

# 东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十一日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
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.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东吴安盈量化混合	
基金主代码	002270	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 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	431,732,279.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴安盈量化混合 A	东吴安盈量化混合 C
下属分级基金的交易代码:	002270	015154
报告期末下属分级基金的份额总额	431,687,757.40 份	44,522.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用选股、择时量化策略，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 500 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷
	联系电话	021-50509888-8308
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn
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 号瑞明大厦 9 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336

法定代表人	邓晖	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴安盈量化混合 A	东吴安盈量化混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,001,211.63	104,254.02
本期利润	-18,465,487.73	298,551.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0463	0.2349
本期加权平均净值利润率	-3.87%	19.40%
本期基金份额净值增长率	-3.96%	3.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	64,506,224.89	4,559.70
期末可供分配基金份额利润	0.1494	0.1024
期末基金资产净值	496,193,982.29	51,124.13
期末基金份额净值	1.1494	1.1483
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	54.02%	3.88%

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 2022 年 02 月 21 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

东吴安盈量化混合 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	7.80%	0.89%	4.53%	0.72%	3.27%	0.17%
过去三个月	7.36%	1.17%	1.43%	1.13%	5.93%	0.04%
过去六个月	-3.96%	1.21%	-7.86%	1.06%	3.90%	0.15%
过去一年	1.61%	0.95%	-2.74%	0.86%	4.35%	0.09%
过去三年	71.32%	1.14%	20.98%	0.87%	50.34%	0.27%



自基金合同生效起至今	54.02%	1.04%	11.29%	0.90%	42.73%	0.14%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

东吴安盈量化混合 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	7.77%	0.90%	4.53%	0.72%	3.24%	0.18%
过去三个月	7.26%	1.17%	1.43%	1.13%	5.83%	0.04%
自基金合同生效起至今	3.88%	1.16%	-3.90%	1.15%	7.78%	0.01%

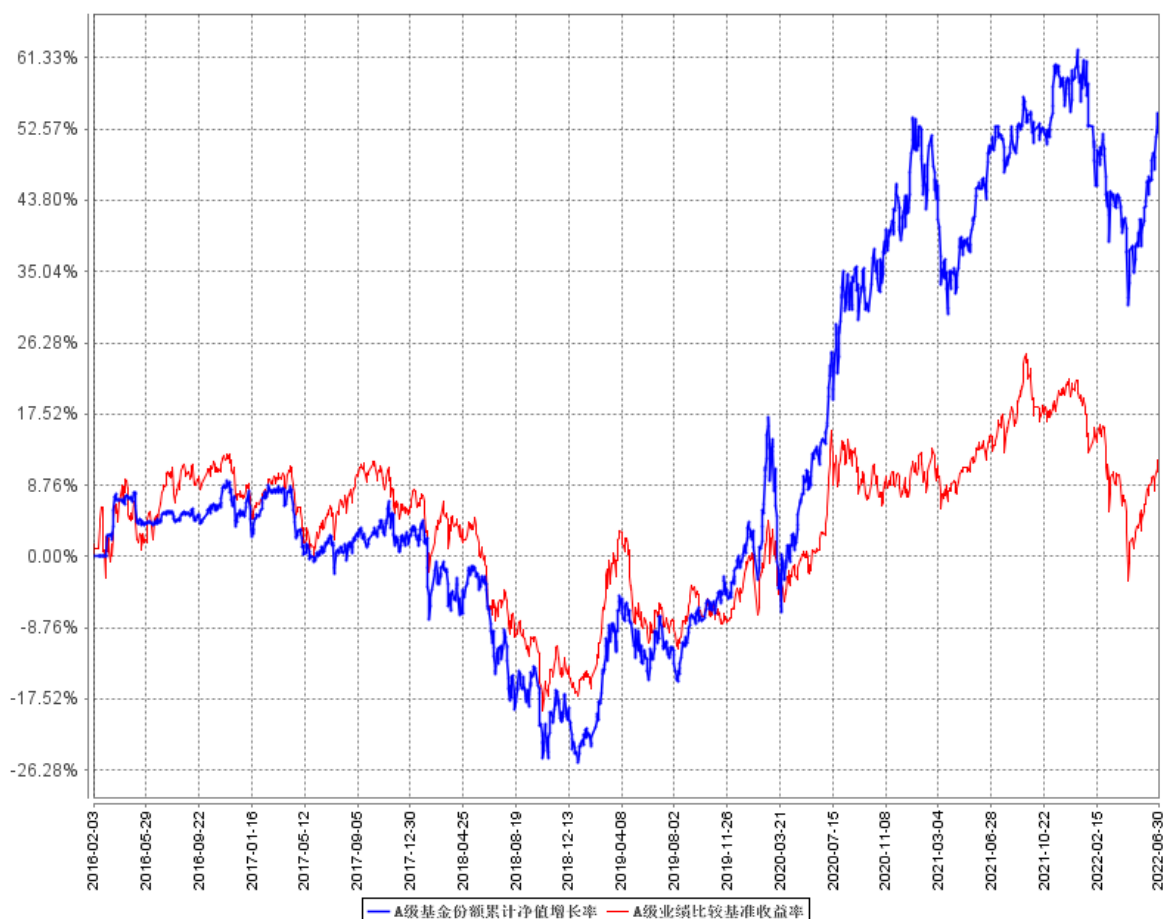
注：1、比较基准=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率

