东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 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 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 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 37

7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
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 44

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 44
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 44
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 44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45
7.12 投资组合报告附注 45

§8 基金份额持有人信息 46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
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情况 46

§9 开放式基金份额变动 47

§10 重大事件揭示 47

10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 50

§11 影响投资者决策的其他重要信息 52

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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52

§12 备查文件目录 52

12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东吴智慧医疗量化混合	
基金主代码	002919	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 11 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	214,310,700.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东吴智慧医疗量化混合 A	东吴智慧医疗量化混合 C
下属分级基金的交易代码	002919	011948
报告期末下属分级基金的份额总额	121,481,914.47 份	92,828,786.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票，通过量化选股与择时相结合的方法，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。
业绩比较基准	65%×中证医疗指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	任航
	联系电话	021-50509888-8308	010-66060069
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-68121816
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	200120	100031
法定代表人	李素明	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	东吴智慧医疗量化混合 A	东吴智慧医疗量化混合 C
本期已实现收益	15,218,696.22	10,842,625.18
本期利润	20,636,686.33	13,770,273.78
加权平均基金份额本期利润	0.1693	0.1562
本期加权平均净值利润率	21.90%	20.50%
本期基金份额净值增长率	24.64%	24.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-41,570,723.02	-25,344,320.38
期末可供分配基金份额利润	-0.3422	-0.2730
期末基金资产净值	108,881,845.48	81,811,991.36
期末基金份额净值	0.8963	0.8813
3.1.3 累计期	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

末指标		
基金份额累计净值增长率	-10.37%	-35.27%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴智慧医疗量化混合 A

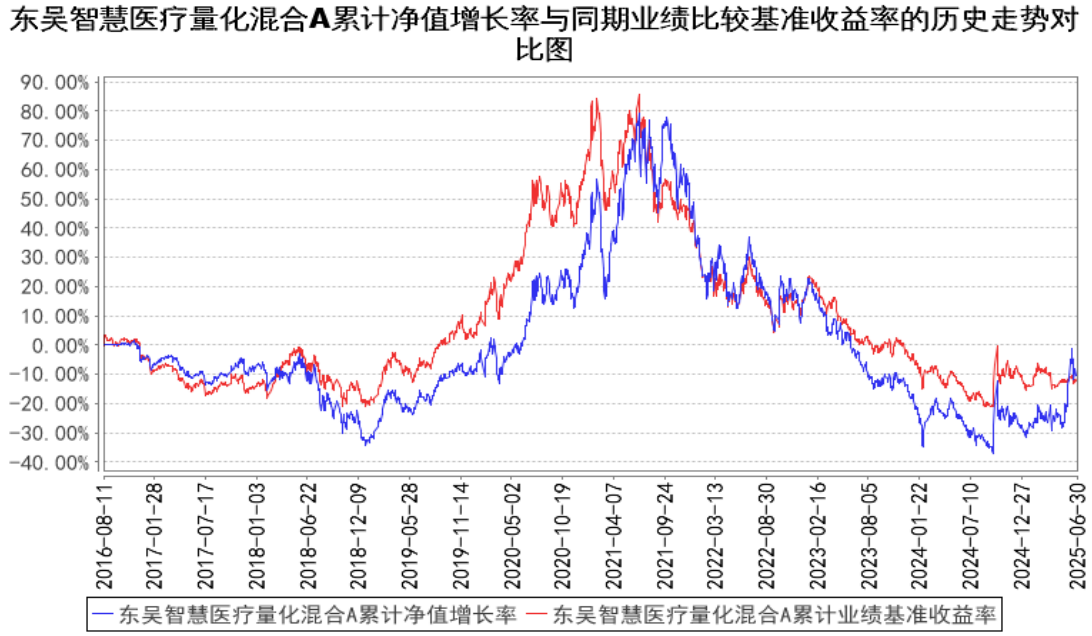
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.00%	2.52%	0.64%	0.64%	3.36%	1.88%
过去三个月	18.51%	2.70%	-1.09%	0.94%	19.60%	1.76%
过去六个月	24.64%	2.18%	0.47%	0.98%	24.17%	1.20%
过去一年	26.72%	2.23%	7.81%	1.44%	18.91%	0.79%
过去三年	-32.33%	1.71%	-26.40%	1.16%	-5.93%	0.55%
自基金合同生效起至今	-10.37%	1.60%	-11.30%	1.15%	0.93%	0.45%

