

东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4 管理人报告.....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§ 5 托管人报告.....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 审计报告.....	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表.....	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§ 8 投资组合报告.....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	62

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	64
§ 10 开放式基金份额变动	65
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东吴多策略混合	
基金主代码	580009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 13 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	79,347,346.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
下属分级基金的交易代码:	580009	011949
报告期末下属分级基金的份额总额	48,126,715.27 份	31,220,631.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在充分控制基金资产风险的前提下，通过积极主动的资产配置和多种策略，充分挖掘市场中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况进行研判，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，并积极参与新股申购，辅助权证及其他金融工具等投资，控制基金组合的投资风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	方圆
	联系电话	021-50509888-8308	95559
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95559
传真		021-50509888-8211	021-62701216
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	瑞明大厦 9 楼	号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	李素明	任德奇

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
本期已实现收益	8,243,638.98	5,711,361.50	-41,986,731.33	-67,290,809.43	-38,988,119.03	-79,468,632.25
本期利润	16,461,428.13	3,846,118.27	-26,241,832.37	-48,242,590.50	-53,817,069.70	-127,290,308.48
加权平均基金份额本期利润	0.3053	0.0775	-0.3783	-0.5029	-0.4831	-0.5719
本期加权平均净值利润率	17.28%	4.44%	-20.76%	-27.28%	-21.98%	-26.22%
本期基金份额净值增长率	17.67%	17.21%	-19.70%	-20.02%	-19.51%	-19.83%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
期末可供分配利润	38,951,799.20	-8,474,749.92	34,818,121.68	-19,510,171.59	142,110,819.82	21,200,593.99
期末可供分配基金份额利润	0.8094	-0.2714	0.6316	-0.4390	1.0467	0.1060
期末基金资产净值	93,079,050.44	59,440,424.75	90,609,469.21	72,198,669.09	277,879,984.30	406,229,455.73
期末基金份额净值	1.9340	1.9039	1.6436	1.6244	2.0467	2.0310
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
基金份额累计净值增长率	94.96%	22.52%	65.69%	4.53%	106.32%	30.69%

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 4 月 14 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

东吴多策略混合 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
过去三个月	-0.48%	3.09%	0.08%	0.86%	-0.56%	2.23%
过去六个月	6.24%	2.91%	8.08%	0.81%	-1.84%	2.10%
过去一年	17.67%	2.71%	9.83%	0.66%	7.84%	2.05%
过去三年	-23.94%	2.04%	-6.33%	0.58%	-17.61%	1.46%
过去五年	63.50%	2.00%	2.97%	0.61%	60.53%	1.39%
自基金合同生效起至今	94.96%	1.81%	7.35%	0.62%	87.61%	1.19%

东吴多策略混合 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
过去三个月	-0.57%	3.09%	0.08%	0.86%	-0.65%	2.23%
过去六个月	6.03%	2.91%	8.08%	0.81%	-2.05%	2.10%
过去一年	17.21%	2.71%	9.83%	0.66%	7.38%	2.05%
过去三年	-24.85%	2.04%	-6.33%	0.58%	-18.52%	1.46%
自基金合同生效起至今	22.52%	2.08%	-5.37%	0.57%	27.89%	1.51%

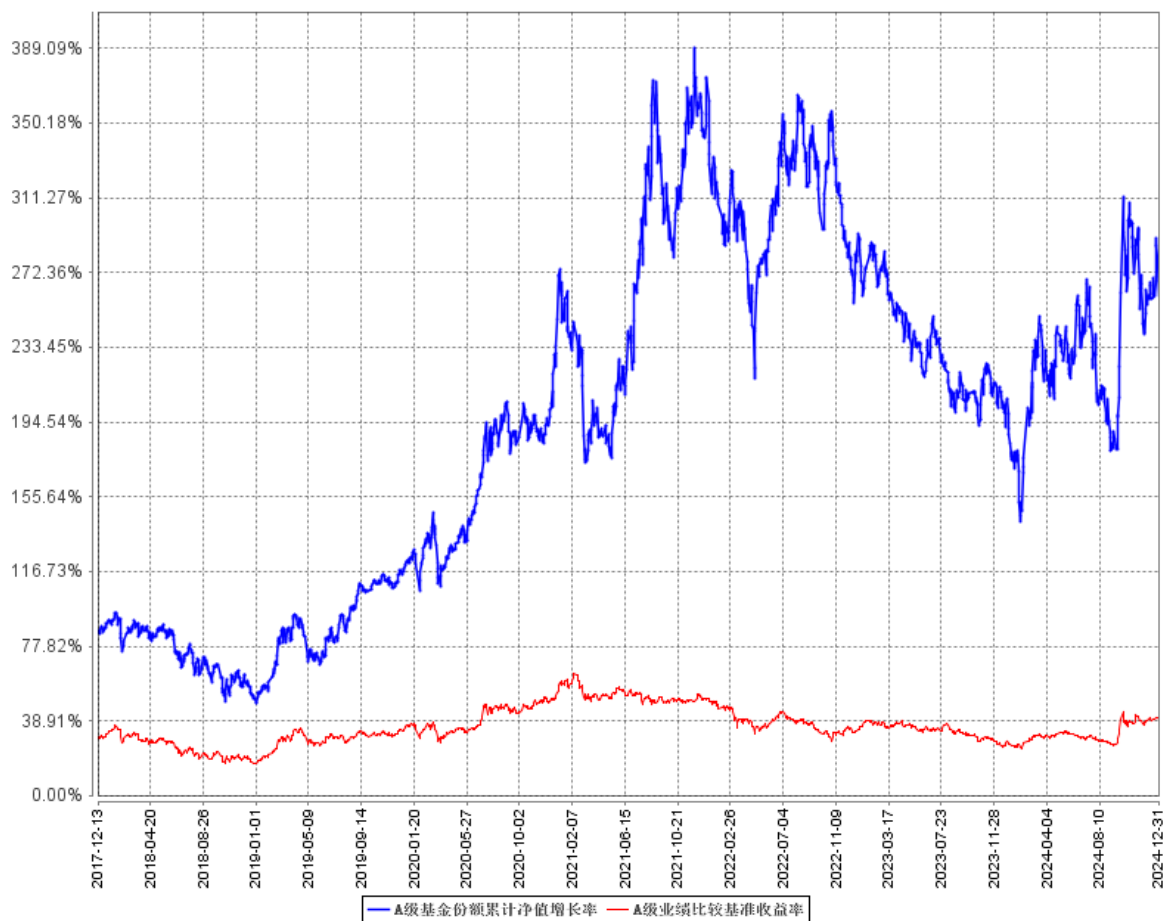
注：1、比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