2、本基金于 2022 年 2 月 21 日开始分为 A、C 两类。

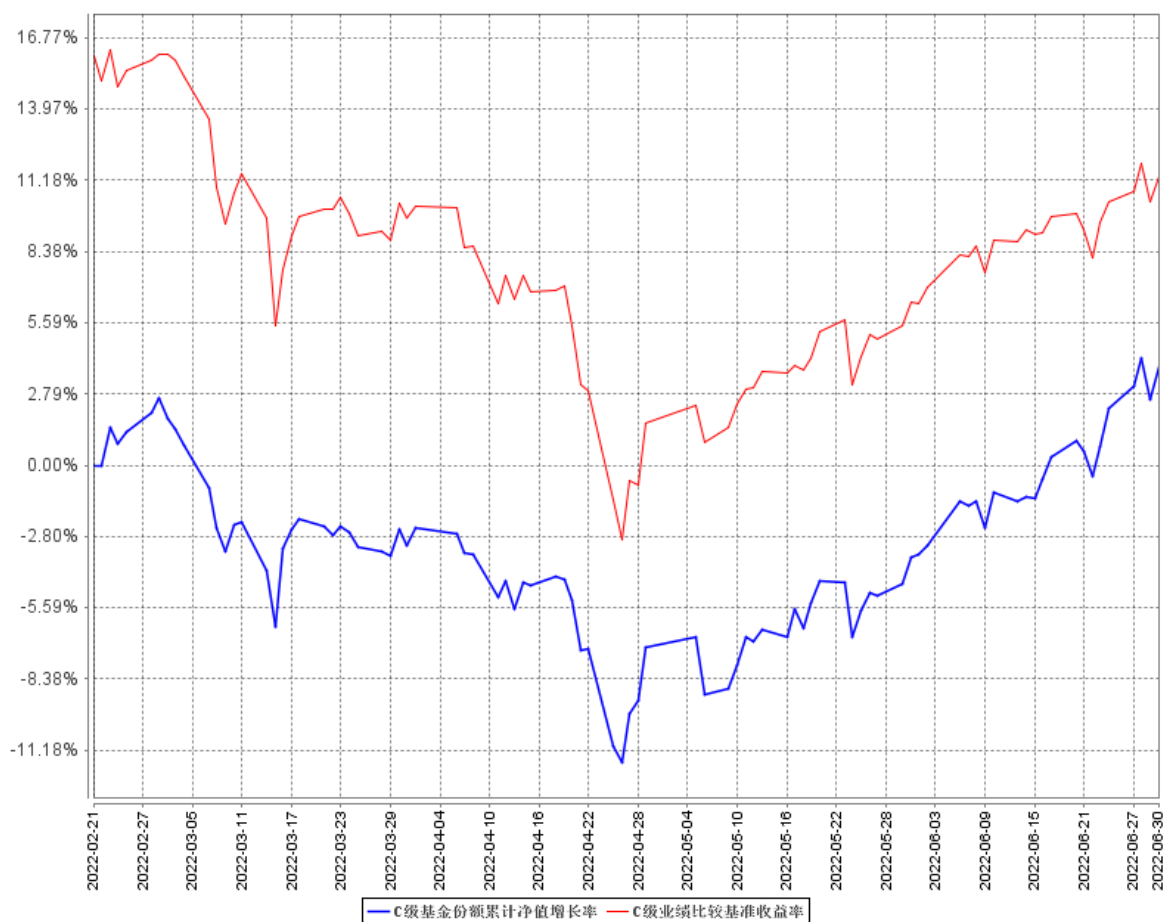
3、本基金 C 类份额在 2022 年 2 月 22 日前无有效份额，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于 2022 年 2 月 22 日起计算。

### 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=65%×中证 500 指数收益率+35%×中债综合全价（总值）指数收益率

2、本基金于 2022 年 2 月 21 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、本基金 C 类份额在 2022 年 2 月 22 日前无有效份额，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于 2022 年 2 月 22 日起计算。

## § 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。牢记“受人之托,待人理财”的根本使命,深耕细作夯实投研体系,打造核心竞争力;整合市场营销,构建立体式营销体系;全力做好人才工作,构建人才梯队;优化机制机制,一切业绩说话;紧抓时代机遇,做好创新产品运营管理。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求,进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型,力争在未来 3 年时间内,把公司建设成为具有核心竞争力的现代财富管理公司。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐增	基金经理	2018 年 10 月 12 日	-	11 年	徐增先生,中国国籍,香港中文大学哲学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职埃森哲咨询公司上海分公司行业研究员。2011 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司,现任基金经理。2015 年 5 月 12 日至 2018 年 11 月 20 日担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金（原东吴内需增长混合型证券投资基金）基金经理,2015 年 5 月 29 日至 2018 年 11 月 20 日担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金（原东吴创新创业混合型证券投资基金）基金经理,2015 年 5 月 29