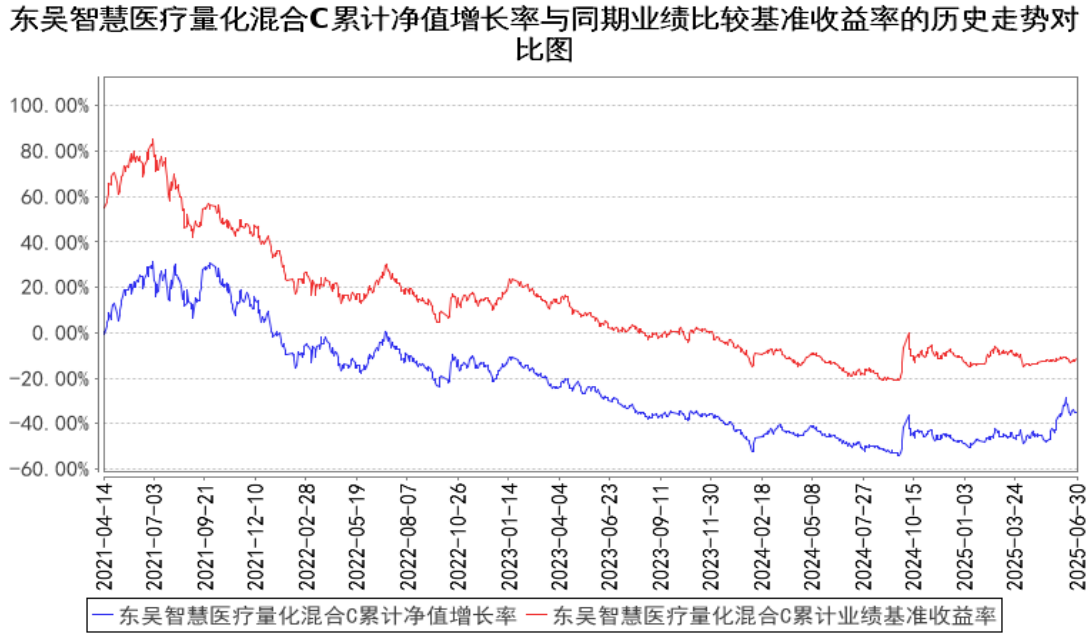
东吴智慧医疗量化混合 C

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	3.96%	2.52%	0.64%	0.64%	3.32%	1.88%
过去三个月	18.39%	2.70%	-1.09%	0.94%	19.48%	1.76%
过去六个月	24.41%	2.18%	0.47%	0.98%	23.94%	1.20%
过去一年	26.21%	2.23%	7.81%	1.44%	18.40%	0.79%
过去三年	-33.15%	1.71%	-26.40%	1.16%	-6.75%	0.55%
自基金合同生效起	-35.27%	1.86%	-34.19%	1.21%	-1.08%	0.65%

至今						

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





注：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。

§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		
毛可君	基金经理	2021 年 7 月 12 日	-	9 年	毛可君女士，中国国籍，复旦大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职上海浦东发展银行业务经理；申万宏源证券研究所行业分析师。2017 年 11 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2021 年 7 月 28 日至 2025 年 4 月 29 日担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 12 日至今担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月 30 日至今担任东吴医疗服务股票型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规

定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。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，通过投资交易系统中的公平交易模块，尽可能确保公平对待各投资组合，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对公司旗下所有投资组合及交易进行了相关分析，未发现异常情况。

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

今年上半年，市场整体震荡上行，4 月初因国际贸易形势造成短期较大波动，但随后市场在较快时间内就展开了持续修复态势。其中，医药行业整体向好，创新药表现突出，成为引领板块的市场主线。尤其是 4 月初的短期扰动后创新药是几乎最快回升向上的板块之一，市场的快速纠正体现了对创新药产业趋势的认可与信心。国内药企和海外跨国大药企 MNC 的大额 BD 交易事件频频落地与未来的交易常态化预期，实质上集中反映了我国创新药产业在多年累积与发展后的创新能力和技术竞争力，我国低成本高效率的创新药资产有望未来得以持续重估。本轮创新药行情是由明确的产业趋势驱动，中国创新药才刚刚开始真正参与欧美医药市场的商业价值分配，未来产业逻辑与业绩兑现的时间与空间可能都相对较为充足。报告期内我们继续以产业趋势和公司竞争力为基础构建了创新药为主的组合配置。展望后市，中长期我们比较看好我国创新药为代表的医药产业发展趋势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴智慧医疗量化混合 A 的基金份额净值为 0.8963 元，本报告期基金份额净

值增长率为 24.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.47%；截至本报告期末东吴智慧医疗量化混合 C 的基金份额净值为 0.8813 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.41%，同期业绩比较基准收益率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，2025 年上半年我国经济整体韧性较强。其中二季度宏观经济波动加大，主因是 4 月中美关税升级、地产走弱和消费下行。随着中美谈判取得实质性进展、高关税缓和，带动经济触底反弹，二季度 GDP 增速仍有韧性。展望 2025 年下半年，关税不确定性或仍在，内需不足的问题仍待解决。