2、本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日。

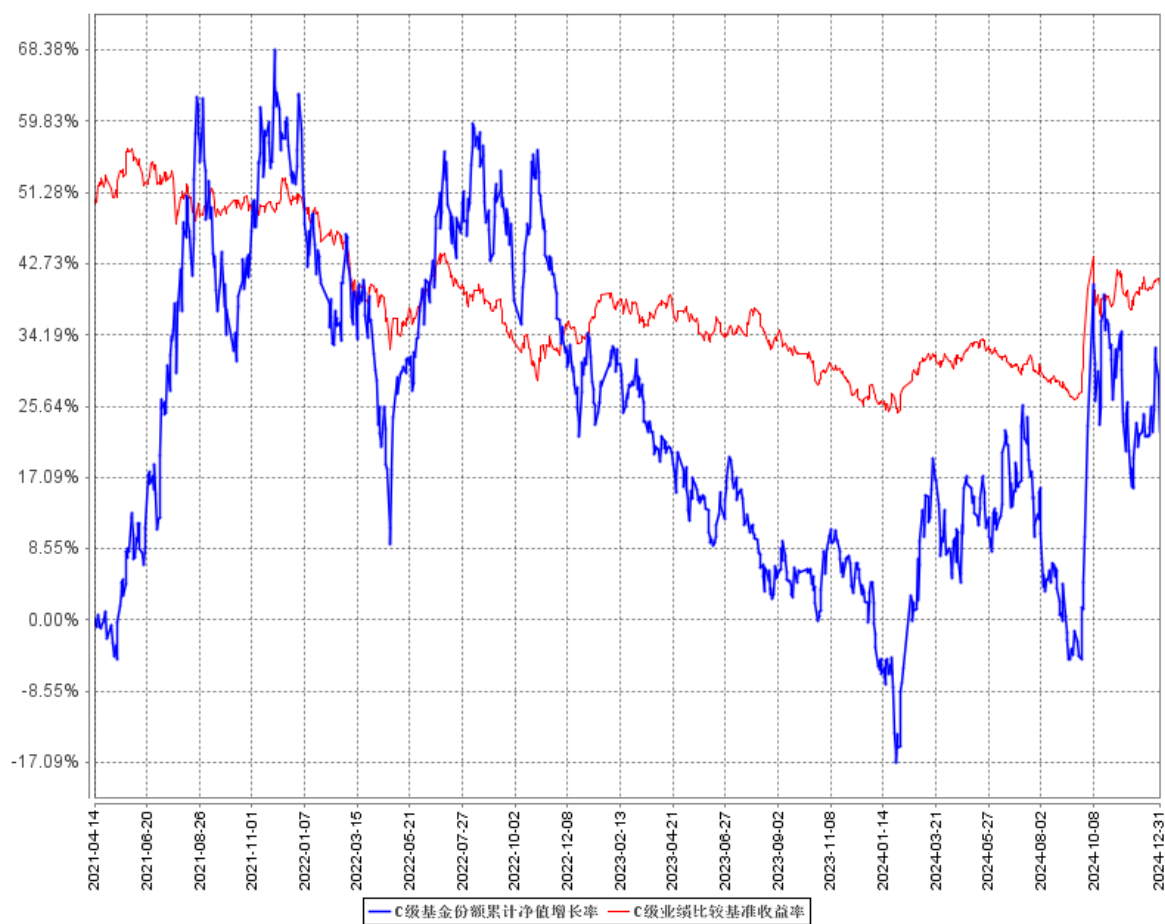
3、本基金于 2021 年 4 月 14 日开始分为 A、C 两类。

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



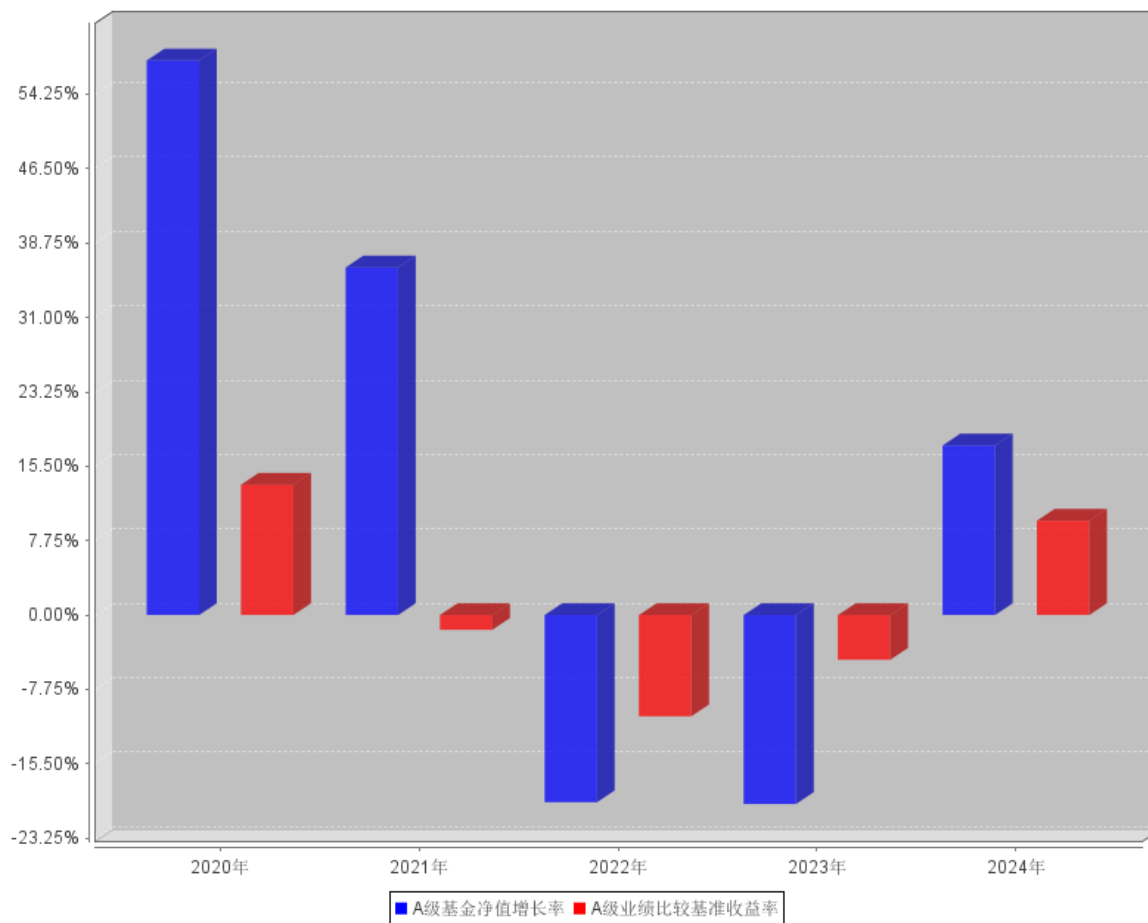
注：1、比较基准=沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