					<p>日至 2018 年 12 月 6 日担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月 12 日至今担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月 16 日至今担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月 16 日至今担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月 22 日至今担任东吴双三角股票型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

市场在过去的半年里呈现先抑后扬的态势。根据 Wind 统计，最终上证指数下跌 6.63%，创业板指下跌 15.41%。期间，部分高景气行业表现较好。

本报告期内，上半年东吴安盈量化基金配置相对均衡，以低估值蓝筹和价值白马股为主，配置相对保守，上半年跌幅为 3.91%，跑赢了上证指数和创业板指。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴安盈量化混合 A 基金份额净值为 1.1494 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.96%，同期业绩比较基准收益率为-7.86%；截至本报告期末东吴安盈量化混合 C 基金份额净值为 1.1483 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.88%；同期业绩比较基准收益率为-3.90%。

## 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，2022 年下半年中国经济有望环比回升。国内经济自 2021 年下半年呈现减速迹象，并在 2022 年上半年遭受本土奥密克戎疫情黑天鹅冲击，国内 GDP 增速从 2022 年一季度的 4.8% 降至二季度的 0.4%。在国内稳增长政策发力和海外出口超预期的驱动下，国内经济稳步走出二季度的疫情冲击，环比不断修复改善。当前经济的拖累项主要是地产和居民消费，支撑项则是“出口-制造业”链条和基建。下半年出口链条预计仍有望维持韧性，一方面是因为中国拥有全产业链生产优势，另一方面全球疫后修复节奏错位，2022 年预计可能是全球企业生产修复带动的工业用品需求支撑中国出口。在稳增长政策下，下半年国内基建预计可能相对平稳，有望对冲地产投资的萎靡。综合考虑房住不炒和防风险的基调，预计下半年地产风险可能相对可控，并且有一定概率呈现弱修复。消费方面，下半年大概率优于二季度疫情冲击时期，但考虑到疫情反复，下半年消费修复力度可能不会特别强。整体来说，下半年国内经济相比二季度有望环比逐渐改善，但整体呈现弱复苏的概率较大。

政策层面，2022 年上半年国内和海外呈现比较明显的分化，预计下半年依然可能是国内宽海外紧的货币政策格局。国内在今年上半年继续降准降息，展望下半年，国内通胀压力预计或可控，考虑到经济稳增长的需求仍在，国内下半年大概率继续保持中性偏宽松的货币政策格局。6 月份社融数据已有明显改善，预计下半年国内信用环境也有望维持偏宽。反观海外，由于通胀压力持

续超预期，主要经济体央行均进入紧缩周期。2022 年上半年美联储开启近 30 年来最激进的加息周期，今年 3 月加息 25bp、5 月加息 50bp、6 月加息 75bp，上半年共累计加息 150bp，预计下半年或将加息 175bp。国内和海外货币政策之所以会发生分化，原因是各自所处的环境不同。中国的通胀压力相对较小，但稳增长的压力相对较大；以美国为代表的海外发达国家，通胀的压力相对较大，而就业压力相对较小。

资本市场方面，我们认为 2022 年下半年需要把握的核心脉络可能是国内经济环比修复，预计下半年市场向上机会可能大于向下风险。国内经济环比修复意味着企业盈利相对二季度有望逐级修复，叠加国内流动性中性偏宽，这对权益市场来说可能是个相对有利的组合。风格层面上，预计下半年市场风格可能仍然以成长为主，主要原因是下半年经济大概率是弱复苏而不是强修复，成长相对价值可能更为受益。具体行业配置方向上，我们认为需要结合好自上而下的宏观经济政策和自下而上的行业景气度。我们将继续在成长板块中努力挖掘景气度相对优势的方向，优选长期逻辑顺且短中期高景气有望延续的行业，比如清洁能源板块中的智能汽车、光伏、风电、储能，高端制造中的军工等，此外估值合理的医药板块也可从战略视角逐步关注起来。消费主要受疫情修复驱动，有望带动部分线下消费、线下出行修复，但由于疫情的反复性，消费修复的斜率可能会比较温和。

基于以上分析，下半年东吴安盈量化基金在一贯投资风格的前提下，重点关注以新能源为代表的高景气行业，努力实现绝对收益目标。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由分管运营的公司副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，分管运营的公司副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；公司副总经理、基金会计等参与基金组合估

值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内已实施利润分配 3 次，共分配利润 58,281,514.56 元，符合基金合同的有关约定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在东吴安盈量化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安盈量化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关东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	79,008,354.72	173,007,721.03
结算备付金		840,028.16	255,650.61
存出保证金		213,674.90	65,149.41
交易性金融资产	6.4.7.2	377,212,249.06	282,964,545.66
其中：股票投资		377,212,249.06	282,964,545.66
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	40,003,123.29	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	37,745,288.91
应收股利		-	-
应收申购款		15,467.00	130.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	37,586.86
资产总计		497,292,897.13	494,076,073.28
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
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		-	-

