

# 东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合 资产管理计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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

送出日期：2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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 2022 年 3 月 28 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。

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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 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>5</b>
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	17
4.10 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 .....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	18
6.2 审计报告的基本内容 .....	18
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	59
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	62
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划		
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		
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		
报告期末基金份额总额	233,632,939.65 份		
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起 3 年后,按照中国证监会有关规定执行。		
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	134,309,541.67 份	35,835,789.80 份	63,487,608.18 份

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。

### 2.2 基金产品说明

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。
--------	---

## 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	东吴证券股份有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王硕
	联系电话	021-60199757
	电子邮箱	xuxue@dwzq.com.cn
客户服务电话	95330	95559
传真	021-60199532	021-62701216
注册地址	苏州市工业园区星阳街5号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区源深北路38弄富源置地广场3幢2号	中国（上海）长宁区仙霞路188号
邮政编码	200127	200336
法定代表人	范力	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dwzq.com.cn/">http://www.dwzq.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
-	-	-

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年8月27日(集合计划合同生效日)-2021年12月31日		
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
本期已实现收益	5,044,811.83	1,595,296.65	2,268,394.33
本期利润	4,138,885.60	1,307,320.10	1,939,693.64
加权平均	0.0346	0.0366	0.0348

基金份额 本期利润			
本期加权 平均净值 利润率	3.43%	3.53%	3.42%
本期基金 份额净值 增长率	2.46%	2.66%	2.32%
3.1.2 期 末数据和 指标	2021 年末		
期末可供 分配利润	3,298,341.72	953,327.66	1,474,636.16
期末可供 分配基金 份额利润	0.0246	0.0266	0.0232
期末基金 资产净值	137,607,883.39	36,789,117.46	64,962,244.34
期末基金 份额净值	1.0246	1.0266	1.0232
3.1.3 累 计期末指 标	2021 年末		
基金份额 累计净值 增长率	2.46%	2.66%	2.32%

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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。

（4）本集合计划合同于 2021 年 8 月 27 日生效。

## 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.64%	0.67%	2.75%	0.45%	1.89%	0.22%
自基金合同生效起至今	2.46%	0.60%	2.74%	0.56%	-0.28%	0.04%

## 东吴裕盈 B 份额

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.79%	0.67%	2.75%	0.45%	2.04%	0.22%
自基金合同生效起至今	2.66%	0.63%	2.74%	0.56%	-0.08%	0.07%

