

东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合  
资产管理计划  
2025 年第 2 季度报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴证券股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 07 月 16 日

§ 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2025 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 东吴裕盈一年持有期混合                                                                                                                                                                                                    |
| 场内简称       | —                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 970043                                                                                                                                                                                                         |
| 前端交易代码     | —                                                                                                                                                                                                              |
| 后端交易代码     | —                                                                                                                                                                                                              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2021 年 8 月 27 日                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 101,183,142.41 份                                                                                                                                                                                               |
| 投资目标       | 本集合计划在严格控制风险的前提下，通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置，充分捕捉各子市场的绝对收益机会，力求集合计划资产的长期稳健增值。                                                                                                                                        |
| 投资策略       | 本集合计划将根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析，充分考虑大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性，形成前瞻性预测，以此确定股票、固定收益证券和现金等各类资产在给定区间内的动态配置，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货、国债期货、股票期权等投资策略；5、资产支持证券投资策略 |
| 业绩比较基准     | 中证 500 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%                                                                                                                                                                                  |

|                 |                                                                     |                 |                 |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 风险收益特征          | 本集合计划为混合型集合计划，其风险收益水平低于股票型基金和股票型集合计划，高于债券型基金、债券型集合计划、货币型基金和货币型集合计划。 |                 |                 |
| 基金管理人           | 东吴证券股份有限公司                                                          |                 |                 |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司                                                          |                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 东吴裕盈 A 份额                                                           | 东吴裕盈 B 份额       | 东吴裕盈 C 份额       |
| 下属分级基金的场内简称     | -                                                                   | -               | -               |
| 下属分级基金的交易代码     | 970043                                                              | 970044          | 970045          |
| 下属分级基金的前端交易代码   | -                                                                   | -               | -               |
| 下属分级基金的后端交易代码   | -                                                                   | -               | -               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 54,162,028.55 份                                                     | 29,513,738.01 份 | 17,507,375.85 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征   | -                                                                   | -               | -               |

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日） |               |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|---------------|
|                 | 东吴裕盈 A 份额                           | 东吴裕盈 B 份额     | 东吴裕盈 C 份额     |
| 1. 本期已实现收益      | -1,833,273.52                       | -929,014.86   | -682,889.13   |
| 2. 本期利润         | 1,141,233.87                        | 689,060.08    | 311,132.28    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0203                              | 0.0228        | 0.0165        |
| 4. 期末基金资产净值     | 45,668,425.71                       | 25,464,623.26 | 14,537,401.58 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8432                              | 0.8628        | 0.8304        |

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。

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

东吴裕盈 A 份额

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

|                |         |       |        |       |         |       |
|----------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月          | 2.63%   | 1.28% | 1.20%  | 0.87% | 1.43%   | 0.41% |
| 过去六个月          | 2.89%   | 1.26% | 2.28%  | 0.80% | 0.61%   | 0.46% |
| 过去一年           | 25.48%  | 1.48% | 13.84% | 1.02% | 11.64%  | 0.46% |
| 过去三年           | -8.64%  | 1.08% | 1.50%  | 0.80% | -10.14% | 0.28% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -15.68% | 1.06% | -2.07% | 0.81% | -13.61% | 0.25% |

东吴裕盈 B 份额

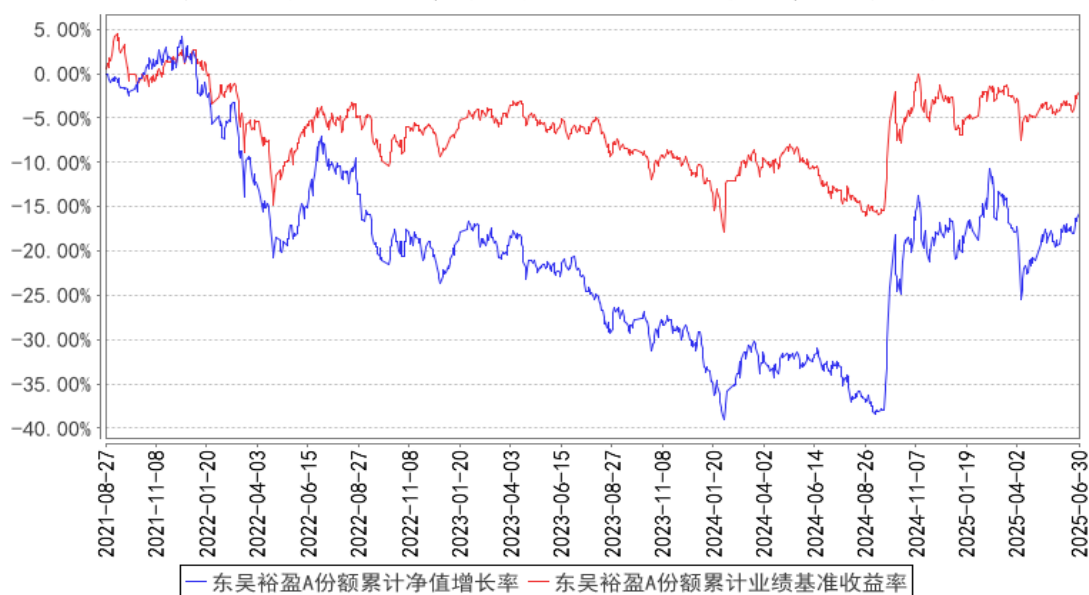
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③     | ②－④   |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 2.79%   | 1.28%         | 1.20%          | 0.87%                 | 1.59%   | 0.41% |
| 过去六个月          | 3.19%   | 1.26%         | 2.28%          | 0.80%                 | 0.91%   | 0.46% |
| 过去一年           | 26.23%  | 1.48%         | 13.84%         | 1.02%                 | 12.39%  | 0.46% |
| 过去三年           | -6.98%  | 1.08%         | 1.50%          | 0.80%                 | -8.48%  | 0.28% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -13.72% | 1.06%         | -2.07%         | 0.81%                 | -11.65% | 0.25% |

