7.34
3	600315	上海家化	1,514,900	91,106,086.00	4.90
4	06826	吴海生物科技	1,060,500	84,094,706.05	4.53
5	01951	锦欣生殖	4,978,098	81,186,645.36	4.37
6	002049	紫光国微	497,220	76,666,351.80	4.13
7	603345	安井食品	301,597	76,611,669.94	4.12
8	300750	宁德时代	136,700	73,107,160.00	3.94
9	603259	药明康德	463,100	72,516,829.00	3.90
10	600763	通策医疗	156,000	64,116,000.00	3.45
11	000887	中鼎股份	4,284,692	51,759,079.36	2.79
12	603456	九洲药业	971,003	47,171,325.74	2.54
13	000001	平安银行	2,080,827	47,068,306.74	2.53
14	601012	隆基股份	521,320	46,314,068.80	2.49
15	300274	阳光电源	346,100	39,822,266.00	2.14

16	601689	拓普集团	998,300	37,366,369.00	2.01
17	002906	华阳集团	942,400	29,760,992.00	1.60
18	603915	国茂股份	717,000	28,321,500.00	1.52
19	603566	普莱柯	1,199,887	27,357,423.60	1.47
20	300390	天华超净	565,800	27,175,374.00	1.46
21	02269	药明生物	225,500	26,700,323.89	1.44
22	600519	贵州茅台	9,629	19,803,964.30	1.07
23	603127	昭衍新药	105,850	19,449,937.50	1.05
24	603678	火炬电子	287,900	19,433,250.00	1.05
25	002891	中宠股份	337,345	13,831,145.00	0.74
26	605499	东鹏饮料	52,432	13,149,945.60	0.71
27	01521	方达控股	1,886,000	12,946,748.76	0.70
28	300347	泰格医药	54,600	10,554,180.00	0.57
29	002142	宁波银行	237,100	9,239,787.00	0.50
30	002812	恩捷股份	37,100	8,685,110.00	0.47
31	300724	捷佳伟创	36,000	4,176,360.00	0.22
32	002371	北方华创	12,700	3,522,726.00	0.19
33	300014	亿纬锂能	19,900	2,068,207.00	0.11
34	000967	盈峰环境	300,000	2,061,000.00	0.11
35	003031	中瓷电子	34,100	1,865,270.00	0.10
36	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
37	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.01
38	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
39	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
40	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
41	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
42	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
43	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
44	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
45	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
46	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
47	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
48	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
49	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
50	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
51	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
52	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
53	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
54	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00

55	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
56	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
57	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
58	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
59	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
60	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
61	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
62	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
63	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
64	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
65	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
66	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
67	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
68	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
69	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
70	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
71	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
72	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
73	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
74	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
75	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
76	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
77	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
78	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
79	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
80	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
81	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
82	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
83	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
84	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
85	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
86	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
87	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
88	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
89	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
90	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
91	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
92	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
93	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00

94	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
95	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
96	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	600315	上海家化	90,932,853.78	2.63
2	300274	阳光电源	83,073,724.36	2.40
3	01951	锦欣生殖	80,096,559.34	2.31
4	000887	中鼎股份	71,866,621.56	2.08
5	002142	宁波银行	70,532,028.00	2.04
6	06826	昊海生物科技	67,693,969.89	1.95
7	000661	长春高新	67,632,209.43	1.95
8	603456	九洲药业	64,554,542.22	1.86
9	601689	拓普集团	63,961,128.04	1.85
10	000001	平安银行	62,474,099.80	1.80
11	300776	帝尔激光	62,167,021.92	1.80
12	603348	文灿股份	59,947,281.00	1.73
13	603345	安井食品	57,276,214.14	1.65
14	000568	泸州老窖	57,233,841.48	1.65
15	002049	紫光国微	56,498,856.18	1.63
16	000860	顺鑫农业	49,943,948.95	1.44
17	603369	今世缘	49,244,597.01	1.42
18	000799	酒鬼酒	48,792,901.00	1.41
19	601012	隆基股份	48,090,253.51	1.39
20	06862	海底捞	46,529,893.78	1.34

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	000887	中鼎股份	88,727,917.12	2.56
2	000860	顺鑫农业	78,150,721.54	2.26
3	603369	今世缘	75,812,956.41	2.19
4	002142	宁波银行	74,186,859.20	2.14

5	600519	贵州茅台	73,975,579.00	2.14
6	603589	口子窖	73,886,929.07	2.13
7	000858	五粮液	72,254,127.64	2.09
8	000799	酒鬼酒	71,943,099.90	2.08
9	000661	长春高新	66,602,851.64	1.92
10	000568	泸州老窖	62,279,205.95	1.80
11	600660	福耀玻璃	59,457,132.09	1.72
12	000988	华工科技	53,620,550.09	1.55
13	300009	安科生物	50,661,100.72	1.46
14	300760	迈瑞医疗	47,852,866.30	1.38
15	300274	阳光电源	45,226,245.37	1.31
16	688567	孚能科技	41,227,507.03	1.19
17	300750	宁德时代	38,209,392.00	1.10
18	06862	海底捞	37,990,820.31	1.10
19	603456	九洲药业	37,403,703.44	1.08
20	601138	工业富联	37,239,840.36	1.08