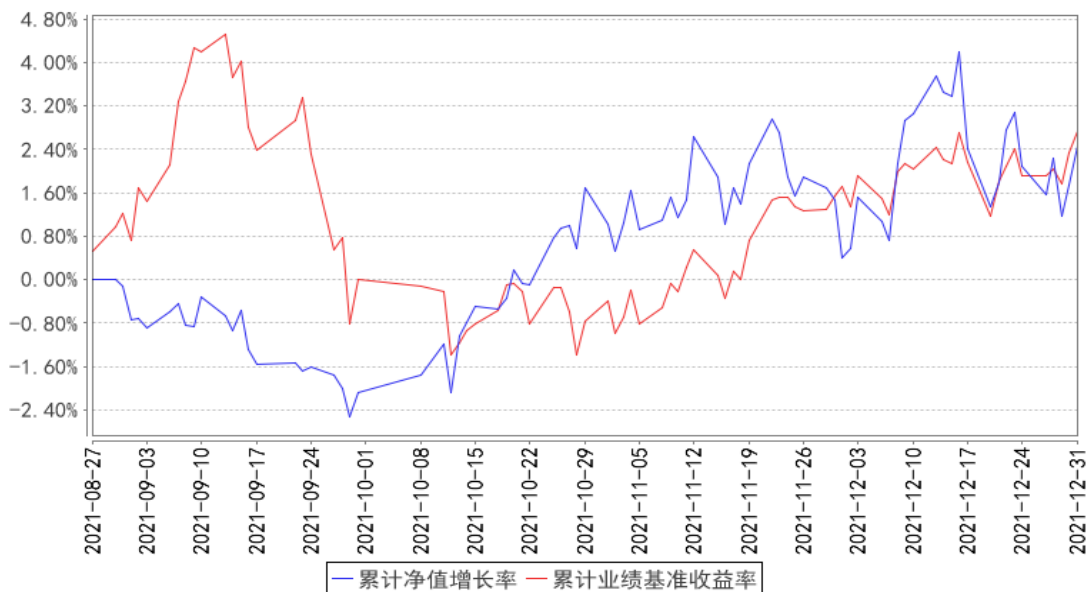
## 东吴裕盈 C 份额

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.51%	0.67%	2.75%	0.45%	1.76%	0.22%
自基金合同生效起至今	2.32%	0.60%	2.74%	0.56%	-0.42%	0.04%

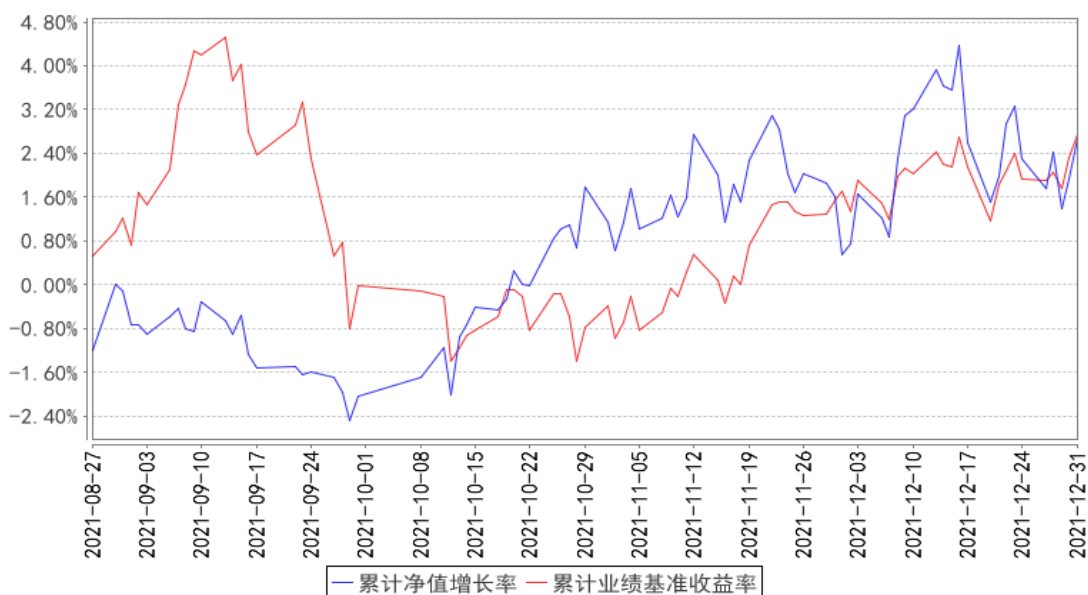


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

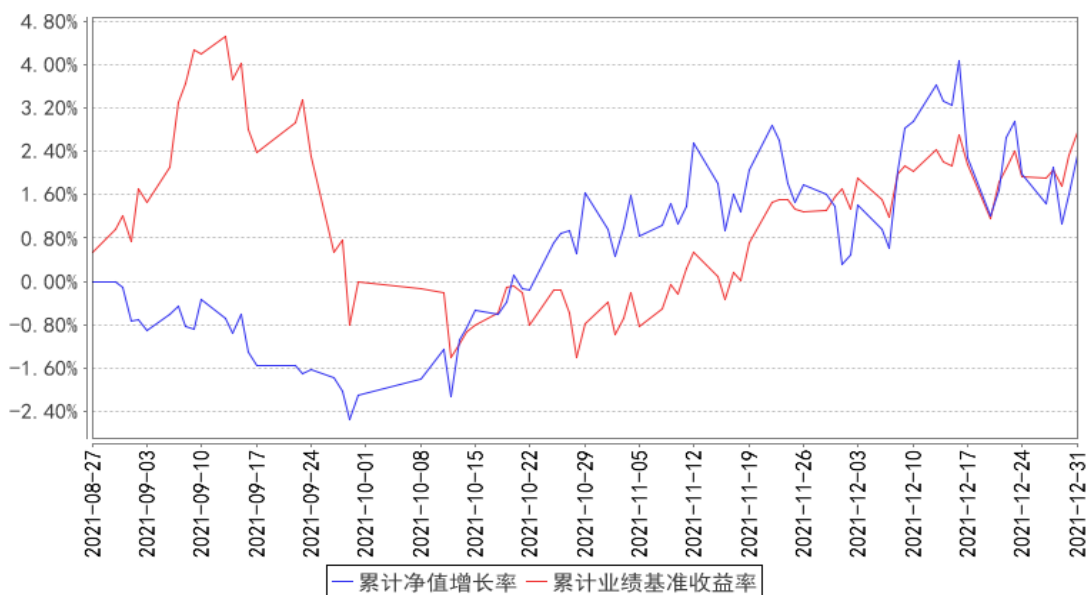
东吴裕盈A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