展望下半年，我们对下半年 A 股市场行情相对比较乐观，认为市场结构性机会可能比较多。我们认为当前 A 股市场可能处在历史相对三重底：估值底、政策底和业绩底，中长期有望具备较显著投资价值。此外，在低利率环境下，A 股市场对机构资金、个人投资者及海外资本的吸引力有望进一步增强，市场流动性可能会比较充裕。具体行业方面，我们中长期相对比较看好创新药产业趋势的持续性与成长空间。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末

		2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	28,379,950.65	20,177,435.77
结算备付金		1,241,954.55	1,323,493.38
存出保证金		275,295.51	276,045.97
交易性金融资产	6.4.7.2	156,958,127.27	129,252,621.91
其中：股票投资		156,958,127.27	129,252,621.91
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		9,040,743.94	9,729,097.02
应收股利		-	-
应收申购款		425,782.96	112,339.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		196,321,854.88	160,871,033.32
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		-	-
应付清算款		1,778,915.84	-
应付赎回款		2,968,287.50	414,322.03
应付管理人报酬		183,690.15	169,431.94
应付托管费		30,615.02	28,238.67
应付销售服务费		26,011.43	24,021.61
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	6.4.7.6	640,498.10	647,084.33
负债合计		5,628,018.04	1,283,098.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	214,310,700.47	223,343,457.28
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-23,616,863.63	-63,755,522.54
净资产合计		190,693,836.84	159,587,934.74

负债和净资产总计		196,321,854.88	160,871,033.32

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 214,310,700.47 份，其中东吴智慧医疗量化混合 A 的基金份额净值 0.8963 元，基金份额总额 121,481,914.47 份；东吴智慧医疗量化混合 C 的基金份额净值 0.8813 元，基金份额总额 92,828,786.00 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		35,762,379.84	-33,480,126.32
1.利息收入		38,913.73	116,410.95
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,913.73	116,410.95
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）		27,175,555.83	-28,760,338.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	26,739,372.57	-30,305,143.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	436,183.26	1,544,805.30
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）	6.4.7.15	8,345,638.71	-4,860,394.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	202,271.57	24,195.29
减：二、营业总支出		1,355,419.73	1,681,763.50

1．管理人报酬	6.4.10.2.1	958,700.09	1,198,521.64
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	159,783.40	199,753.65
3．销售服务费	6.4.10.2.3	132,843.50	175,848.76
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	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.18	104,092.74	107,639.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,406,960.11	-35,161,889.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,406,960.11	-35,161,889.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,406,960.11	-35,161,889.82

6.3 净资产变动表

会计主体：东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	223,343,457.28	-	-63,755,522.54	159,587,934.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	223,343,457.28	-	-63,755,522.54	159,587,934.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,032,756.81	-	40,138,658.91	31,105,902.10
（一）、综合收益总额	-	-	34,406,960.11	34,406,960.11
（二）、本期基金份额交易产生的	-9,032,756.81	-	5,731,698.80	-3,301,058.01

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	81,149,546.22	-	-11,032,879.57	70,116,666.65
2.基金赎回款	-90,182,303.03	-	16,764,578.37	-73,417,724.66
（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	214,310,700.47	-	-23,616,863.63	190,693,836.84
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	287,023,429.44	-	-49,068,556.33	237,954,873.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	287,023,429.44	-	-49,068,556.33	237,954,873.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,056,921.00	-	-28,685,808.69	-53,742,729.69
（一）、综合收益总额	-	-	-35,161,889.82	-35,161,889.82
（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）	-25,056,921.00	-	6,476,081.13	-18,580,839.87
其中：1.基金申购款	32,918,138.78	-	-8,211,584.76	24,706,554.02
2.基金赎回款	-57,975,059.78	-	14,687,665.89	-43,287,393.89

（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	261,966,508.44	-	-77,754,365.02	184,212,143.42

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴智慧医疗量化策略灵活配置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[2016]627 号《关于同意东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于 2016 年 8 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 556,759,946.47 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

于 2021 年 4 月 13 日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴智慧医疗量化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》，定自 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《东吴智慧医疗量化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：002919；C 类基金份额代码：011948）。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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具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。

本基金的业绩比较基准为：65％×中证医疗指数收益率+35％×中债综合全价（总值）指数收益率。

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、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。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	28,379,950.65
等于：本金	28,378,092.15
加：应计利息	1,858.50
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	28,379,950.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		148,629,684.31	-	156,958,127.27	8,328,442.96
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		148,629,684.31	-	156,958,127.27	8,328,442.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	136.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	550,530.52
其中：交易所市场	550,530.52
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	21,323.61
应付账户维护费	9,000.00
合计	640,498.10

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴智慧医疗量化混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,237,212.61	128,237,212.61
本期申购	22,016,466.64	22,016,466.64
本期赎回（以“-”号填列）	-28,771,764.78	-28,771,764.78
本期末	121,481,914.47	121,481,914.47