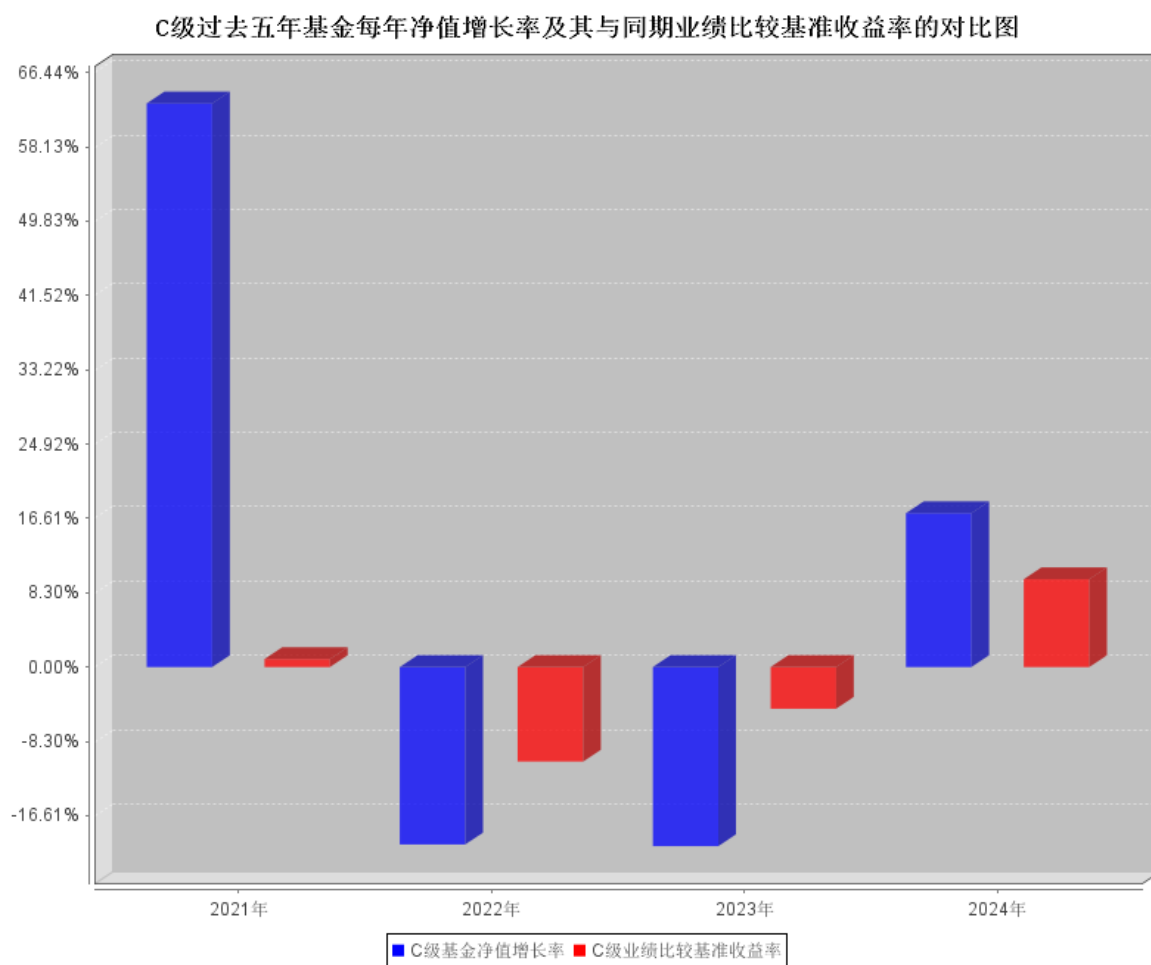
2、本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日。

3、本基金于 2021 年 4 月 14 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图





注：本基金于 2021 年 4 月 14 日开始分为 A、C 两类。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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		
张浩佳	基金经理	2021 年 9 月 30 日	-	8 年	张浩佳先生, 中国国籍, 南京大学工学硕士, 具备证券投资基金从业资格。曾任职国联证券研究所研究员, 2017 年 11 月加入东吴基金管理有限公司, 现任基金经理。2021 年 9 月 30 日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月 30 日至今担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理。

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人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，对旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。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

回顾 2024 年行情，市场整体波动性比较大，年初受到流动性危机出现大幅下跌，后续在政策

维稳下又进行一轮大幅反弹，24 年全球宏观环境也波动较大，市场在通胀、降息、流动性等因素影响下持续震荡，年中受到海外关税、贸易战等预期影响下，市场也在持续回调，但是四季度在政策持续的利好推动下，市场在四季度持续较大幅度上涨。从板块来看，24 年市场轮动较为明显，上半年 AI 与红利板块同涨，呈现较为明显的哑铃策略，下半年半导体、信创、券商等受益流动性及产业催化的板块表现相对较好，而上半年涨幅较好的板块在四季度反而表现一般，相对而言，上半年市场主要是大盘股表现较好，而四季度各行业内部也多呈现小盘股跑赢大盘股的现象，虽然红利资产仍相对坚挺，但表现也不及以北交所及微盘股指数所代表的小盘股板块，市场成交额大放量带动的流动性行情或仍是下半年相对超额的来源。

从产业发展来看，AI 带动下的硬件、软件等产业变革仍在持续，人型机器人、自动驾驶、AI 眼镜等新品类仍在持续发展，同时随着国内外大模型的持续升级，相关资本开支也在逐步加速，AI 产业带来的科技革命可能仍是未来一段时间市场关注的重点，科技板块的盈利能力也在逐步复苏，同时 AI 的投资趋势相对较为明确，有望带动相关科技行业的投资机会。

同时，在前几年的扩产周期后，部分行业的产能扩张速度逐步放慢，甚至有些在逐步收缩，同时随着财政政策的发力以及全球逐步进入降息周期，这样的宏观环境对市场或更加友好。

但值得关注的是短期市场受益于利好政策的刺激出现大幅上涨，虽然市场整体估值处在历史相对底部区域，但部分板块及个股的估值也回到了历史中枢水平，预计其可能有消化估值的压力，如果后续随着货币及财政政策的逐步加码带动经济企稳，市场也有望走出基本面兑现的投资机会。

2025 年来看，随着国内经济的逐步复苏和全球 AI 的继续发展，市场预计可能仍会聚焦在具备产业景气及政策友好相关的板块中，同时美联储已经开启降息周期，市场环境或将更加友好，但考虑到降息环境可能是逐步兑现，目前仍要重视估值-业绩匹配度，低估值行业的股价波动性也会相对较低。横向对比各行业情况，本基金比较重视成长行业景气向上周期可能带来的盈利弹性，重点关注以 AI、半导体、机器人、智能网联汽车等方向的投资机会，同时会努力选择 ROE 触底回升，行业盈利逐步稳定向上的行业，致力于优选产业链估值业绩匹配较好的公司进行配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴多策略混合 A 基金份额净值为 1.9340 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.67%；截至本报告期末东吴多策略混合 C 基金份额净值为 1.9039 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.21%；同期业绩比较基准收益率为 9.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年我国 GDP 同比增长 5%，与年初市场预期基本一致。但季度上 GDP 增速呈现出“两头高、中间低”的 V 型走势。其中：第一季度增速相对偏高，说明经济韧性还比较强；然而，第二、三