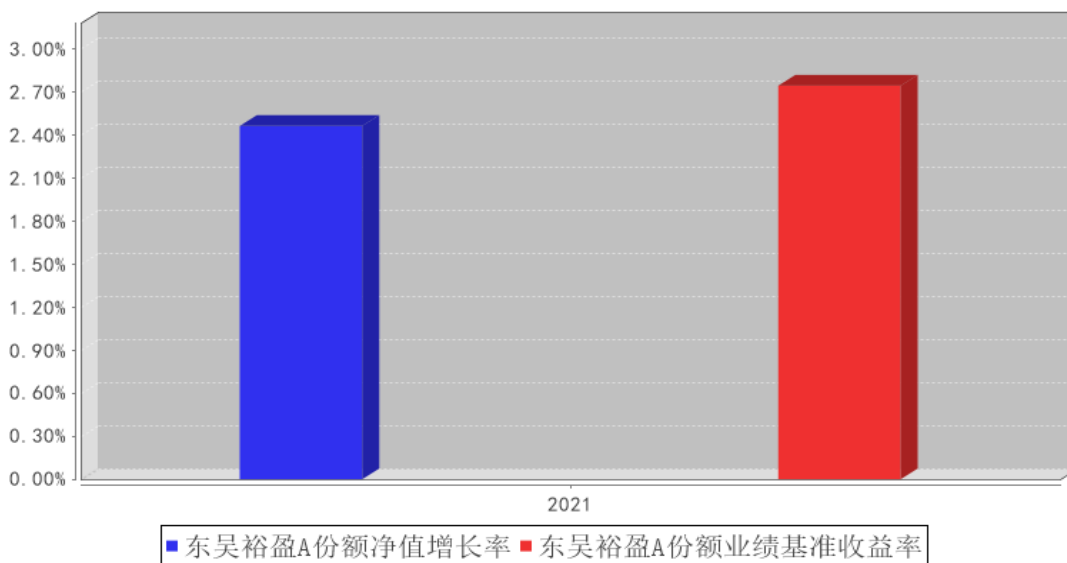
东吴裕盈C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