东吴智慧医疗量化混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,106,244.67	95,106,244.67
本期申购	59,133,079.58	59,133,079.58
本期赎回（以“-”号填列）	-61,410,538.25	-61,410,538.25
本期末	92,828,786.00	92,828,786.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴智慧医疗量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-60,409,149.38	24,381,932.58	-36,027,216.80
本期期初	-60,409,149.38	24,381,932.58	-36,027,216.80
本期利润	15,218,696.22	5,417,990.11	20,636,686.33
本期基金份额交易产生的变动数	3,619,730.14	-829,268.66	2,790,461.48
其中：基金申购款	-8,965,167.26	6,194,930.24	-2,770,237.02
基金赎回款	12,584,897.40	-7,024,198.90	5,560,698.50

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-41,570,723.02	28,970,654.03	-12,600,068.99

东吴智慧医疗量化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,880,005.44	10,151,699.70	-27,728,305.74
本期期初	-37,880,005.44	10,151,699.70	-27,728,305.74
本期利润	10,842,625.18	2,927,648.60	13,770,273.78
本期基金份额交易产生的变动数	1,693,059.88	1,248,177.44	2,941,237.32
其中：基金申购款	-19,742,489.14	11,479,846.59	-8,262,642.55
基金赎回款	21,435,549.02	-10,231,669.15	11,203,879.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,344,320.38	14,327,525.74	-11,016,794.64

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,233.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,194.14
其他	485.64
合计	38,913.73

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,739,372.57
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	26,739,372.57

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,429,867,519.11
减：卖出股票成本总额	1,401,004,433.55
减：交易费用	2,123,712.99
买卖股票差价收入	26,739,372.57

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	436,183.26
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	436,183.26

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,345,638.71
股票投资	8,345,638.71
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	8,345,638.71

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	200,854.93
基金转换费收入	1,416.64
合计	202,271.57

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	21,323.61
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划费	4,661.76
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	104,092.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农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（“东吴证券”）	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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	34,214,128.24	1.20	187,872,819.36	6.91

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

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。

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 2025年1月1日至2025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	8,071.14	0.66	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	45,216.88	1.86	38,543.12	3.94

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。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	958,700.09	1,198,521.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	419,851.23	521,126.34
应支付基金管理人的净管理费	538,848.86	677,395.30

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.20%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	159,783.40	199,753.65

注：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×0.20%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金

管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴智慧医疗量化混合 A	东吴智慧医疗量化混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	-	-
东吴证券	-	9.19	9.19
合计	-	9.19	9.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴智慧医疗量化混合 A	东吴智慧医疗量化混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	1,037.25	1,037.25
东吴证券	-	9.04	9.04
合计	-	1,046.29	1,046.29

注：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×0.40%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	28,379,950.65	35,233.95	40,545,894.95	100,880.62

注：本基金的银行存款由托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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	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

603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	79	2,093.50	2,581.72	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	136	1,672.80	7,405.20	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	226	1,943.60	3,527.86	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	64	1,313.28	2,398.08	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	75	1,545.00	2,631.00	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	58	1,402.44	1,932.56	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	297	5,755.86	24,796.53	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	481	5,618.08	12,962.95	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	191	4,918.62	15,218.88	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	199	4,531.23	7,826.67	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

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 2025 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 2025 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 2025 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具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

本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票，通过量化选股与择时相结合的方法，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。

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。

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

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。

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

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。

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 6.4.12 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。

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。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,379,950.65	-	-	-	28,379,950.65
结算备付金	1,241,954.55	-	-	-	1,241,954.55
存出保证金	275,295.51	-	-	-	275,295.51
交易性金融资产	-	-	-	156,958,127.27	156,958,127.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	9,040,743.94	9,040,743.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	425,782.96	425,782.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	29,897,200.71	-	-	166,424,654.17	196,321,854.88
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,778,915.84	1,778,915.84
应付赎回款	-	-	-	2,968,287.50	2,968,287.50

应付管理人报酬	-	-	-	183,690.15	183,690.15
应付托管费	-	-	-	30,615.02	30,615.02
应付销售服务费	-	-	-	26,011.43	26,011.43
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	640,498.10	640,498.10
负债总计	-	-	-	5,628,018.04	5,628,018.04
利率敏感度缺口	29,897,200.71	-	-	160,796,636.13	190,693,836.84
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,177,435.77	-	-	-	20,177,435.77
结算备付金	1,323,493.38	-	-	-	1,323,493.38
存出保证金	276,045.97	-	-	-	276,045.97
交易性金融资产	-	-	-	129,252,621.91	129,252,621.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	9,729,097.02	9,729,097.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	112,339.27	112,339.27
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,776,975.12	-	-	139,094,058.20	160,871,033.32
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	414,322.03	414,322.03
应付管理人报酬	-	-	-	169,431.94	169,431.94
应付托管费	-	-	-	28,238.67	28,238.67
应付销售服务费	-	-	-	24,021.61	24,021.61
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	647,084.33	647,084.33
负债总计	-	-	-	1,283,098.58	1,283,098.58
利率敏感度缺口	21,776,975.12	-	-	137,810,959.62	159,587,934.74