应付赎回款		6,046.03	94,470.21
应付管理人报酬		602,380.35	636,384.10
应付托管费		100,396.73	106,064.03
应付销售服务费		14.14	-
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	338,953.46	315,238.64
负债合计		1,047,790.71	1,152,156.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	431,732,279.96	365,433,634.56
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	64,512,826.46	127,490,281.74
净资产合计		496,245,106.42	492,923,916.30
负债和净资产总计		497,292,897.13	494,076,073.28

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，东吴安盈量化混合 A 基金份额净值 1.1494 元，基金份额总额 431,687,757.40 份；东吴安盈量化混合 C 基金份额净值 1.1483 元，基金份额总额 44,522.56 份。东吴阿尔法混合份额总额合计为 431,732,279.96 份。

（2）以上比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-13,899,662.25	18,158,050.87
1.利息收入		461,988.18	419,840.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	458,018.96	220,362.58
债券利息收入		-	199,478.14
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		3,969.22	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,259,380.80	62,870,818.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-7,582,458.16	60,207,964.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	128,240.00
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	4,323,077.36	2,534,613.66
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	-11,269,978.41	-45,135,613.54
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	167,708.78	3,005.64
<b>减：二、营业总支出</b>		4,267,273.77	4,940,029.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,561,971.79	3,605,200.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	593,662.06	600,866.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,594.77	-
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	109,045.15	733,962.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,166,936.02	13,218,021.00
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,166,936.02	13,218,021.00
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-18,166,936.02	13,218,021.00

注：以上比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

**6.3 净资产（基金净值）变动表**

会计主体：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	365,433,634.56	-	127,490,281.74	492,923,916.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	365,433,634.56	-	127,490,281.74	492,923,916.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	66,298,645.40	-	-62,977,455.28	3,321,190.12
（一）、综合收益总额	-	-	-18,166,936.02	-18,166,936.02
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	66,298,645.40	-	13,470,995.30	79,769,640.70
其中：1.基金申购款	94,091,924.98	-	19,367,502.30	113,459,427.28
2.基金赎回款	-27,793,279.58	-	-5,896,507.00	-33,689,786.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值	-	-	-58,281,514.56	-58,281,514.56

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(基金净值)	431,732,279.96	-	64,512,826.46	496,245,106.42
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金净值)	365,731,706.12	-	141,316,948.46	507,048,654.58
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	365,731,706.12	-	141,316,948.46	507,048,654.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-95,095.56	-	-12,413,587.77	-12,508,683.33
(一)、综合收益总额	-	-	13,218,021.00	13,218,021.00
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值变 动数(净值减少以“-” 号填列)	-95,095.56	-	-32,497.20	-127,592.76
其中: 1.基金申购款	508,560.98	-	172,335.29	680,896.27
2.基金赎回款	-603,656.54	-	-204,832.49	-808,489.03
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产生 的基金净值变动(净值 减少以“-”号填列)	-	-	-25,599,111.57	-25,599,111.57

（四）、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	365,636,610.56	-	128,903,360.69	494,539,971.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东吴安盈量化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”）证监许可[2015]2795 号文《关于同意东吴安盈量化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 2 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 211,164,009.95 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据 2022 年 02 月 18 日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴安盈量化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》，2022 年 02 月 21 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《东吴安盈量化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：002270；C 类基金份额代码：015154）。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： $65\% \times$  中证 500 指数收益率 $+35\% \times$  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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年半年度的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 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

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，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。

#### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 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)其他收入在经济利益很可能流入从而导致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确认。

#### 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

在首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 173,007,721.03 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 37,442.46 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列

示的账面价值为人民币 173,045,163.49 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 255,650.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 115.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 255,765.61 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 65,149.41 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 29.40 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 65,178.81 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 130.80 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 130.80 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 37,586.86 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 37,442.46 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 115.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 29.40 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息在新金融工具准则下不再单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 282,964,545.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 282,964,545.66 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

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

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

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

#### 2. 增值税

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

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

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

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

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

以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

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

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

### 5. 个人所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	79,008,354.72
等于：本金	78,985,620.87
加：应计利息	22,733.85
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：	79,008,354.72

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	378,780,178.25	-	377,212,249.06	-1,567,929.19
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	378,780,178.25	-	377,212,249.06	-1,567,929.19

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	40,003,123.29	-
合计	40,003,123.29	-

#### 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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	240,685.32
其中：交易所市场	240,090.56
银行间市场	594.76
应付利息	-
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	59,507.37
应付账户维护费	9,000.00

合计	338,953.46
----	------------

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴安盈量化混合 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	365,433,634.56	365,433,634.56
本期申购	66,527,574.66	66,527,574.66
本期赎回(以“-”号填列)	-273,451.82	-273,451.82
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	431,687,757.40	431,687,757.40