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	2,673,394,408.08
卖出股票收入（成交）总额	2,690,564,477.77

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	206,005,000.00	11.09
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	1,229,100.00	0.07
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	207,234,100.00	11.16

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	019640	20 国债 10	1,058,400	105,840,000.00	5.70
2	200015	20 付息国债 15	500,000	50,160,000.00	2.70
3	190009	19 付息国债 09	300,000	30,003,000.00	1.62
4	200010	20 付息国债 10	200,000	20,002,000.00	1.08
5	127038	国微转债	12,291	1,229,100.00	0.07

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	914,033.78
2	应收证券清算款	99,907,003.02
3	应收股利	—
4	应收利息	4,301,083.81
5	应收申购款	629,070.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	105,751,191.24

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 兴 享 成 长 混合 A	24,025	67,313.09	66,015,405.89	4.08%	1,551,181,570.96	95.92%
东 吴 兴 享 成 长 混合 C	419	98,597.88	40,504,572.45	98.04%	807,941.08	1.96%
合计	24,444	67,849.35	106,519,978.34	6.42%	1,551,989,512.04	93.58%

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	东吴兴享成 长混合 A	9,261,469.62	0.5727%
	东吴兴享成 长混合 C	18.96	0.0000%
	合计	9,261,488.58	0.5584%

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	东吴兴享成长混合 A	>100
	东吴兴享成长混合 C	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开 放式基金	东吴兴享成长混合 A	>100
	东吴兴享成长混合 C	—
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴兴享成长混 合 A	东吴兴享成长混 合 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 11 日）基金 份额总额	3,382,594,365.11	—
本报告期期初基金份额总额	3,382,594,365.11	—
本报告期基金总申购份额	95,306,138.79	41,594,645.02
减：本报告期基金总赎回份额	1,860,703,527.05	282,131.49
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	1,617,196,976.85	41,312,513.53

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

3、本基金于 2021 年 2 月 10 日开始分为 A、C 两类。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内管理人、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	
长江证券	2	2,149,940,630.69	40.22%	1,988,563.95	42.63%	—
东吴证券	2	1,478,668,096.43	27.66%	1,100,371.64	23.59%	—
兴业证券	1	944,807,571.12	17.67%	861,005.83	18.46%	—
招商证券	2	474,344,542.81	8.87%	439,340.50	9.42%	—
东方财富证券	2	298,099,179.54	5.58%	275,139.46	5.90%	—
华福证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—
西部证券	2	—	—	—	—	—

注：租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

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

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 3 个交易单元，分别为海通证券，华福证券，西部证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	73,843.60	100.00%	28,124,900,000.00	73.05%	-	-
东吴证券	-	-	1,587,200,000.00	4.12%	-	-
兴业证券	-	-	171,829,000.00	0.45%	-	-
招商证券	-	-	3,354,900,000.00	8.71%	-	-
东方财富证券	-	-	5,264,000,000.00	13.67%	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2021 年 1 月 8 日

	费率优惠的公告	券日报、公司网站、 中证信息网站	
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	东吴兴享成长混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、公司网站、 中证信息网站	2021 年 1 月 21 日
9	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
10	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
11	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
12	东吴基金管理有限公司关于东吴兴享成长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务并参与费率优惠的公告	中国证券报、公司网站、 中证信息网站	2021 年 2 月 5 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴兴享成长混合型证券投资基金在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公	中国证券报、公司网站、 中证信息网站	2021 年 2 月 5 日

	告		
14	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
15	东吴基金管理有限公司关于东吴兴享成长混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 9 日
16	东吴兴享成长混合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 9 日
17	东吴兴享成长混合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 9 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴兴享成长混合型证券投资基金 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	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 10 日
19	东吴兴享成长混合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 19 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴兴享成长混合型证券投资基金 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	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 23 日
21	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
22	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
23	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
24	东吴基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2021 年 3 月 23 日

	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	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
25	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
26	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
27	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
28	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
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东吴基金管理有限公司直销柜台的转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 15 日
30	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
31	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
32	东吴兴享成长混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 21 日
33	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
34	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构、开通定期定额业务并参	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 3 日

	加费率优惠的公告		
35	东吴基金管理有限公司关于参加腾安基金销售（深圳）有限公司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 8 日
36	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 11 日
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴兴享成长混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴兴享成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴兴享成长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、报告期内东吴兴享成长混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日