东吴裕盈 C 份额

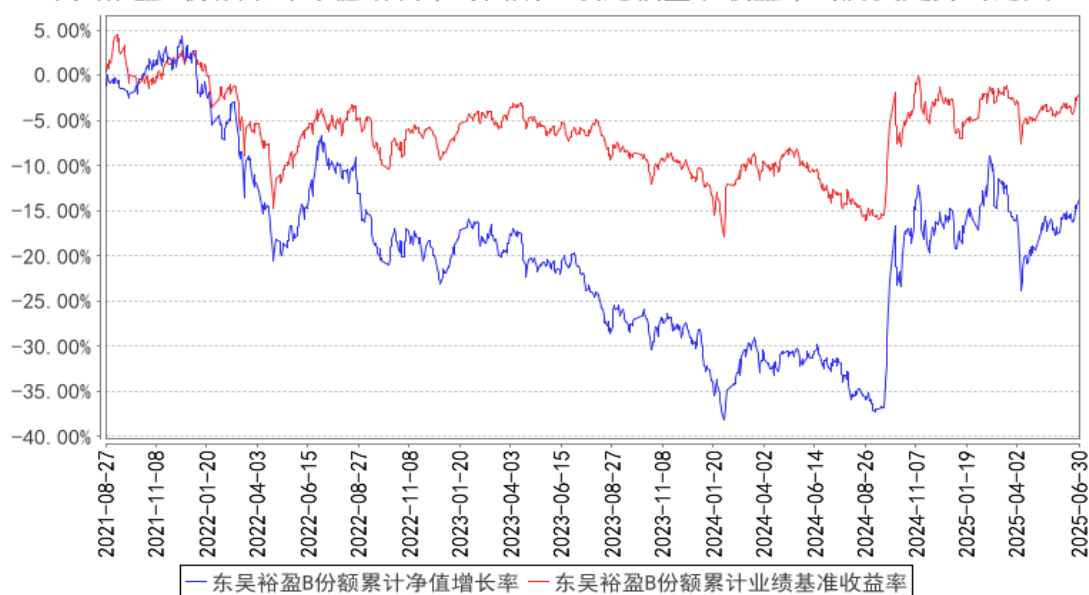
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③     | ②－④   |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 2.53%   | 1.28%         | 1.20%          | 0.87%                 | 1.33%   | 0.41% |
| 过去六个月          | 2.68%   | 1.26%         | 2.28%          | 0.80%                 | 0.40%   | 0.46% |
| 过去一年           | 24.98%  | 1.48%         | 13.84%         | 1.02%                 | 11.14%  | 0.46% |
| 过去三年           | -9.73%  | 1.08%         | 1.50%          | 0.80%                 | -11.23% | 0.28% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -16.96% | 1.06%         | -2.07%         | 0.81%                 | -14.89% | 0.25% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东吴裕盈A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



东吴裕盈B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



东吴裕盈C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



3.3 其他指标

单位：人民币元

| 其他指标 | 报告期（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日） |
|------|-------------------------------------|
| -    | -                                   |
| 其他指标 | 报告期末（2025 年 6 月 30 日）               |
| -    | -                                   |