金额单位：人民币元

东吴安盈量化混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	-	-
本期申购	27,564,350.32	27,564,350.32
本期赎回(以“-”号填列)	-27,519,827.76	-27,519,827.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	44,522.56	44,522.56

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）从 2022 年 02 月 21 日起，本基金增设 C 类基金份额，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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴安盈量化混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	126,614,959.98	875,321.76	127,490,281.74



本期利润	-7,001,211.63	-11,464,276.10	-18,465,487.73
本期基金份额交易产生的变动数	22,719,182.65	-8,960,223.15	13,758,959.50
其中：基金申购款	22,806,159.84	-8,994,460.10	13,811,699.74
基金赎回款	-86,977.19	34,236.95	-52,740.24
本期已分配利润	-58,277,528.62	-	-58,277,528.62
本期末	84,055,402.38	-19,549,177.49	64,506,224.89

单位：人民币元

东吴安盈量化混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	104,254.02	194,297.69	298,551.71
本期基金份额交易产生的变动数	-95,708.38	-192,255.82	-287,964.20
其中：基金申购款	6,932,353.06	-1,376,550.50	5,555,802.56
基金赎回款	-7,028,061.44	1,184,294.68	-5,843,766.76
本期已分配利润	-3,985.94	-	-3,985.94
本期末	4,559.70	2,041.87	6,601.57

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	450,997.86
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	5,965.09
其他	1,056.01
合计	458,018.96

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	414,629,762.68
减：卖出股票成本总额	421,350,663.25
减：交易费用	861,557.59
买卖股票差价收入	-7,582,458.16

### 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。

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资。

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,323,077.36
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	4,323,077.36

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,269,978.41
——股票投资	-11,269,978.41
——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	-11,269,978.41

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	167,708.78
合计	167,708.78

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
银行汇划费用	1,185.00
其他费用	600.00
合计	109,045.15

#### 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、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

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	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	739,601,042.67	79.64%	-	-

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份有限公司	160,742.46	48.05%	66,324.97	27.62%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,561,971.79	3,605,200.55
其中：支付销售机构的客户维护费	1,562.87	2,195.76

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	593,662.06	600,866.81

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴安盈量化混合 A	东吴安盈量化混合 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	2,557.43	2,557.43
合计	-	2,557.43	2,557.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴安盈量化混合 A	东吴安盈量化混合 C	合计
合计	-	-	-

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
交通银行股份有限公司	79,008,354.72	450,997.86	131,390,375.25	218,277.95

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

东吴安盈量化混合 A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022年 6月24 日	-	2022年 6月24 日	0.4000	17,263,071.33	3,908.91	17,266,980.24	
2	2022年 5月27 日	-	2022年 5月27 日	0.4000	17,263,077.90	3,598.68	17,266,676.58	

3	2022 年 4 月 22 日	-	2022 年 4 月 22 日	0.5500	23,738,128.75	5,743.05	23,743,871.80	
合计		-		1.3500	58,264,277.98	13,250.64	58,277,528.62	

## 东吴安盈量化混合 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	0.4000	1,225.09	197.94	1,423.03	
2	2022 年 5 月 27 日	-	2022 年 5 月 27 日	0.4000	1,623.55	53.28	1,676.83	
3	2022 年 4 月 22 日	-	2022 年 4 月 22 日	0.5500	699.90	186.18	886.08	
合计		-		1.3500	3,548.54	437.40	3,985.94	

## 6.4.12 期末（2022 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
688072	拓荆 科技	2022 年 4 月 12 日	1-6 个 月(含)	新股限 售	71.88	139.78	2,862	205,720.56	400,050.36	-
688322	奥比 中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	30.99	30.99	7,545	233,819.55	233,819.55	-
688295	中复 神鹰	2022 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	新股限 售	29.33	34.42	6,299	184,749.67	216,811.58	-
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	3.82	3.82	51,486	196,676.52	196,676.52	-
688400	凌 云 光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	21.93	21.93	8,951	196,295.43	196,295.43	-
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	33.65	33.65	5,747	193,386.55	193,386.55	-
301139	元道 通信	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	38.46	38.46	4,973	191,261.58	191,261.58	-
688270	臻镭	2022 年 1	1-6 个	新股限	61.88	59.87	3,072	190,095.36	183,920.64	-



	科技	月 20 日	月(含)	售						
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月(含)	新股限售	19.18	32.07	1,238	23,744.84	39,702.66	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	1-6 个月(含)	新股限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	1-6 个月(含)	新股限售	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	1-6 个月(含)	新股限售	52.03	56.42	392	20,395.76	22,116.64	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	1-6 个月(含)	新股限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	新股限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	新股限售	28.50	34.87	545	15,532.50	19,004.15	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	1-6 个月(含)	新股限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	新股限售	8.05	10.08	1,750	14,087.50	17,640.00	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	1-6 个月(含)	新股限售	33.68	43.98	378	12,731.04	16,624.44	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	新股限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	1-6 个月(含)	新股限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	1-6 个月(含)	新股限售	76.56	51.92	292	22,355.52	15,160.64	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	1-6 个月(含)	新股限售	48.53	31.38	458	22,228.40	14,372.04	送股
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	新股限售	32.69	32.02	442	14,450.00	14,152.84	送股
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	新股限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	1-6 个月(含)	新股限售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	1-6 个月(含)	新股限售	108.71	82.76	164	17,828.04	13,572.64	送股
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	1-6 个月(含)	新股限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	1-6 个月(含)	新股限售	35.68	29.84	420	14,985.60	12,532.80	-