季度 GDP 同比增速呈现下行趋势，主要是财富缩水和居民信心不足制约消费、地产修复不及预期导致地产投资继续大幅下滑；9 月底一揽子政策集中出台之后，政策效果逐步显现，推动第四季度经济触底回升。结构上看，出口、工业生产和制造业投资是 2024 年宏观经济的亮点和主要支撑，房地产、基建实物工作量、消费等内需相关方向则构成制约。

展望 2025 年，国内来看是我国“十四五”规划的收官之年，更是全面落实二十届三中全会精神的关键之年，预计 GDP 目标可能仍会维持合理水平。海外来看也是特朗普再次当选美国的第一年，结构上看，外需可能有所弱化，内需尤其是消费或将成为经济的重要支撑。具体看：1) 消费方面，“以旧换新”等政策加码，有望对国内消费带来一定增量，预计 2025 年消费增速可能有所回升。2) 出口方面，特朗普已经宣布对从我国进口的商品加征 10% 的关税，预计后续出口的不确定性可能会增加，对于经济的支撑或将有所弱化。3) 投资方面，预计整体固定资产投资增速可能小幅回升。其中：由于地方化债、财政发力等因素影响，预计基础设施建设投资可能维持偏高增速；在设备更新支持延续、出口回落等影响下，制造业投资可能小幅放缓；房地产投资仍有不确定性，但低基数影响下，房地产投资增速较 2024 年降幅可能收窄。此外，在财政政策和货币政策双发力的情况下，预计供需缺口可能有所改善，物价或回升。预计名义 GDP 增速有望好于 2024 年，2025 年 A 股上市公司净利润增速有望进入上行趋势。

宏观政策方面，2025 年政策大方向可能需要更加积极，具体可以重点关注 3 个方面：一是货币宽松或仍是方向，预计降准、降息仍然可以期待。二是财政可能进一步加码，按照测算，2025 年广义赤字率相比 2024 年可能有所抬升，财政支出节奏也有望前置。三是产业政策预计可能将会进一步发力，包括更大规模的“以旧换新”、存量商品房收储、北京和上海进一步放松地产限购限售。从产业发展来看，国内政策仍在加速构建现代产业体系和发展新质生产力尤其是跟 AI 人工智能相关的战略产业和新兴产业。

从目前来看，当前 A 股市场具有以下三大特征：（1）市场估值处在历史相对底部区域；（2）政策宽松拐点或明确；（3）2025 年 A 股上市公司净利润增速有望进入上行趋势。另外，2025 年随着海外资金对中国企业竞争优势的认识，中国资产有望得到重估。因此我们认为 2025 年 A 股市场行情或值得期待。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人坚持从合法经营、规范运作、勤勉尽责、维护基金份额持有人利益最大化角度出发，坚守合规底线。本报告期内公司监察稽核工作按照规定的权限和程序，通过实时监控、定期检查、重点稽核和人员访谈等方式，开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促改进，定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内重点工

作包括：实施投资监督和风险监测，加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部管理机制的完善与优化；对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通、及时进行风险提示防范风险；开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、廉洁从业、反洗钱等方面的专项稽核工作，对稽核中发现问题及时反馈并提出改进建议，按照工作程序向公司管理层进行报告；加强员工合规管理，结合各项新规等要求，通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规内控意识；扎实推进反洗钱工作，推动反洗钱工作深入开展。本基金管理人将不断深入分析和识别市场变化和潜在风险，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、督察长、分管固定收益总部和专户投资总部的公司副总经理、投研部门（包括但不限于权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、权益研究部）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，公司总经理担任基金资产估值委员会主席，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席指定的其他人员可以列席会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；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。基金经理可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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，东吴基金管理有限公司在东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2025)审字第 70072926_B13 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无

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

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈露	金健
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	12,382,313.79	13,389,326.36
结算备付金		879,131.71	538,858.22
存出保证金		166,432.06	197,414.78
交易性金融资产	7.4.7.2	136,449,418.45	152,412,847.79
其中：股票投资		136,449,418.45	152,412,847.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		6,641,261.26	1,141,760.30
应收股利		-	-
应收申购款		468,973.35	84,651.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		156,987,530.62	167,764,858.45
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,635,983.08	3,233,882.58
应付赎回款		1,153,629.20	685,069.66
应付管理人报酬		108,006.41	112,265.28
应付托管费		27,001.59	28,066.31
应付销售服务费		21,442.75	24,905.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	521,992.40	872,530.97
负债合计		4,468,055.43	4,956,720.15
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	79,347,346.96	99,576,165.91
未分配利润	7.4.7.8	73,172,128.23	63,231,972.39
净资产合计		152,519,475.19	162,808,138.30
负债和净资产总计		156,987,530.62	167,764,858.45

报告截止日 2024 年 12 月 31 日，东吴多策略混合 A 基金份额净值 1.9340 元，基金份额总额 48,126,715.27 份；东吴多策略混合 C 基金份额净值 1.9039 元，基金份额总额 31,220,631.69 份。东吴多策略混合份额总额合计为 79,347,346.96 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		22,659,031.68	-70,368,847.70
1.利息收入		133,309.29	275,506.91
其中：存款利息收入	7.4.7.9	133,309.29	275,506.91
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,518,720.20	-105,947,518.57
其中：股票投资收益	7.4.7.10	14,585,838.09	-106,702,328.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	932,882.11	754,810.32
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.15	6,352,545.92	34,793,117.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	654,456.27	510,046.07
减：二、营业总支出		2,351,485.28	4,115,575.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,447,007.47	2,465,346.17
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	361,751.90	731,100.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	343,205.91	719,198.90
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.18	199,520.00	199,930.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,307,546.40	-74,484,422.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,307,546.40	-74,484,422.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,307,546.40	-74,484,422.87

7.3 净资产变动表

会计主体：东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	99,576,165.91	63,231,972.39	162,808,138.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	99,576,165.91	63,231,972.39	162,808,138.30
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-20,228,818.95	9,940,155.84	-10,288,663.11
（一）、综合收益总额	-	20,307,546.40	20,307,546.40
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以 “-”号填列）	-20,228,818.95	-10,367,390.56	-30,596,209.51
其中：1.基金申购款	131,451,657.67	109,769,141.46	241,220,799.13

2.基金赎回款	-151,680,476.62	-120,136,532.02	-271,817,008.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	79,347,346.96	73,172,128.23	152,519,475.19
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	335,783,206.59	348,326,233.44	684,109,440.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	335,783,206.59	348,326,233.44	684,109,440.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-236,207,040.68	-285,094,261.05	-521,301,301.73
(一)、综合收益总额	-	-74,484,422.87	-74,484,422.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-236,207,040.68	-210,609,838.18	-446,816,878.86
其中：1.基金申购款	115,649,020.81	106,578,913.91	222,227,934.72
2.基金赎回款	-351,856,061.49	-317,188,752.09	-669,044,813.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	99,576,165.91	63,231,972.39	162,808,138.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