注：无

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                           |
|-----|------|-----------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                              |
| 李果  | 投资经理 | 2021 年 8 月 27 日 | -    | 13 年   | 李果，工学博士，13 年以上证券从业经历。2008 年 2 月到 2011 年 9 月，任阿尔斯通电网（前为阿海珅输配电）研发项目经理和市场经理；2011 年 10 月加入东吴证券，历任东吴证券研究所行业研究员、东吴证券资产管理总部投资经理助理，现任东吴证券资产管理总部投资经理。 |
| 刘欣瑜 | 投资经理 | 2023 年 7 月 13 日 | -    | 7 年    | 刘欣瑜，复旦大学硕士。曾任职于上海期货信息技术有限公司、友山基金。2017 年加入东吴证券股份有限公司，历任东吴证券股份有限公司资产管理总部权益研究员，现任投资经理。                                                          |

注：（1）投资经理李果的任职日期是指公司公告本集合计划合同生效的日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 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

| 姓名 | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|---------|------|
| —  | 公募基金     | —       | —       | —    |
|    | 私募资产管理计划 | —       | —       | —    |
|    | 其他组合     | —       | —       | —    |
|    | 合计       | —       | —       | —    |

注：本报告期末，基金经理无兼任私募资管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，本管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规以及集合计划合同、招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关规定，通过各项内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，A 股市场受美国关税政策冲击，先抑后扬、大幅波动。4 月初，市场风险偏好下降，一季度表现强势的三大投资主线恒生科技、人工智能和机器人大幅回调，黄金、银行等避险品种持续上涨。随着恐慌情绪逐步释放、中美关税谈判启动，市场对于关税带来的负面影响逐渐钝化，风险偏好逐渐修复。海外，伊朗以色列冲突升级、美国降息预期升温；国内，提振内需政策频出，现象级 IP 潮玩出圈，多重因素推动下军工、银行、AI 算力、新消费和创新药成为二季度的领涨板块。

宽基指数方面，沪深 300、中证 500、国证 2000、创业板指和万得全 A 等宽基指数分别录得 1.25%、0.98%、4.41%、2.34%和 3.86%的涨跌幅表现。风格方面，哑铃风格再度占优，大盘价值和小盘成长表现较好，其余板块呈现出较快的轮动效应。

行业层面，排名靠前的行业为国防军工、银行和通信，涨跌幅分别为 15.01%、10.85%和 10.69%；排名靠后的行业为钢铁、家用电器和食品饮料，涨跌幅分别为-4.40%、-5.32%和-6.22%。

管理人在二季度灵活调整仓位，延用了哑铃型策略，并动态提高了银行、AI 算力和军工板块的配置比重，适当进行板块轮动。

展望三季度，我们认为市场仍以震荡走势为主，上下空间均有限。短期而言，市场基本面定价淡化，季末呈现“金融搭台，成长唱戏”的走势。但客观地说，二季度以来的这轮反弹，贸易争端引发的主流指数下跌基本得到修复，而外部经贸关系以及外围市场依然存在较大不确定性，国际经济数据亮点不多，政策层面的直接支撑也不显著，指数尚不具备趋势性上行的基础。中观行业层面，前期强势的 TMT 和机器人等方向总体表现低于预期，整体市场缺乏标杆式的主线。我们认为市场依然缺乏明确的向上动力，新一轮趋势性行情需要新的逻辑或者催化。

另一方面，管理层稳定资本市场政策深入人心，跌不深是一致预期。若出现国内宏观政策力度加大、或贸易争端超预期收尾，A 股上涨空间将被打开；流动性充裕背景下，政策和产业端具备持续催化的板块将是后续关注的重心。与此同时，红利低波品种在低利率时代具备中长期配置价值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本集合计划 A 份额净值增长率为 2.63%，本集合计划 B 份额净值增长率为 2.79%，本集合计划 C 份额净值增长率为 2.53%，业绩比较基准收益率为 1.20%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目   | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资 | 45,802,682.21 | 52.67        |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 其中：股票             | 45,802,682.21 | 52.67  |
| 2 | 基金投资              | —             | —      |
| 3 | 固定收益投资            | 9,200.76      | 0.01   |
|   | 其中：债券             | 9,200.76      | 0.01   |
|   | 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          | 33,000,000.00 | 37.95  |
|   | 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      | 6,896,576.61  | 7.93   |
| — | —                 | —             | —      |
| 8 | 其他资产              | 1,257,001.70  | 1.45   |
| 9 | 合计                | 86,965,461.28 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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              | 35,635,007.71 | 41.60        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —            |
| E  | 建筑业              | 1,009,008.00  | 1.18         |
| F  | 批发和零售业           | 1,291,520.00  | 1.51         |
| 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  | 2,428,229.50  | 2.83         |
| J  | 金融业              | 5,438,917.00  | 6.35         |
| K  | 房地产业             | —             | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —             | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —            |
| P  | 教育               | —             | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —             | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —             | —            |
| S  | 综合               | —             | —            |
|    | 合计               | 45,802,682.21 | 53.46        |