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

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	156,958,127.27	82.31	129,252,621.91	80.99
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	156,958,127.27	82.31	129,252,621.91	80.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-2,841,338.17	-1,931,014.01
	2. 业绩基准下跌 5%	-14,206,690.84	-9,655,070.05
	3. 业绩基准下跌 10%	-28,413,381.69	-19,310,140.10

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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	156,856,369.53	129,002,415.91
第二层次	-	16,641.90
第三层次	101,757.74	233,564.10
合计	156,958,127.27	129,252,621.91

6.4.14.2.2 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。本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 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	156,958,127.27	79.95
	其中：股票	156,958,127.27	79.95
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	29,621,905.20	15.09
8	其他各项资产	9,741,822.41	4.96
9	合计	196,321,854.88	100.00

7.2 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	151,009,085.35	79.19
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	5,932,740.00	3.11
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	16,301.92	0.01
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	156,958,127.27	82.31

7.2.2 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。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688266	泽璟制药	165,595	17,803,118.45	9.34
2	688382	益方生物	510,100	16,741,482.00	8.78
3	688062	迈威生物	496,426	14,038,927.28	7.36
4	688506	百利天恒	44,220	13,094,426.40	6.87
5	002773	康弘药业	419,900	12,164,503.00	6.38
6	600276	恒瑞医药	231,800	12,030,420.00	6.31
7	300765	新诺威	220,100	11,376,969.00	5.97
8	002422	科伦药业	270,400	9,712,768.00	5.09
9	688180	君实生物	238,400	8,100,832.00	4.25
10	300723	一品红	147,500	7,392,700.00	3.88
11	688336	三生国健	131,700	7,143,408.00	3.75
12	003010	若羽臣	97,900	5,932,740.00	3.11
13	002294	信立泰	97,100	4,595,743.00	2.41
14	688235	百济神州	18,699	4,368,834.36	2.29
15	688192	迪哲医药	69,813	4,174,817.40	2.19
16	603590	康辰药业	89,200	2,804,448.00	1.47
17	688428	诺诚健华	75,200	1,837,136.00	0.96
18	300888	稳健医疗	35,500	1,459,050.00	0.77
19	688578	艾力斯	13,991	1,301,722.64	0.68
20	002755	奥赛康	28,600	457,028.00	0.24
21	300298	三诺生物	14,400	325,296.00	0.17
22	688411	海博思创	297	24,796.53	0.01
23	688583	思看科技	191	15,218.88	0.01
24	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
25	688545	兴福电子	481	12,962.95	0.01
26	688755	汉邦科技	199	7,826.67	0.00
27	603072	天和磁材	136	7,405.20	0.00
28	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
29	603210	泰鸿万立	226	3,527.86	0.00
30	603271	永杰新材	75	2,631.00	0.00
31	603014	威高血净	79	2,581.72	0.00
32	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00

33	603257	中国瑞林	64	2,398.08	0.00
34	603409	汇通控股	58	1,932.56	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	300765	新诺威	65,806,371.80	41.24
2	603259	药明康德	54,133,607.00	33.92
3	600276	恒瑞医药	48,096,948.34	30.14
4	688506	百利天恒	46,005,044.81	28.83
5	688062	迈威生物	38,983,105.75	24.43
6	002422	科伦药业	37,790,147.86	23.68
7	688235	百济神州	34,587,216.02	21.67
8	002773	康弘药业	32,006,513.50	20.06
9	300347	泰格医药	27,361,888.00	17.15
10	300723	一品红	26,724,888.80	16.75
11	688336	三生国健	25,259,636.85	15.83
12	002044	美年健康	23,688,471.00	14.84
13	688114	华大智造	22,163,591.04	13.89
14	603882	金域医学	21,749,519.00	13.63
15	603501	豪威集团	21,444,656.00	13.44
16	300476	胜宏科技	20,931,145.51	13.12
17	688180	君实生物	20,434,713.44	12.80
18	688578	艾力斯	20,247,906.12	12.69
19	688981	中芯国际	18,845,204.18	11.81
20	688331	荣昌生物	18,729,594.60	11.74
21	002755	奥赛康	18,321,016.00	11.48
22	688076	ST 诺泰	18,044,819.33	11.31
23	603127	昭衍新药	17,997,616.20	11.28
24	688266	泽璟制药	17,841,228.97	11.18
25	300558	贝达药业	17,474,819.00	10.95
26	688382	益方生物	16,784,614.51	10.52
27	300633	开立医疗	15,735,778.54	9.86
28	688111	金山办公	15,492,806.60	9.71
29	300888	稳健医疗	15,221,556.10	9.54
30	688068	热景生物	15,160,513.33	9.50
31	300204	舒泰神	14,578,949.03	9.14
32	601689	拓普集团	14,576,439.66	9.13
33	300436	广生堂	14,569,612.00	9.13
34	688271	联影医疗	14,344,931.33	8.99
35	688192	迪哲医药	14,025,326.60	8.79
36	688050	爱博医疗	13,166,641.40	8.25