301148	嘉戎技术	2022年4月14日	1-6个月(含)	新股限售	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	1-6个月(含)	新股限售	39.88	31.09	390	15,553.20	12,125.10	-
301116	益客食品	2022年1月10日	1-6个月(含)	新股限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301258	富士莱	2022年3月21日	1-6个月(含)	新股限售	48.30	41.68	280	13,524.00	11,670.40	-
301220	亚香股份	2022年6月15日	1-6个月(含)	新股限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	1-6个月(含)	新股限售	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	1-6个月(含)	新股限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	1-6个月(含)	新股限售	96.82	87.82	115	11,134.72	10,099.30	送股
301151	冠龙节能	2022年3月30日	1-6个月(含)	新股限售	30.82	21.46	469	14,454.58	10,064.74	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	1-6个月(含)	新股限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
300834	星辉环材	2022年1月6日	1-6个月(含)	新股限售	55.57	30.03	314	17,448.98	9,429.42	-
301288	清研环境	2022年4月14日	1-6个月(含)	新股限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	1-6个月(含)	新股限售	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301110	青木股份	2022年3月4日	1-6个月(含)	新股限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	1-6个月(含)	新股限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301158	德石股份	2022年1月7日	1-6个月(含)	新股限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301279	金道科技	2022年4月6日	1-6个月(含)	新股限售	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	1-6个月(含)	新股限售	64.08	37.52	152	9,740.16	5,703.04	-

#### 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 2022 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 2022 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 2022 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

本基金的投资目标为通过灵活应用选股、择时量化策略，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，将风险控制在规定范围之内。

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。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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 2022年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	79,008,354.72	-	-	-	-	-	79,008,354.72
结算备付金	840,028.16	-	-	-	-	-	840,028.16
存出保证金	213,674.90	-	-	-	-	-	213,674.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	377,212,249.06	377,212,249.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	40,003,123.29	-	-	-	-	-	40,003,123.29

应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	15,467.00	15,467.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	120,065,181.07	-	-	-	-	377,227,716.06	497,292,897.13
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,046.03	6,046.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	602,380.35	602,380.35
应付托管费	-	-	-	-	-	100,396.73	100,396.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14.14	14.14
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	338,953.46	338,953.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,047,790.71	1,047,790.71
利率敏感度缺口	120,065,181.07	-	-	-	-	376,179,925.35	496,245,106.42
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	173,007,721.03	-	-	-	-	-	173,007,721.03
结算备付金	255,650.61	-	-	-	-	-	255,650.61
存出保证金	65,149.41	-	-	-	-	-	65,149.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	282,964,545.66	282,964,545.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	37,745,288.91	37,745,288.91
应收利息	-	-	-	-	-	37,586.86	37,586.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	130.80	130.80
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	173,328,521.05	-	-	-	-	320,747,552.23	494,076,073.28
负债	-	-	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	94,470.21	94,470.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	636,384.10	636,384.10
应付托管费	-	-	-	-	-	106,064.03	106,064.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	126,238.59	126,238.59
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	189,000.05	189,000.05
负债总计	-	-	-	-	-	1,152,156.98	1,152,156.98
利率敏感度缺口	173,328,521.05	-	-	-	-	-319,595,395.25	492,923,916.30

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

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资（2021年12月31日：同），计息资产仅包括银行活期存款、结算备付金、存出保证金，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息，买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著（2021年12月31日：同）。

#### 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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

**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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	377,212,249.06	76.01	282,964,545.66	57.41
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	377,212,249.06	76.01	282,964,545.66	57.41

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-4,832,434.85	-5,126,408.73
	2. 业绩基准下跌 5%	-24,162,174.23	-25,632,043.65
3. 业绩基准下跌 10%	-48,324,348.46	-51,264,087.30	

**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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	374,789,341.56	282,130,728.49
第二层次	1,076,875.15	190,468.37
第三层次	1,346,032.35	643,348.80
合计	377,212,249.06	282,964,545.66

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

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**

无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	377,212,249.06	75.85
	其中：股票	377,212,249.06	75.85
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	40,003,123.29	8.04
	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	79,848,382.88	16.06
8	其他各项资产	229,141.90	0.05
9	合计	497,292,897.13	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	19,798,608.00	3.99
C	制造业	235,732,386.36	47.50
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	31,819.38	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	23,451,890.83	4.73
H	住宿和餐饮业	6,751,427.78	1.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,175,493.29	1.65
J	金融业	23,318,145.00	4.70
K	房地产业	32,373,881.00	6.52
L	租赁和商务服务业	12,125.10	0.00
M	科学研究和技术服务业	57,459.51	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	209,008.92	0.04