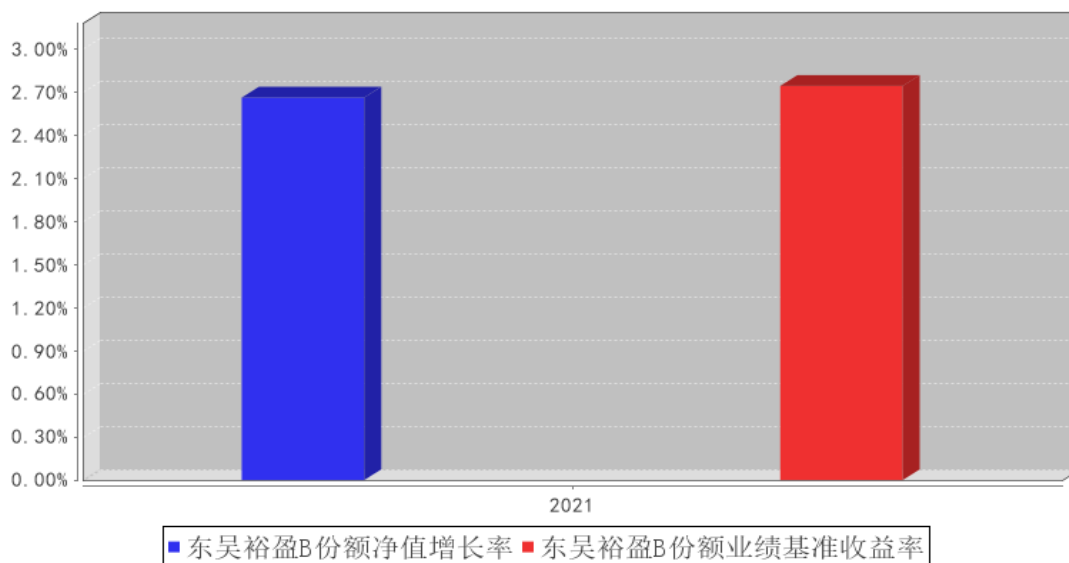
注：无。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

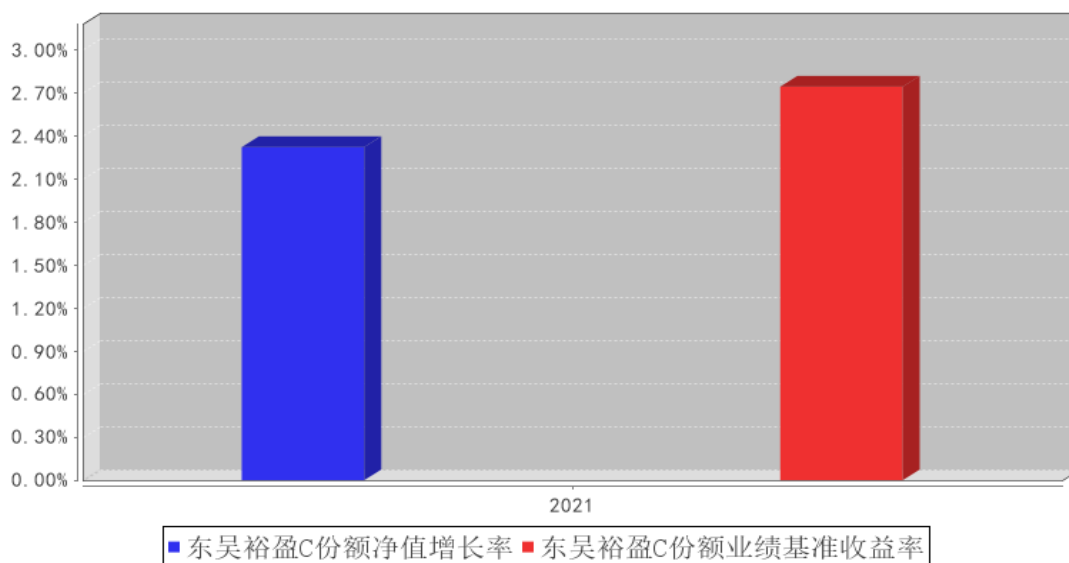
东吴裕盈A份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东吴裕盈B份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东吴裕盈C份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2021年12月31日）
-	-

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东吴裕盈 A 份额

年度	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	年度利润分配 合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## 东吴裕盈 B 份额

年度	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	年度利润分配 合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## 东吴裕盈 C 份额

年度	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	年度利润分配 合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：无。

## § 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

东吴证券股份有限公司（以下简称“东吴证券”或“公司”）前身苏州证券，于 1993 年 4 月 10 日在苏州成立，2011 年 12 月 12 日，东吴证券在上交所挂牌上市，股票简称“东吴证券”，股票代码“601555”。2021 年注册资本增加至 50.08 亿元人民币。

2002 年 8 月 13 日，东吴证券取得中国证监会出具的《关于核准东吴证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》（证监机构字[2002]244 号），成为中国首批可以从事受托资产管理业务的证券公司之一。