李素明	李素明	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由东吴内需增长混合型证券投资基金转型而来，原东吴内需增长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[2012]1035 号《关于核准东吴内需增长混合型证券投资基金募集的批复》的核准，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 2013 年 1 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 464,106,738.16 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

2017 年 12 月 12 日东吴内需增长混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于东吴内需增长混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括东吴内需增长混合型证券投资基金变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略和修订基金合同等事项。自基金份额持有人大会决议生效之日次一日起，《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》失效且《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

根据 2021 年 4 月 13 日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴多策略灵活配置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》，2021 年 4 月 14 日起对本基金增加 C 类基金份额，并对本基金的基金合同和《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》作相应修改。本基金增加 C 类基金份额后，将形成 A 类和 C 类两类基金份额并分别设置对应的基金代码（A 类基金份额代码：580009；C 类基金份额代码：011949）。新增的 C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费。原有的基金份额在本基金增加 C 类基金份额后，全部自动转换为本基金 A 类基金份额，该类份额的申购赎回业务规则以及费率结构均保持不变。C 类基金份额的初始基金份额净值参考交易当日 A 类基金份额的基金份额净值。

本基金投资范围限于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上市的股票）、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、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债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）。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：沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资

产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 8 次，每次收益分配比例不得低于该次期末可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

2、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相应类别的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；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

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征增值税试点的通知》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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金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法》及《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[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[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额

计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	12,382,313.79	13,389,326.36
等于：本金	12,381,134.05	13,386,598.32
加：应计利息	1,179.74	2,728.04
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	12,382,313.79	13,389,326.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		127,975,798.12	-	136,449,418.45	8,473,620.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	127,975,798.12	-	136,449,418.45	8,473,620.33
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	150,291,773.38	-	152,412,847.79	2,121,074.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	150,291,773.38	-	152,412,847.79	2,121,074.41

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	321.40	150.67
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	349,671.00	700,380.30
其中：交易所市场	349,671.00	700,380.30
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
应付审计费	43,000.00	43,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	521,992.40	872,530.97

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴多策略混合 A		
项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,130,102.89	55,130,102.89
本期申购	33,451,160.98	33,451,160.98
本期赎回（以“-”号填列）	-40,454,548.60	-40,454,548.60
本期末	48,126,715.27	48,126,715.27

金额单位：人民币元

东吴多策略混合 C		
项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,446,063.02	44,446,063.02
本期申购	98,000,496.69	98,000,496.69
本期赎回（以“-”号填列）	-111,225,928.02	-111,225,928.02
本期末	31,220,631.69	31,220,631.69

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴多策略混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,818,121.68	661,244.64	35,479,366.32
本期期初	34,818,121.68	661,244.64	35,479,366.32
本期利润	8,243,638.98	8,217,789.15	16,461,428.13
本期基金份额交易产生的变动数	-4,109,961.46	-2,878,497.82	-6,988,459.28
其中：基金申购款	17,046,925.20	11,927,263.17	28,974,188.37
基金赎回款	-21,156,886.66	-14,805,760.99	-35,962,647.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,951,799.20	6,000,535.97	44,952,335.17

单位：人民币元

东吴多策略混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,510,171.59	47,262,777.66	27,752,606.07
本期期初	-19,510,171.59	47,262,777.66	27,752,606.07
本期利润	5,711,361.50	-1,865,243.23	3,846,118.27
本期基金份额交易产生的变动数	5,324,060.17	-8,702,991.45	-3,378,931.28
其中：基金申购款	-60,070,718.74	140,865,671.83	80,794,953.09
基金赎回款	65,394,778.91	-149,568,663.28	-84,173,884.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,474,749.92	36,694,542.98	28,219,793.06

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	118,172.31	250,141.83
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	12,647.75	19,850.34
其他	2,489.23	5,514.74
合计	133,309.29	275,506.91

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,357,361,566.17	2,104,423,754.17
减：卖出股票成本总额	1,340,252,637.59	2,205,513,121.37
减：交易费用	2,523,090.49	5,612,961.69
买卖股票差价收入	14,585,838.09	-106,702,328.89

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	932,882.11	754,810.32
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	932,882.11	754,810.32

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	6,352,545.92	34,793,117.89
——股票投资	6,352,545.92	34,793,117.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	6,352,545.92	34,793,117.89

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	648,322.90	507,858.47
基金转换费收入	6,133.37	2,187.60
合计	654,456.27	510,046.07

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	43,000.00	43,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行汇划费用	520.00	930.00
合计	199,520.00	199,930.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	290,184,665.59	10.85%	209,483,578.14	5.54%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	236,617.66	14.14%	31,897.56	9.12%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
东吴证券股份有 限公司	193,390.32	5.49%	-	-

注:1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算,佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止,该类佣金协议的服务范围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等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》,自 2024 年 7 月 1 日起,基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率,且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用;其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用,但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍,且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,447,007.47	2,465,346.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	566,032.86	728,601.69
应支付基金管理人的净管理费	880,974.61	1,736,744.48

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	361,751.90	731,100.10

注：2023 年 7 月 31 日前，本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 31 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	73,233.01	73,233.01
东吴证券股份有限公司	-	131.42	131.42
交通银行股份有限公司	-	204.82	204.82
合计	-	73,569.25	73,569.25
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	315,354.94	315,354.94
东吴证券股份有限公司	-	141.75	141.75
合计	-	315,496.69	315,496.69

注：本基金的 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 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	12,382,313.79	118,172.31	13,389,326.36	250,141.83

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	101	2,076.56	3,653.17	-
603391	力聚	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	83	3,320.00	3,432.05	-

	热能	月 24 日		受限						
603310	巍 华 新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通 受限	17.39	17.95	108	1,878.12	1,938.60	-
301626	苏 州 天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	21.23	65.78	766	16,262.18	50,387.48	-
301611	珂 玛 科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通 受限	8.00	56.10	689	5,512.00	38,652.90	-
301551	无 线 传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301556	托 普 云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国 科 天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股流通 受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301522	上 大 股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通 受限	6.88	24.84	558	3,839.04	13,860.72	-
301586	佳 力 奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301607	富 特 科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博 实 结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股流通 受限	44.50	65.38	135	6,007.50	8,826.30	-
301622	英 思 特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	22.36	44.92	190	4,248.40	8,534.80	-
301613	新 铝 时代	2024 年 10 月 18 日	6 个月	新股流通 受限	27.70	41.77	183	5,069.10	7,643.91	-
001279	强 邦 新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股流通 受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
301631	壹 连 科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	72.99	101.96	72	5,255.28	7,341.12	-
301617	博 苑 股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	27.76	39.79	149	4,136.24	5,928.71	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。本基金投资范围限于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上市的股票）、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、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资目标为在充分控制基金资产风险的前提下，通过积极主动的资产配置和多种策略，充分挖掘市场中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