37	688041	海光信息	12,808,737.40	8.03
38	002294	信立泰	12,222,887.00	7.66
39	002475	立讯精密	11,589,238.00	7.26
40	300015	爱尔眼科	11,482,444.35	7.20
41	300502	新易盛	11,285,591.00	7.07
42	002851	麦格米特	10,898,979.00	6.83
43	600079	人福医药	10,870,758.00	6.81
44	688018	乐鑫科技	9,532,564.34	5.97
45	600941	中国移动	9,489,344.00	5.95
46	300677	英科医疗	9,489,014.80	5.95
47	300705	九典制药	9,172,156.24	5.75
48	688656	浩欧博	9,105,819.72	5.71
49	000999	华润三九	8,749,068.04	5.48
50	600566	济川药业	8,568,981.00	5.37
51	688690	纳微科技	8,563,428.76	5.37
52	000977	浪潮信息	8,554,156.00	5.36
53	603893	瑞芯微	8,536,311.00	5.35
54	300033	同花顺	8,383,780.00	5.25
55	688608	恒玄科技	8,305,928.19	5.20
56	688289	圣湘生物	8,159,119.79	5.11
57	002262	恩华药业	8,090,038.00	5.07
58	603005	晶方科技	7,869,247.00	4.93
59	688617	惠泰医疗	7,606,165.23	4.77
60	601127	赛力斯	7,491,236.00	4.69
61	002653	海思科	7,455,433.00	4.67
62	000963	华东医药	7,435,662.00	4.66
63	300308	中际旭创	7,261,154.00	4.55
64	300433	蓝思科技	7,215,645.00	4.52
65	600570	恒生电子	7,030,336.00	4.41
66	600030	中信证券	6,992,999.90	4.38
67	301333	诺思格	6,305,899.00	3.95
68	000063	中兴通讯	6,218,203.50	3.90
69	300896	爱美客	6,070,540.00	3.80
70	003010	若羽臣	5,929,498.00	3.72
71	300548	长芯博创	5,890,314.00	3.69
72	002920	德赛西威	5,717,943.00	3.58
73	600760	中航沈飞	5,572,083.00	3.49
74	603986	兆易创新	5,529,478.00	3.46
75	301293	三博脑科	5,495,646.70	3.44
76	300759	康龙化成	5,384,218.00	3.37
77	002594	比亚迪	5,317,142.00	3.33
78	603150	万朗磁塑	5,246,428.00	3.29
79	603833	欧派家居	5,127,409.00	3.21

80	000651	格力电器	5,103,158.67	3.20
81	688256	寒武纪	5,070,854.32	3.18
82	002050	三花智控	4,921,331.00	3.08
83	603087	甘李药业	4,877,505.00	3.06
84	688519	南亚新材	4,877,414.25	3.06
85	300363	博腾股份	4,808,173.00	3.01
86	600521	华海药业	4,777,599.10	2.99
87	300253	卫宁健康	4,724,518.00	2.96
88	688513	苑东生物	4,699,643.02	2.94
89	000516	国际医学	4,643,147.00	2.91
90	688799	华纳药厂	4,634,680.85	2.90
91	600718	东软集团	4,621,151.00	2.90
92	605116	奥锐特	4,601,963.98	2.88
93	000526	学大教育	4,585,407.00	2.87
94	002020	京新药业	4,574,453.00	2.87
95	688185	康希诺	4,519,131.79	2.83
96	002463	沪电股份	4,416,082.00	2.77
97	300244	迪安诊断	4,343,783.00	2.72
98	688347	华虹公司	4,240,922.01	2.66
99	300442	润泽科技	4,187,891.00	2.62
100	300003	乐普医疗	4,101,884.76	2.57
101	002230	科大讯飞	3,821,619.80	2.39
102	300661	圣邦股份	3,734,968.00	2.34
103	000661	长春高新	3,529,025.52	2.21
104	603590	康辰药业	3,447,744.16	2.16
105	688246	嘉和美康	3,287,514.45	2.06
106	301239	普瑞眼科	3,203,240.00	2.01
107	688428	诺诚健华	3,196,527.63	2.00

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

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	603259	药明康德	67,174,568.75	42.09
2	300765	新诺威	56,503,598.56	35.41
3	688235	百济神州	46,003,290.80	28.83
4	688506	百利天恒	40,255,995.40	25.22
5	600276	恒瑞医药	36,976,424.04	23.17
6	002422	科伦药业	36,397,123.19	22.81
7	300347	泰格医药	30,298,273.00	18.99
8	002044	美年健康	27,214,136.60	17.05