东吴证券依据中国证监会【2018】39 号公告《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》的指引，开展旗下大集合资管计划的改造业务，自合规管理、内部控制、风险管理等多个层面进行了规范，并配备了专门团队进行管理。截至 2021 年 12 月 31 日，旗下 3 只大集合资管计划完成公募化改造并进入运营，分别为“东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”、“东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划”和“东吴裕丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划”。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李果	投资经理	2021 年	-	10 年	李果, 工学博士, 10 年以上证券从业经历。

		08 月 27 日			2008 年 2 月到 2011 年 9 月，任阿尔斯通电网（前为阿海珐输配电）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。
--	--	-----------	--	--	---

注：（1）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《证券业从业人员资格管理办法》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

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

管理人对于基金经理主要考核投资业绩，绩效系数和基金经理 KPI 考核挂钩，薪酬激励与绩效系数及管理产品的业绩挂钩，以自然年度设定考评期限，定期检视。除此之外，对于投资过程中可能产生各类合规风险、客户投诉事件，将根据不同的情况予以不同程度奖金扣减。

#### 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人依据《证券法》、《证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、规范制定了《东吴证券股份有限公司资产管理总部公平交易管理办法》。管理人严格设置了相关流程，在一级、二级市场投资管理活动的授权、研究分析、投资决策、交易执行等环节建立公平交易的规则、监控、报告披露机制。通过具体的工作程序、技术手段确保公平交易的实现，并于事后进行必要的稽核和分析，以确保对过程和结果的控制。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

-

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本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 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

2021 年是新冠疫情肆虐全球的第二个年头。一方面，全球疫苗大规模接种，另一方面，病毒继续变异和疯狂传播。在此大环境下，中国经济依然表现出了不错的韧性。更为重要的是，中国并没有追随海外大经济体极度宽松的货币政策，也坚持了“房住不炒”原则，在稳健的货币政策下实现了恢复性增长。

当然，在疫情肆虐叠加双碳的大背景，“房住不炒”的大环境下，我们的经济生活依然面临一定的冲击。首当其冲的是，疫情下不少中小微企业经营困难，服务型企业受疫情冲击尤其显著，制造业企业深受原材料价格大幅上涨和三四季度停电的困扰。“三道红线”使得房地产企业流动性压力显著加大，大型房企开始出现债务违约事件。就业预期和收入预期都有所下降的背景下，消费恢复进度低于预期。

2021 年的 A 股市场呈现出窄幅波动和极致分化的格局。上证综指全年震幅仅 12.6%，这是 A 股历史上波动最低的一年。与此相对，各板块表现分化显著。一方面，沪深 300 指数出现了个位数的负收益，这显然不能和牛市画上等号；另一方面，“风光无限”，新能源相关的品种带动沪指连续第三年收红。除了疫情外，A 股市场的表现较好的诠释了国内当下治国理政的两大方向：共同富裕和双碳减排。

2021 年市场的另一大特点是，全年行业轮动速度大超预期。农历春节前白马股，3 月双碳概念，4 月医美，5 月白酒，6 月华为鸿蒙，7 月新冠疫苗，8 月煤炭和钢铁，9 月石化产品，10 月绿电，11 月元宇宙，12 月低价股，板块和题材轮番表现，热点切换频繁。与此同时，量化资金大扩容，借着市场的宽裕的流动性，将板块的轮动推向极致。两市日均成交量长时间保持在 1 万亿以上的高水平。

管理人长期关注和跟踪硬核制造和消费升级板块。仓位 80%以上集中于光伏、制造、半导体、消费等板块。全年而言，投资业绩显著跑赢了市场关注较多的沪深 300 指数，但落后于中证 500 指数。整体来看，投资操作不乏亮点，但需要反思之处依然不少。我们的组合长期关注硬核科技和消费升级的投资机会，对周期品种关注较少，除了新能源相关的部分周期方向（稀土为代表），我们参与度不高。这是行业覆盖范围的问题，也是路径依赖的部分折射。我们在保证扎实研究的基础上，力争扩大自己的能力圈范围。另一方面，消费升级板块和半导体材料板块的部分品种业绩低于预期，我们也有一定的提前预判，但从中长期发展前景层面没有及时降低仓位，给产品的净值带来一定的负面影响。在量化资金的带动下，市场越来越多地短期化来对待投资机会，以后我们也要更加灵活，适当增加波段操作的频率。