基于该投资目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期

向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

本基金的货币资金均存放于信用良好的银行，因而与货币资金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对对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币资金	12,382,313.79	-	-	-	-	-	12,382,313.79
结算备付金	879,131.71	-	-	-	-	-	879,131.71
存出保证金	166,432.06	-	-	-	-	-	166,432.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	136,449,418.45	136,449,418.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	6,641,261.26	6,641,261.26
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	468,973.35	468,973.35
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,427,877.56	-	-	-	-	143,559,653.06	156,987,530.62
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,635,983.08	2,635,983.08
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,153,629.20	1,153,629.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	108,006.41	108,006.41
应付托管费	-	-	-	-	-	27,001.59	27,001.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,442.75	21,442.75
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	521,992.40	521,992.40
负债总计	-	-	-	-	-	4,468,055.43	4,468,055.43
利率敏感度缺口	13,427,877.56	-	-	-	-	-139,091,597.63	152,519,475.19
上年度末 2023 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	-	-	-	-	-	-	-
货币资金	13,389,326.36	-	-	-	-	-	13,389,326.36
结算备付金	538,858.22	-	-	-	-	-	538,858.22
存出保证金	197,414.78	-	-	-	-	-	197,414.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	152,412,847.79	152,412,847.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,141,760.30	1,141,760.30
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	84,651.00	84,651.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,125,599.36	-	-	-	-	153,639,259.09	167,764,858.45
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	3,233,882.58	3,233,882.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	685,069.66	685,069.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	112,265.28	112,265.28
应付托管费	-	-	-	-	-	28,066.31	28,066.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24,905.35	24,905.35
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	872,530.97	872,530.97

负债总计	-	-	-	-	4,956,720.15	4,956,720.15
利率敏感度缺口	14,125,599.36	-	-	-	-148,682,538.94	162,808,138.30

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，并通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	136,449,418.45	89.46	152,412,847.79	93.62
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	136,449,418.45	89.46	152,412,847.79	93.62

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-4,316,301.15	-2,214,190.68
	2. 业绩基准下跌 5%	-21,581,505.74	-11,070,953.40
	3. 业绩基准下跌 10%	-43,163,011.48	-22,141,906.81

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	136,197,005.50	152,398,356.71
第二层次	—	—
第三层次	252,412.95	14,491.08
合计	136,449,418.45	152,412,847.79

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	14,491.08	14,491.08
当期购买	—	86,717.77	86,717.77
当期出售/结算	—	—	—

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	14,491.08	14,491.08
当期利得或损失总额	-	165,695.18	165,695.18
其中：计入损益的利得或损失	-	165,695.18	165,695.18
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	252,412.95	252,412.95
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	165,695.18	165,695.18
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,270,779.71	1,270,779.71
当期购买	-	9,592.38	9,592.38
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,270,779.71	1,270,779.71
当期利得或损失总额	-	4,898.70	4,898.70
其中：计入损益的利得或损失	-	4,898.70	4,898.70
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	14,491.08	14,491.08
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	4,898.70	4,898.70

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均	与公允价值

				值	之间的关系
限售股票	252,412.95	平均价格亚式期权模型	波动率	0.2665-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	14,491.08	平均价格亚式期权模型	波动率	0.7813-1.217	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	136,449,418.45	86.92
	其中：股票	136,449,418.45	86.92
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	13,261,445.50	8.45
8	其他各项资产	7,276,666.67	4.64
9	合计	156,987,530.62	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	134,700,646.32	88.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,748,772.13	1.15
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	136,449,418.45	89.46

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002130	沃尔核材	426,900	10,779,225.00	7.07
2	601689	拓普集团	189,800	9,300,200.00	6.10
3	600104	上汽集团	428,900	8,903,964.00	5.84
4	603501	韦尔股份	79,900	8,342,359.00	5.47
5	688668	鼎通科技	162,840	7,630,682.40	5.00
6	603920	世运电路	240,200	7,061,880.00	4.63
7	300476	胜宏科技	162,400	6,835,416.00	4.48
8	603005	晶方科技	241,200	6,813,900.00	4.47
9	002906	华阳集团	220,300	6,774,225.00	4.44
10	002241	歌尔股份	261,500	6,749,315.00	4.43
11	002050	三花智控	284,900	6,697,999.00	4.39
12	688800	瑞可达	130,334	6,531,036.74	4.28
13	603728	鸣志电器	110,300	5,956,200.00	3.91
14	600577	精达股份	806,000	5,875,740.00	3.85
15	002568	百润股份	195,200	5,467,552.00	3.58
16	300563	神宇股份	88,900	4,903,724.00	3.22
17	300679	电连技术	80,900	4,829,730.00	3.17
18	300913	兆龙互连	78,400	4,508,784.00	2.96
19	300757	罗博特科	18,300	4,123,356.00	2.70
20	600584	长电科技	97,500	3,983,850.00	2.61
21	002281	光迅科技	43,000	2,243,310.00	1.47
22	688111	金山办公	5,846	1,674,235.94	1.10
23	603596	伯特利	2,900	129,311.00	0.08
24	301626	苏州天脉	766	50,387.48	0.03
25	301611	珂玛科技	689	38,652.90	0.03
26	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.02
27	688692	达梦数据	77	28,061.88	0.02

28	301536	星辰科技	246	19,655.40	0.01
29	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
30	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
31	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
32	301522	上大股份	558	13,860.72	0.01
33	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
34	301565	中仑新材	470	10,058.00	0.01
35	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
36	301608	博实结	135	8,826.30	0.01
37	301622	英思特	190	8,534.80	0.01
38	301613	新铝时代	183	7,643.91	0.01
39	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
40	301631	壹连科技	72	7,341.12	0.00
41	301580	爱迪特	122	7,088.20	0.00
42	001389	广合科技	120	6,036.00	0.00
43	301617	博苑股份	149	5,928.71	0.00
44	688584	上海合晶	209	4,088.04	0.00
45	603350	安乃达	101	3,653.17	0.00
46	603391	力聚热能	83	3,432.05	0.00
47	600406	国电南瑞	100	2,522.00	0.00
48	603082	北自科技	61	2,067.90	0.00
49	603310	巍华新材	108	1,938.60	0.00
50	601058	赛轮轮胎	100	1,433.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688668	鼎通科技	48,106,009.43	29.55
2	002241	歌尔股份	46,335,496.96	28.46
3	002920	德赛西威	43,413,106.27	26.67
4	300394	天孚通信	40,888,410.22	25.11
5	002463	沪电股份	39,868,019.90	24.49
6	601689	拓普集团	39,187,394.25	24.07
7	688111	金山办公	38,766,046.06	23.81
8	002130	沃尔核材	36,098,459.00	22.17
9	688041	海光信息	31,832,470.02	19.55