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	207,539.39	0.04
R	文化、体育和娱乐业	27,092,464.50	5.46
S	综合	-	-
	合计	377,212,249.06	76.01

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	1,371,200	28,109,600.00	5.66
2	603626	科森科技	3,196,467	23,749,749.81	4.79
3	600029	南方航空	3,208,193	23,451,890.83	4.73
4	601398	工商银行	4,888,500	23,318,145.00	4.70
5	600519	贵州茅台	11,200	22,904,000.00	4.62
6	603806	福斯特	349,160	22,876,963.20	4.61
7	300395	菲利华	465,000	20,925,000.00	4.22
8	600028	中国石化	4,852,600	19,798,608.00	3.99
9	300750	宁德时代	29,300	15,646,200.00	3.15
10	002739	万达电影	1,104,850	15,081,202.50	3.04
11	002196	方正电机	1,410,000	13,761,600.00	2.77
12	000799	酒鬼酒	64,900	12,059,069.00	2.43
13	300133	华策影视	2,411,900	12,011,262.00	2.42
14	002915	中欣氟材	660,360	11,912,894.40	2.40
15	300207	欣旺达	290,900	9,192,440.00	1.85
16	600750	江中药业	615,556	8,814,761.92	1.78
17	002056	横店东磁	325,900	8,675,458.00	1.75
18	600096	云天化	274,100	8,628,668.00	1.74
19	002241	歌尔股份	253,000	8,500,800.00	1.71
20	601615	明阳智能	235,100	7,946,380.00	1.60
21	002624	完美世界	549,123	7,890,897.51	1.59
22	002563	森马服饰	1,327,400	7,858,208.00	1.58
23	002895	川恒股份	215,800	7,296,198.00	1.47
24	002460	赣锋锂业	45,800	6,810,460.00	1.37
25	301073	君亭酒店	97,367	6,751,427.78	1.36
26	600132	重庆啤酒	42,200	6,186,520.00	1.25

27	000858	五 粮 液	30,500	6,158,865.00	1.24
28	001914	招商积余	237,300	4,264,281.00	0.86
29	002791	坚朗五金	26,000	3,372,720.00	0.68
30	688297	C 无人机	8,045	427,833.10	0.09
31	688072	拓荆科技	2,862	400,050.36	0.08
32	688322	奥比中光	7,545	233,819.55	0.05
33	688295	中复神鹰	6,299	216,811.58	0.04
34	301175	中科环保	51,486	196,676.52	0.04
35	688400	凌 云 光	8,951	196,295.43	0.04
36	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.04
37	301139	元道通信	4,973	191,261.58	0.04
38	688270	臻镭科技	3,072	183,920.64	0.04
39	688251	井松智能	3,392	141,853.44	0.03
40	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.02
41	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
42	301238	瑞泰新材	1,238	39,702.66	0.01
43	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
44	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
45	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
46	301302	华如科技	392	22,116.64	0.00
47	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
48	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
49	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
50	301268	铭利达	545	19,004.15	0.00
51	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
52	301256	华融化学	1,750	17,640.00	0.00
53	301211	亨迪药业	807	17,495.76	0.00
54	301153	中科江南	378	16,624.44	0.00
55	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
56	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
57	301200	大族数控	292	15,160.64	0.00
58	301236	软通动力	458	14,372.04	0.00
59	301103	何氏眼科	442	14,152.84	0.00
60	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
61	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
62	301150	中一科技	164	13,572.64	0.00
63	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
64	301216	万凯新材	420	12,532.80	0.00
65	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00

66	301190	善水科技	517	12,268.41	0.00
67	301100	风光股份	565	12,192.70	0.00
68	301102	兆讯传媒	390	12,125.10	0.00
69	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
70	301258	富士莱	280	11,670.40	0.00
71	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
72	301096	百诚医药	143	11,297.00	0.00
73	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
74	301166	优宁维	177	10,418.22	0.00
75	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
76	301219	腾远钴业	115	10,099.30	0.00
77	301151	冠龙节能	469	10,064.74	0.00
78	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
79	300834	星辉环材	314	9,429.42	0.00
80	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
81	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
82	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
83	301189	奥尼电子	261	8,693.91	0.00
84	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
85	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
86	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
87	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
88	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
89	301196	唯科科技	152	5,703.04	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	300750	宁德时代	51,849,259.33	10.52
2	300274	阳光电源	39,985,000.00	8.11
3	603806	福斯特	29,981,163.00	6.08
4	300763	锦浪科技	27,984,103.60	5.68
5	002895	川恒股份	24,754,597.00	5.02
6	600519	贵州茅台	19,993,519.00	4.06
7	002915	中欣氟材	17,097,160.00	3.47
8	002196	方正电机	14,277,355.31	2.90