产品长期关注硬核科技和消费升级的投资机会。

我们依然倾向于长期确定性更高的方向上进行中线布局。在指数难见趋势性机会的大前提下，我们优选自下而上围绕几大方向来进行布局。其一，碳中和与高质量发展；其二，共同富裕；其三，逆境转型突破。

我们继续看好能耗双控和碳中和大方向的新能源车，光伏风电产业链，科技硬制造的半导体（特别是上游设备和材料）。分布式光伏和新型电力系统是值得重点关注的细分方向。考虑到 22 年的景气方向上的业绩和估值分化，景气会更加稀缺，我们会提升对板块品种的估值容忍度，更多采用自下而上的逻辑来选股。

在转型突破上，我们看好传统能源企业转型绿电运营，传统消费电子转型汽车电子和汽车零配件供应商，TMT 板块中能落地元宇宙硬件和应用的品种，计算机中高度受益数字经济的品种。另一方面，部分必选和可选大众消费品提价完成或提价进行时，受益 PPI 向 CPI 的品种，有 ROE 提升和估值修复的可能。

操作层面，考虑到外围货币政策紧缩的预期和地缘政治可能加大市场的波动幅度，也考虑到 2021 年以来量化资金对市场波动的强化，我们对觉得有必要适当提升操作的灵活性，增加波段操作的频率。

#### 4.4.2 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 2.46%，本集合计划 B 份额净值增长率为 2.66%，本集合计划 C 份额净值增长率为 2.32%，业绩比较基准收益率为 2.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先宏观经济层面。中央经济工作会议定调的，需求收缩、供给冲击、预期转弱，我们觉得比较符合当下经济的情况。出口方向上，我们觉得大概率是边际回落的判断。奥密克戎的新冠变

种目前来看将国外的群体免疫策略推向了高潮。主流的判断是，随着疫苗的普及和特效药的诞生，未来新冠传播会得到明显控制、经济逐步复苏。在此之后，各国的生产会开始复苏，同时各国保护本国产业和就业的倾向会强化，保护主义会上升，中国进出口对经济的贡献大概率边际回落。投资可能是 22 年经济增长三驾马车中最确定的环节。在房住不炒的大背景下，房地产开发投资趋势上是下降的，“托而不举”是大概率事件。在稳增长的大背景下，财政发力新老基建概率较大。绿色能源和数字经济有望成为新基建发力的主要方向。最后，疫情演变和国内现有防疫政策，我们对国内的消费增速较为悲观，能够保证平稳过渡，可能是比较理想的结果。相对而言，必选消费我们觉得有超越市场的能力。

流动性层面，联储的议息会议表态较为鹰派，加息时点和次数均可能超预期，同时可能叠加缩表。外围流动性的收缩可能导致资金的外流和汇率的大幅波动。相对而言，国内的流动性将呈现出宽松态势，同时货币政策将更加主动地发挥好总量和结构的双重功能。换言之，国内的货币政策相对外围，有更多的腾挪空间。同时，国内相对较宽的货币政策将叠加积极的财政政策。具体表现为，一方面，加快支出进度，继续减税降费，适度超前开展基础设施投资；另一方面，鼓励地方政府积极利用专项债，同时仍然强调财政政策要有约束、可持续，强调财经纪律并坚决遏制新增地方政府隐性债务。积极的财政政策和宽松的货币政策，对 2022 年的经济增长起到托底作用，也向资本市场传递出稳定的预期。

回到市场本身，我们判断市场系统性风险的可能性不大，同时，指数的趋势性机会也不再。整个市场风格将继续结构化的演绎。我们对全年收益的预期有所降低。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