10	002371	北方华创	27,901,960.48	17.14
11	688347	华虹公司	27,610,426.60	16.96
12	300442	润泽科技	27,460,861.00	16.87
13	002916	深南电路	27,041,192.00	16.61
14	688256	寒武纪	25,080,529.59	15.40
15	300502	新易盛	23,829,700.00	14.64
16	603920	世运电路	23,510,544.22	14.44
17	300476	胜宏科技	21,629,708.00	13.29
18	603283	赛腾股份	21,153,478.12	12.99
19	603477	巨星农牧	20,402,291.00	12.53
20	603596	伯特利	19,522,326.60	11.99
21	002714	牧原股份	19,403,869.00	11.92
22	601138	工业富联	19,266,532.63	11.83
23	002050	三花智控	19,239,432.06	11.82
24	300570	太辰光	18,928,402.00	11.63
25	300308	中际旭创	18,375,232.00	11.29
26	300498	温氏股份	17,996,343.48	11.05
27	601058	赛轮轮胎	16,641,697.87	10.22
28	603728	鸣志电器	16,392,559.00	10.07
29	002851	麦格米特	15,924,790.02	9.78
30	600584	长电科技	15,504,510.50	9.52
31	002281	光迅科技	15,476,852.85	9.51
32	002837	英维克	15,189,128.00	9.33
33	603501	韦尔股份	15,094,088.00	9.27
34	600312	平高电气	15,060,675.88	9.25
35	002840	华统股份	14,766,141.00	9.07
36	002568	百润股份	14,194,622.00	8.72
37	002475	立讯精密	14,083,124.00	8.65
38	002273	水晶光电	13,397,575.43	8.23
39	600150	中国船舶	13,026,988.00	8.00
40	000977	浪潮信息	12,667,940.00	7.78
41	002353	杰瑞股份	12,552,458.00	7.71
42	002906	华阳集团	12,421,945.40	7.63
43	688981	中芯国际	11,789,307.23	7.24
44	002384	东山精密	11,758,408.00	7.22
45	600104	上汽集团	11,680,483.00	7.17

46	688012	中微公司	10,954,748.48	6.73
47	605111	新洁能	10,922,207.28	6.71
48	601156	东航物流	10,571,827.00	6.49
49	002600	领益智造	10,394,685.00	6.38
50	600577	精达股份	10,359,006.00	6.36
51	688498	源杰科技	10,187,077.65	6.26
52	000625	长安汽车	10,131,876.00	6.22
53	002869	金溢科技	9,527,724.00	5.85
54	002517	恺英网络	9,169,663.00	5.63
55	002156	通富微电	8,459,198.00	5.20
56	688052	纳芯微	8,457,208.81	5.19
57	002230	科大讯飞	7,935,621.00	4.87
58	603228	景旺电子	7,917,870.00	4.86
59	300364	中文在线	7,906,628.00	4.86
60	300604	长川科技	7,731,503.00	4.75
61	603005	晶方科技	7,114,014.08	4.37
62	688120	华海清科	6,826,022.79	4.19
63	688800	瑞可达	6,730,690.78	4.13
64	300002	神州泰岳	6,325,989.00	3.89
65	300679	电连技术	6,246,049.00	3.84
66	688187	时代电气	6,013,331.79	3.69
67	600460	士兰微	5,947,958.65	3.65
68	300418	昆仑万维	5,826,900.00	3.58
69	000988	华工科技	5,722,711.00	3.52
70	603516	淳中科技	5,236,371.00	3.22
71	688072	拓荆科技	5,171,848.73	3.18
72	300563	神宇股份	5,016,090.00	3.08
73	603197	保隆科技	4,791,370.00	2.94
74	688692	达梦数据	4,742,935.99	2.91
75	300913	兆龙互连	4,739,448.00	2.91
76	601126	四方股份	4,494,069.52	2.76
77	600536	中国软件	4,492,787.00	2.76
78	600761	安徽合力	4,479,066.00	2.75
79	300567	精测电子	4,380,959.00	2.69
80	600406	国电南瑞	4,371,784.00	2.69
81	601390	中国中铁	4,286,586.00	2.63

82	300624	万兴科技	4,219,877.00	2.59
83	300757	罗博特科	4,060,940.00	2.49
84	688169	石头科技	3,825,989.40	2.35
85	603298	杭叉集团	3,812,765.00	2.34
86	000400	许继电气	3,626,663.00	2.23
87	300499	高澜股份	3,567,421.00	2.19

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔股份	48,543,383.00	29.82
2	300394	天孚通信	48,276,593.80	29.65
3	002463	沪电股份	48,239,530.28	29.63
4	002920	德赛西威	42,121,450.00	25.87
5	688668	鼎通科技	39,709,603.05	24.39
6	688041	海光信息	39,037,661.56	23.98
7	300502	新易盛	37,327,495.00	22.93
8	688111	金山办公	37,116,178.37	22.80
9	688256	寒武纪	34,685,869.25	21.30
10	002130	沃尔核材	30,625,841.20	18.81
11	601689	拓普集团	29,577,558.10	18.17
12	002371	北方华创	29,112,416.30	17.88
13	300308	中际旭创	27,757,029.00	17.05
14	300442	润泽科技	26,977,825.00	16.57
15	601138	工业富联	26,694,131.00	16.40
16	002916	深南电路	26,186,567.00	16.08
17	300476	胜宏科技	25,216,104.00	15.49
18	688347	华虹公司	25,036,305.95	15.38
19	002475	立讯精密	21,033,582.04	12.92
20	002714	牧原股份	19,135,597.00	11.75
21	603283	赛腾股份	19,091,071.00	11.73
22	603477	巨星农牧	18,736,387.00	11.51
23	603596	伯特利	18,189,141.80	11.17
24	300570	太辰光	18,130,411.00	11.14
25	300498	温氏股份	17,890,668.40	10.99

26	600584	长电科技	17,863,229.68	10.97
27	688981	中芯国际	17,013,014.48	10.45
28	601058	赛轮轮胎	16,515,334.88	10.14
29	002156	通富微电	16,062,337.50	9.87
30	688012	中微公司	15,815,532.86	9.71
31	002851	麦格米特	15,589,310.30	9.58
32	600312	平高电气	14,758,950.00	9.07
33	603920	世运电路	14,693,260.81	9.02
34	002837	英维克	14,355,698.50	8.82
35	002273	水晶光电	13,955,467.00	8.57
36	600150	中国船舶	13,635,145.00	8.37
37	603501	韦尔股份	13,379,836.60	8.22
38	002353	杰瑞股份	12,914,706.00	7.93
39	000977	浪潮信息	12,780,122.00	7.85
40	002281	光迅科技	12,447,760.00	7.65
41	002840	华统股份	12,180,197.00	7.48
42	601156	东航物流	12,005,026.68	7.37
43	002050	三花智控	11,274,625.00	6.93
44	002384	东山精密	10,425,393.00	6.40
45	605111	新洁能	9,981,827.08	6.13
46	300604	长川科技	9,933,535.00	6.10
47	002600	领益智造	9,774,326.00	6.00
48	002869	金溢科技	9,743,314.00	5.98
49	000625	长安汽车	9,561,700.00	5.87
50	688072	拓荆科技	9,177,435.69	5.64
51	603728	鸣志电器	9,102,022.00	5.59
52	688498	源杰科技	8,696,153.77	5.34
53	002517	恺英网络	8,633,385.00	5.30
54	002568	百润股份	8,299,105.00	5.10
55	688052	纳芯微	7,898,943.44	4.85
56	300567	精测电子	7,635,191.00	4.69
57	002230	科大讯飞	7,531,609.40	4.63
58	300364	中文在线	7,493,179.00	4.60
59	603228	景旺电子	6,627,812.00	4.07
60	300782	卓胜微	6,533,330.00	4.01
61	603986	兆易创新	6,355,220.56	3.90
62	688120	华海清科	6,338,805.59	3.89
63	300002	神州泰岳	6,263,387.00	3.85