9	688062	迈威生物	26,234,696.27	16.44
10	603501	豪威集团	24,776,130.79	15.53
11	603882	金域医学	22,379,335.00	14.02
12	300723	一品红	21,165,077.30	13.26
13	688331	荣昌生物	20,893,183.89	13.09
14	300476	胜宏科技	20,679,030.00	12.96
15	688114	华大智造	20,284,811.61	12.71
16	002773	康弘药业	20,132,763.60	12.62
17	688578	艾力斯	20,129,648.65	12.61
18	688050	爱博医疗	19,976,135.78	12.52
19	300633	开立医疗	19,672,560.00	12.33
20	600079	人福医药	19,394,854.00	12.15
21	688981	中芯国际	18,876,692.34	11.83
22	300204	舒泰神	18,458,924.00	11.57
23	688076	ST 诺泰	18,433,359.56	11.55
24	688617	惠泰医疗	17,556,636.08	11.00
25	603127	昭衍新药	17,392,318.56	10.90
26	002755	奥赛康	17,228,983.55	10.80
27	601689	拓普集团	17,051,520.65	10.68
28	688336	三生国健	16,999,772.63	10.65
29	300558	贝达药业	16,757,729.00	10.50
30	688111	金山办公	16,013,692.73	10.03
31	688068	热景生物	15,294,772.61	9.58
32	688271	联影医疗	14,182,818.29	8.89
33	688278	特宝生物	14,135,879.26	8.86
34	300888	稳健医疗	13,446,970.20	8.43
35	300436	广生堂	13,064,064.00	8.19
36	688041	海光信息	13,014,136.33	8.15
37	002851	麦格米特	12,803,557.00	8.02
38	688180	君实生物	12,787,674.62	8.01
39	300502	新易盛	11,689,144.70	7.32
40	002475	立讯精密	11,577,938.00	7.25
41	300015	爱尔眼科	11,453,771.64	7.18
42	688192	迪哲医药	11,265,572.62	7.06
43	688382	益方生物	9,921,107.61	6.22
44	688018	乐鑫科技	9,853,629.71	6.17
45	688656	浩欧博	9,739,271.72	6.10
46	688266	泽璟制药	9,730,485.12	6.10
47	688690	纳微科技	9,615,305.54	6.03
48	000999	华润三九	9,514,449.00	5.96
49	002653	海思科	9,408,878.00	5.90
50	600941	中国移动	9,346,078.60	5.86
51	600285	羚锐制药	9,273,679.68	5.81

52	300677	英科医疗	9,179,253.80	5.75
53	300705	九典制药	8,909,377.00	5.58
54	600566	济川药业	8,794,488.90	5.51
55	300033	同花顺	8,716,790.24	5.46
56	000977	浪潮信息	8,431,448.00	5.28
57	002294	信立泰	8,405,762.00	5.27
58	603005	晶方科技	8,262,636.00	5.18
59	603893	瑞芯微	8,109,295.00	5.08
60	002262	恩华药业	8,061,988.00	5.05
61	688289	圣湘生物	8,045,983.34	5.04
62	688608	恒玄科技	8,002,847.17	5.01
63	301333	诺思格	7,991,933.40	5.01
64	601127	赛力斯	7,525,212.00	4.72
65	000963	华东医药	7,273,845.00	4.56
66	300433	蓝思科技	7,103,926.00	4.45
67	600030	中信证券	6,919,919.95	4.34
68	000063	中兴通讯	6,607,148.00	4.14
69	000915	华特达因	6,386,539.00	4.00
70	300308	中际旭创	6,371,966.00	3.99
71	600570	恒生电子	6,240,305.00	3.91
72	688799	华纳药厂	6,049,536.05	3.79
73	300896	爱美客	5,989,587.00	3.75
74	600760	中航沈飞	5,813,123.00	3.64
75	300548	长芯博创	5,744,961.00	3.60
76	002594	比亚迪	5,566,033.00	3.49
77	002920	德赛西威	5,491,749.00	3.44
78	603986	兆易创新	5,423,469.00	3.40
79	301293	三博脑科	5,374,009.00	3.37
80	300759	康龙化成	5,327,839.00	3.34
81	603150	万朗磁塑	5,312,271.00	3.33
82	600521	华海药业	5,253,302.00	3.29
83	603833	欧派家居	5,165,100.00	3.24
84	002050	三花智控	5,096,643.00	3.19
85	000651	格力电器	5,065,061.00	3.17
86	000516	国际医学	5,045,562.00	3.16
87	603087	甘李药业	4,975,730.00	3.12
88	300363	博腾股份	4,905,434.00	3.07
89	688256	寒武纪	4,899,974.17	3.07
90	300253	卫宁健康	4,834,881.10	3.03
91	000526	学大教育	4,668,200.00	2.93
92	605116	奥锐特	4,652,829.00	2.92
93	002020	京新药业	4,640,734.00	2.91
94	300442	润泽科技	4,552,753.00	2.85