管理人日常监察稽核工作主要由资产管理总部合规与法律事务部、风控部以及公司合规法务部、风险管理部负责。管理人从合法合规运作、切实维护投资者合法利益的角度出发，持续推进全面风险管理理念，加强事前、事中、事后的风险管理，根据相关监管规定及内部管理需要不断更新和完善相关制度和流程，不断强化员工合规和风险意识，从而推动公司的合规文化和内部风险控制机制逐步完善与优化。

管理人将继续本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理集合计划资产，加强风险控制与合规管理，维护集合计划份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，集合计划管理人严格依据财政部《企业会计准则》，中国证券投资基金业协会发布的系列核算指引及投资品种估值标准指引，中国证监会发布的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》等的规范和指引，以及集合计划合同对估值核算事项的相关约定等对集合计划的进行估



值核算。

管理人组织合规法务、风控、核算、投资监督等岗位形成专门职能，对集合计划的估值标准和业务执行等进行检视和保障，以加强核算程序、结果数据的可靠性、完整性和及时性。必要时管理人同时就具体事项征询外部会计师机构的专业意见。

集合计划日常账务处理、基金净值计算由集合计划管理人独立完成，托管人对账户和计算结果进行复核。管理人于交易日终取得完整业务数据等并审核无误后，经由核算系统生成的估值结果经电子化专门渠道发送至托管人，净值经托管人复核无误后签名返回，后由管理人完成披露。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期间，集合计划未实施利润分配业务。本集合计划收益分配严格依照基金法规和合同约定实施。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本集合计划未被出具非标准意见审计报告。

#### 4.10 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

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 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

2021 年度，基金托管人在东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的托管过程中，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

2021 年度，东吴证券股份有限公司在东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2021 年度，由东吴证券股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61346989_B02 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划管理人——东吴证券股份有限公司对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>东吴证券股份有限公司负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，东吴证券股份有限公司负责评估东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与东吴证券股份有限公司就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	朱宝钦 莫艾琦
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2022年3月30日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	2,089,456.26
结算备付金		6,303,080.03
存出保证金		66,620.85
交易性金融资产	7.4.7.2	155,774,167.44
其中：股票投资		155,774,167.44
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		78,027,549.92
应收利息	7.4.7.5	-21,960.85
应收股利		-
应收申购款		1,125.54
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		242,240,039.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,192,268.76
应付赎回款		7,765.09
应付管理人报酬		301,129.18
应付托管费		118,844.57
应付销售服务费		78,142.67
应付交易费用	7.4.7.7	898,840.46
应交税费		198,803.27
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	85,000.00
负债合计		2,880,794.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	233,632,939.65
未分配利润	7.4.7.10	5,726,305.54
所有者权益合计		239,359,245.19
负债和所有者权益总计		242,240,039.19

注：（1）报告截止日 2021 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 233,632,939.65 份。其中下属 A 类集合计划份额净值人民币 1.0246 元，份额总额 134,309,541.67 份；下属 B 类集合计划份额净值人民币 1.0266 元，份额总额 35,835,789.80 份；下属 C 类集合计划份额净值人民币 1.0232 元，份额总额 63,487,608.18 份。

（2）本集合计划合同生效日为 2021 年 8 月 27 日，无上年度同期对比数。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 8 月 27 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		9,142,461.02
1. 利息收入		638,563.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	134,369.38
债券利息收入		66.81
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		504,127.06
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,026,208.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	9,902,703.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	120,074.94
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,430.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,522,603.47

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	292.93
减：二、费用		1,756,561.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	368,888.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	148,130.43
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	78,142.67
4. 交易费用	7.4.7.19	1,033,529.03
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		36,082.24
7. 其他费用	7.4.7.20	91,789.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,385,899.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,385,899.34

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021年8月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,569,490.62	7,453,036.40	36,022,527.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,385,899.34	7,385,899.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	205,063,449.03	-9,112,630.20	195,950,818.83
其中：1. 基金申购款	205,595,115.07	-9,103,566.58	196,491,548.49
2. 基金赎回款	-531,666.04	-9,063.62	-540,729.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者 权益(基金净值)	233,632,939.65	5,726,305.54	239,359,245.19
---------------------	----------------	--------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告一至财务报表由下列负责人签署：