64	688008	澜起科技	6,185,836.48	3.80
65	688187	时代电气	5,801,674.09	3.56
66	600577	精达股份	5,526,072.00	3.39
67	000988	华工科技	5,486,583.01	3.37
68	300418	昆仑万维	5,342,827.00	3.28
69	688766	普冉股份	5,228,779.11	3.21
70	600460	士兰微	5,221,043.17	3.21
71	688692	达梦数据	5,161,956.60	3.17
72	603516	淳中科技	5,123,376.00	3.15
73	688110	东芯股份	5,024,769.30	3.09
74	002906	华阳集团	4,900,630.00	3.01
75	603296	华勤技术	4,807,331.60	2.95
76	688037	芯源微	4,797,386.28	2.95
77	603197	保隆科技	4,665,482.00	2.87
78	600761	安徽合力	4,626,015.00	2.84
79	603005	晶方科技	4,580,475.00	2.81
80	688123	聚辰股份	4,569,800.66	2.81
81	601126	四方股份	4,554,454.08	2.80
82	603298	杭叉集团	4,449,179.00	2.73
83	600536	中国软件	4,388,898.00	2.70
84	600406	国电南瑞	4,327,503.00	2.66
85	601390	中国中铁	4,321,360.00	2.65
86	300223	北京君正	4,290,652.00	2.64
87	688019	安集科技	4,189,642.63	2.57
88	688169	石头科技	4,121,791.32	2.53
89	688608	恒玄科技	3,910,323.82	2.40
90	688099	晶晨股份	3,629,396.23	2.23
91	000400	许继电气	3,585,541.00	2.20
92	600104	上汽集团	3,554,730.00	2.18
93	300624	万兴科技	3,502,360.00	2.15
94	300499	高澜股份	3,493,373.00	2.15

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,317,936,662.33
卖出股票收入（成交）总额	1,357,361,566.17

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未投资债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未投资债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	166,432.06
2	应收清算款	6,641,261.26
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	468,973.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,276,666.67

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 多 策 略 混 合 A	6,521	7,380.27	4,023,418.64	8.36%	44,103,296.63	91.64%
东 吴 多 策 略 混 合 C	8,651	3,608.90	0.00	0.00%	31,220,631.69	100.00%
合计	15,172	5,229.85	4,023,418.64	5.07%	75,323,928.32	94.93%

注：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，比例的分母采用基金份额的合计数。

9.2 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	东吴多策略混合 A	91,123.99	0.1893%
	东吴多策略混合 C	78,539.84	0.2516%
	合计	169,663.83	0.2138%

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	东吴多策略混合 A	0~10
	东吴多策略混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	东吴多策略混合 A	0~10
	东吴多策略混合 C	-
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴多策略混合 A	东吴多策略混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 13 日）基金份额总额	215,437,775.44	—
本报告期期初基金份额总额	55,130,102.89	44,446,063.02
本报告期基金总申购份额	33,451,160.98	98,000,496.69
减:本报告期基金总赎回份额	40,454,548.60	111,225,928.02
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	48,126,715.27	31,220,631.69

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 4 月 14 日开始分为 A、C 两类。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2024 年 4 月 24 日东吴基金管理有限公司第三十一次股东会决议通过，聘任郭淳先生担任公司监事，王菁女士不再担任公司监事；

2、2024 年 12 月 10 日东吴基金管理有限公司第四届董事会第七次会议决议通过，聘任黄漫先生担任公司副总经理。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内应支付审计费 43,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

广发证券	2	1,261,995,174.53	47.19%	701,345.55	41.92%	—
开源证券	1	521,598,061.60	19.50%	336,034.55	20.09%	—
长江证券	2	446,364,106.50	16.69%	331,198.49	19.80%	—
东吴证券	2	290,184,665.59	10.85%	236,617.66	14.14%	—
浙商证券	2	154,101,689.92	5.76%	67,743.83	4.05%	—
招商证券	2	—	—	—	—	—

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准：公司根据合规风控能力、信息系统建设、产品管理规模等情况，合理选择证券交易模式，降低交易成本。公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

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建立白名单，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交易单元 2 个，为国新证券 2 个交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，《东吴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》公告首次披露的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，特此说明。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司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	2024 年 1 月 17 日
2	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 1 月 22 日
3	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2024 年 1 月 22 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 2 月 7 日
5	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2024 年 3 月 6 日

	二维码、公众号诈骗的风险提示公告	券日报、公司网站、 中证信息网站	
6	东吴基金管理有限公司关于参加长江证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2024 年 3 月 8 日
7	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
8	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2024 年 3 月 29 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金元证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2024 年 4 月 22 日
10	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2024 年 4 月 22 日
11	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2024 年 4 月 22 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、 中证信息网站	2024 年 5 月 13 日
13	东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司申购补差费率优惠的公告	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	2024 年 5 月 21 日
14	东吴基金管理有限公司旗下基金产品资料概要更新的提示性公告	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	2024 年 6 月 20 日
15	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金更新基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2024 年 6 月 20 日
16	东吴基金管理有限公司关于参加东方证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2024 年 6 月 25 日

		中证信息网站	
17	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 7 月 4 日
18	东吴基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	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	2024 年 7 月 12 日
19	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 年 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 7 月 19 日
20	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年 2 季度报告	公司网站、中证信息网站	2024 年 7 月 19 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 8 月 2 日
22	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	公司网站、中证信息网站	2024 年 8 月 30 日
23	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 8 月 30 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海国信嘉利基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资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	2024 年 9 月 24 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 9 月 26 日
26	东吴基金管理有限公司关于参加中国民生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	2024 年 10 月 11 日

27	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资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	2024 年 10 月 16 日
28	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券有限公司为代销机构、开通定期定额投资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	2024 年 10 月 16 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行股份有限公司为代销机构、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	2024 年 10 月 18 日
30	东吴基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站	2024 年 10 月 21 日
31	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 10 月 25 日
32	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	公司网站、中证信息网站	2024 年 10 月 25 日
33	东吴基金管理有限公司关于参加中信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	2024 年 11 月 19 日
34	东吴基金管理有限公司旗下基金招募说明书更新的提示性公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站	2024 年 12 月 6 日
35	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2024 年 12 月 6 日
36	东吴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2024 年 12 月 11 日
37	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为代销机构、开	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	2024 年 12 月 12 日

	通转换业务的公告		
38	东吴基金管理有限公司关于参加招商银行股份有限公司申购补差费率优惠的公告	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	2024 年 12 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴内需增长混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴内需增长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《东吴多策略灵活配置混合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、报告期内东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日