注：报告期末，本集合计划未持有港股通股票。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
| -    | -         | -            |
| 合计   | -         | -            |

注：本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 002126 | 银轮股份 | 104,600 | 2,539,688.00 | 2.96         |
| 2  | 300502 | 新易盛  | 19,400  | 2,464,188.00 | 2.88         |
| 3  | 688088 | 虹软科技 | 50,326  | 2,428,229.50 | 2.83         |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 65,000  | 2,254,850.00 | 2.63         |
| 5  | 002850 | 科达利  | 19,500  | 2,206,815.00 | 2.58         |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 29,100  | 2,101,020.00 | 2.45         |
| 7  | 601077 | 渝农商行 | 290,400 | 2,073,456.00 | 2.42         |
| 8  | 688270 | 臻镭科技 | 43,812  | 2,039,886.72 | 2.38         |
| 9  | 300750 | 宁德时代 | 8,000   | 2,017,760.00 | 2.36         |
| 10 | 603308 | 应流股份 | 75,500  | 1,742,540.00 | 2.03         |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -        | -            |
| 2  | 央行票据      | -        | -            |
| 3  | 金融债券      | -        | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -        | -            |
| 4  | 企业债券      | -        | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -        | -            |
| 6  | 中期票据      | -        | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 9,200.76 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -        | -            |
| -  | -         | -        | -            |
| 9  | 其他        | -        | -            |
| 10 | 合计        | 9,200.76 | 0.01         |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|----------|--------------|
| 1  | 123257 | 安克转债 | 92    | 9,200.76 | 0.01         |

注：本集合计划本报告期末仅持有 1 支债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
| -  | -    | -    | -     | -       | -            |

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.7 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

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------|-------|-------|---------|--------------|
| -  | -     | -     | -     | -       | -            |

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属资产。

5.8 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权证投资明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
| -  | -    | -    | -     | -       | -            |

注：本集合计划本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -    |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -    |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | -    |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -    |

注：本集合计划本报告期末未持有股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划对股指期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。管理人将遵守谨慎性原则，严格控制投资股指期货空头的合约价值，使之与股票组合的多头价值相对应，以对冲特殊情况下的流动性风险，改善组合的风险收益特性。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。管理人将结合国债交易市场 and 期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

## 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|--------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -      |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -      |
| 国债期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | -      |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -      |

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货投资。

## 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期内未进行国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

## 5.11.1 本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

报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 5.11.2 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

本集合计划投资的前十名股票在本报告期内未超出集合计划合同规定的备选股票库。

## 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 89,357.76    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,167,643.94 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| -  | -       | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,257,001.70 |

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|---------|--------------|
| -  | -    | -    | -       | -            |

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|------|------|--------------------|-------------------|--------------|
| -  | -    | -    | -                  | -                 | -            |

注：本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 东吴裕盈 A 份额     | 东吴裕盈 B 份额     | 东吴裕盈 C 份额     |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 58,685,395.84 | 30,509,255.34 | 20,298,187.20 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,031.25      | -             | 77,294.74     |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 4,525,398.54  | 995,517.33    | 2,868,106.09  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 54,162,028.55 | 29,513,738.01 | 17,507,375.85 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                        | 东吴裕盈 A 份额 | 东吴裕盈 B 份额    | 东吴裕盈 C 份额 |
|---------------------------|-----------|--------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额          | -         | 5,040,277.39 | -         |
| 报告期期间买入/申购总份额             | -         | -            | -         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额             | -         | -            | -         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | -         | 5,040,277.39 | -         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | -         | 4.98         | -         |

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|------|---------|---------|---------|
| -  | -    | -    | -       | -       | -       |
| 合计 |      |      | -       | -       |         |

注：本报告期内，集合计划管理人未运用固有资金申购或赎回本集合计划。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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     | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -       |
| 个人     | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -       |
| -      | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -       |
| 产品特有风险 |                |                         |      |      |      |            |         |
|        |                |                         |      |      |      |            |         |

注：本报告期内，本集合计划未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过本集合计划总份额 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，除已公告信息外，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1. 中国证监会关于准予东吴财富 1 号集合资产管理计划（展期）合同变更的回函；
- 2. 东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书；
- 3. 东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 4. 东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议；
- 5. 管理人业务资格批件和营业执照；
- 6. 报告期期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东新区源深北路 38 弄富源置地广场 3 幢 2 号。

9.3 查阅方式

- 1. 书面查阅：可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

2. 网络查阅：管理人网站：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)。

东吴证券股份有限公司

2025 年 07 月 16 日