95	002432	九安医疗	4,551,193.00	2.85
96	002463	沪电股份	4,538,524.90	2.84
97	600718	东软集团	4,423,832.00	2.77
98	688519	南亚新材	4,392,811.56	2.75
99	688185	康希诺	4,323,418.11	2.71
100	688513	苑东生物	4,293,209.72	2.69
101	688347	华虹公司	4,109,591.48	2.58
102	300244	迪安诊断	4,084,748.00	2.56
103	300003	乐普医疗	3,842,144.00	2.41
104	002230	科大讯飞	3,618,748.50	2.27
105	300661	圣邦股份	3,543,038.00	2.22
106	301239	普瑞眼科	3,537,034.00	2.22
107	000661	长春高新	3,493,034.00	2.19
108	603108	润达医疗	3,480,855.60	2.18
109	000880	潍柴重机	3,427,695.00	2.15
110	002241	歌尔股份	3,412,544.00	2.14
111	688016	心脉医疗	3,265,867.30	2.05

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,420,364,300.20
卖出股票收入（成交）总额	1,429,867,519.11

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	275,295.51
2	应收清算款	9,040,743.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	425,782.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,741,822.41

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（%）
东吴智慧医疗量化混合 A	11,690	10,391.95	233,208.01	0.19	121,248,706.46	99.81
东吴智慧医疗量化混合 C	9,384	9,892.24	0.00	0.00	92,828,786.00	100.00
合计	21,074	10,169.44	233,208.01	0.11	214,077,492.46	99.89

注：分级基金机构/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（即期末基金份额总额）。

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	东吴智慧医疗量化混合 A	48,301.52	0.0398
	东吴智慧医疗量化混合 C	26.68	0.0000
	合计	48,328.20	0.0226

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	东吴智慧医疗量化混合 A	-
	东吴智慧医疗量化混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴智慧医疗量化混合 A	0~10
	东吴智慧医疗量化混合 C	-
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴智慧医疗量化混合 A	东吴智慧医疗量化混合 C
基金合同生效日（2016 年 8 月 11 日）基金份额总额	556,759,946.47	-
本报告期期初基金份额总额	128,237,212.61	95,106,244.67
本报告期基金总申购份额	22,016,466.64	59,133,079.58
减：本报告期基金总赎回份额	28,771,764.78	61,410,538.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	121,481,914.47	92,828,786.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门发生以下人事变动：

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

10.6.1 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，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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(%)	
中泰证券	2	857,465,591.99	30.09	378,182.11	30.84	-
国海证券	1	510,345,511.52	17.91	227,564.08	18.56	-
兴业证券	1	458,072,611.74	16.07	204,254.63	16.66	-
东方证券	3	405,175,792.48	14.22	176,616.02	14.40	-
长江证券	1	161,081,332.35	5.65	70,215.05	5.73	-
国信证券	1	127,321,307.54	4.47	31,308.18	2.55	-
东北证券	1	107,209,823.65	3.76	46,733.37	3.81	-
光大证券	2	74,645,314.28	2.62	33,063.81	2.70	-
国投证券	1	54,447,736.64	1.91	23,733.61	1.94	-
广发证券	1	35,518,850.23	1.25	15,483.04	1.26	-
东吴证券	2	34,214,128.24	1.20	8,071.14	0.66	-
华西证券	1	22,595,448.13	0.79	10,075.24	0.82	-
申万宏源西部	1	1,778,802.00	0.06	775.37	0.06	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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。

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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
国投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2024 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	2025 年 1 月 22 日
2	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 1 月 22 日

3	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
4	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 3 月 31 日
5	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	公司网站、中证信息网站	2025 年 3 月 31 日
6	东吴基金管理有限公司关于参加浙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	2025 年 4 月 7 日
7	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	2025 年 4 月 9 日
8	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
9	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 22 日
10	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	2025 年 4 月 28 日
11	东吴基金管理有限公司关于参加中国邮政储蓄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	2025 年 5 月 12 日
12	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	2025 年 5 月 19 日
13	东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台部分业务服务的公告	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	2025 年 5 月 21 日
14	东吴基金管理有限公司关于终止民商基金销售（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、证券日报、公司网站、中证信息网站	2025 年 5 月 27 日
15	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合	公司网站、中证信息网	2025 年 6 月 13 日

	型证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要	站	
-	东吴基金管理有限公司旗下部分基金招募说明书及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	2025 年 6 月 13 日
-	东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台部分业务服务的提示性公告	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	2025 年 6 月 18 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智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《东吴智慧医疗量化策略灵活配置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、报告期内东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金在中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

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

2025 年 8 月 29 日