9	301073	君亭酒店	14,224,849.44	2.89
10	002056	横店东磁	14,164,574.00	2.87
11	600029	南方航空	13,670,632.98	2.77
12	600754	锦江酒店	11,974,237.00	2.43
13	000002	万科A	11,879,879.00	2.41
14	000498	山东路桥	11,868,632.00	2.41
15	601111	中国国航	11,155,439.00	2.26
16	000596	古井贡酒	9,996,673.12	2.03
17	000568	泸州老窖	9,989,213.00	2.03
18	000799	酒鬼酒	9,986,300.33	2.03
19	300896	爱美客	9,816,207.00	1.99
20	601615	明阳智能	9,805,529.00	1.99

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	300750	宁德时代	39,908,601.92	8.10
2	300274	阳光电源	38,056,082.10	7.72
3	300763	锦浪科技	30,758,290.00	6.24
4	002895	川恒股份	20,561,944.03	4.17
5	600029	南方航空	13,349,647.00	2.71
6	000498	山东路桥	11,896,836.00	2.41
7	301073	君亭酒店	11,862,032.24	2.41
8	000596	古井贡酒	11,774,800.00	2.39
9	600754	锦江酒店	11,692,327.00	2.37
10	601111	中国国航	11,315,652.00	2.30
11	300438	鹏辉能源	10,964,216.00	2.22
12	300896	爱美客	10,121,071.28	2.05
13	000568	泸州老窖	10,091,161.60	2.05
14	002241	歌尔股份	9,370,868.00	1.90
15	300395	菲利华	8,303,378.00	1.68
16	002056	横店东磁	7,319,171.13	1.48
17	002837	英维克	7,093,298.49	1.44
18	601800	中国交建	6,851,323.00	1.39

19	600547	山东黄金	6,225,762.00	1.26
20	000887	中鼎股份	5,487,919.76	1.11

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	526,868,345.06
卖出股票收入（成交）总额	414,629,762.68

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.2 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券中“工商银行（证券代码：601398）”的发行主体具有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	213,674.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,467.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	229,141.90

### 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
东吴安盈量化混合 A	348	1,240,482.06	431,215,097.35	99.89%	472,660.05	0.11%
东吴安盈量化混合 C	82	542.96	0.00	-	44,522.56	100.00%
合计	430	1,004,028.56	431,215,097.35	99.88%	517,182.61	0.12%

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。

### 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	东吴安盈量化混合 A	10,790.66	0.0025%
	东吴安盈量化混合 C	88.04	0.1977%
	合计	10,878.70	0.0025%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴安盈量化混 合 A	东吴安盈量化混 合 C
基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）基金份 额总额	211,164,009.95	-
本报告期期初基金份额总额	365,433,634.56	-
本报告期基金总申购份额	66,527,574.66	27,564,350.32
减：本报告期基金总赎回份额	273,451.82	27,519,827.76
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	431,687,757.40	44,522.56

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 2022 年 2 月 21 日开始分为 A、C 两类。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人发生以下人事变动：

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、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	
东吴证券	2	739,601,042.67	79.64%	160,742.46	48.05%	-
广发证券	3	186,797,158.95	20.11%	173,243.29	51.79%	-
招商证券	2	2,263,528.00	0.24%	522.30	0.16%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

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

（全面性、及时性和高效性）等方面。

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

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金新增交易单元 3 个，为开源证券 1 个、华融证券 2 个。

### 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

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。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 2021 年年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金和私募资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022 年 1 月 1 日
3	东吴基金管理有限公司关于终止科地瑞富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 12 日
4	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 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	2022 年 1 月 24 日
5	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 1 月 24 日
6	东吴基金管理有限公司关于东吴安盈量化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	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 18 日
7	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同更新	公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 18 日
8	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议更新	公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 18 日
9	东吴基金管理有限公司关于	上海证券报、公司网	2022 年 2 月 21 日

	旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值和份额累计净值计算与披露方法的说明公告	站、中证信息网站	
10	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)提示性公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 23 日
11	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 23 日
12	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海银基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 2 月 28 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额新增代销机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 4 日
14	东吴基金管理有限公司关于参加广发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	2022 年 3 月 25 日
15	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 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	2022 年 3 月 31 日
16	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 3 月 31 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 7 日
18	关于提高东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额净值精度的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 7 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为代销机构、开	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2022 年 4 月 9 日

	通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中证信息网站	
20	东吴基金管理有限公司关于参加泰信财富基金销售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	2022 年 4 月 11 日
21	2022 年度东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 20 日
22	东吴基金管理有限公司旗下基金 2022 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	2022 年 4 月 22 日
23	东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 22 日
24	东吴基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 4 月 29 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 10 日
26	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司同业易管家平台为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 20 日
27	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2022 年 5 月 23 日
28	2022 年度东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 26 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 5 月 27 日

30	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所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	2022 年 6 月 8 日
31	2022 年度东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 22 日
32	东吴基金管理有限公司关于参加平安证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2022 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220630	101,831,975.56	0.00	0.00	101,831,975.56	23.59%
	2	20220101-20220630	138,894,389.06	0.00	0.00	138,894,389.06	32.17%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴安盈量化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、报告期内东吴安盈量化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。

### 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

2022 年 8 月 31 日