<u>高海明</u>	<u>姚眺</u>	<u>丁俊</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划由东吴财富 1 号集合资产管理计划（展期）变更而来。

东吴财富 1 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2009 年 11 月 26 日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（2009）1259 号核准设立，自 2010 年 1 月 6 日起开始募集，于 2010 年 2 月 5 日结束募集工作，并于 2010 年 2 月 11 日成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《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》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，东吴财富 1 号集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《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》自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《东吴财富 1 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产比例为 0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证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》》及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。本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（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

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；



本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本集合计划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；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本集合计划主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；买入零息债券视同到期一次

性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

#### (5) 分离交易可转债

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

本集合计划持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。本集合计划采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/(损失)系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本集合计划每一份额享有同等分配权；
- (2) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最少为 1 次，全年分配比例不得低于上一年度期末可供分配收益的 90%；
- (3) 期末可供分配收益为截至可供分配收益计算日，未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数；
- (4) 本计划收益分配方式分为 2 种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入集合计划份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为集合计划份额进行再投资；若投资人不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；
- (5) 选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利登记日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；
- (6) 当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (7) 集合计划收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值，收益分配基准日即当期期末可供分配利润计算截止日；
- (8) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

-

#### 7.4.4.13 分部报告

-

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

-

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 1. 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。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。

## 2. 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。

## 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[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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,089,456.26
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,089,456.26

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	154,733,603.91	155,774,167.44	1,040,563.53
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	154,733,603.91	155,774,167.44	1,040,563.53

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	合同/名义 金额	2021 年 12 月 31 日 公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
其中：国债期货投资	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
其中：远期外汇投资	-	-	-	

权益衍生工具	-	-	-	-
其中：股指期货投资	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有衍生工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	529.94
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,120.04
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-25,643.83
应收申购款利息	-



应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	33.00
合计	-21,960.85

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	898,840.46
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	898,840.46

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	85,000.00
其他	-
合计	85,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴裕盈 A 份额

项目	本期 2021年8月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2021年08月30日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	134,309,541.67	134,309,541.67
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	134,309,541.67	134,309,541.67

## 东吴裕盈 B 份额

项目	本期 2021年8月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	28,569,490.62	36,367,455.84
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2021年08月30日基金拆分/份额折算前	28,569,490.62	36,367,455.84
基金拆分/份额折算调整	7,797,965.22	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-531,666.04	-531,666.04
本期末	35,835,789.80	35,835,789.80

## 东吴裕盈 C 份额

项目	本期 2021年8月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2021年08月30日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	63,487,608.18	63,487,608.18
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	63,487,608.18	63,487,608.18

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 东吴裕盈 A 份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,044,811.83	-905,926.23	4,138,885.60
本期基金份额交易产生的变动数	600,392.31	-1,440,936.19	-840,543.88
其中：基金申购款	600,392.31	-1,440,936.19	-840,543.88
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,645,204.14	-2,346,862.42	3,298,341.72

## 东吴裕盈 B 份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	11,292,686.29	-3,839,649.89	7,453,036.40
本期利润	1,595,296.65	-287,976.55	1,307,320.10
本期基金份额交易产生的变动数	-7,865,763.48	58,734.64	-7,807,028.84
其中：基金申购款	-7,797,965.22	-	-7,797,965.22
基金赎回款	-67,798.26	58,734.64	-9,063.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,022,219.46	-4,068,891.80	953,327.66

## 东吴裕盈 C 份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,268,394.33	-328,700.69	1,939,693.64
本期基金份额交易产生的变动数	315,014.79	-780,072.27	-465,057.48
其中：基金申购款	315,014.79	-780,072.27	-465,057.48
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,583,409.12	-1,108,772.96	1,474,636.16

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	102,981.18
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	31,136.85
其他	251.35
合计	134,369.38

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,902,703.37
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	9,902,703.37

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	296,991,744.10
减：卖出股票成本总额	287,089,040.73
买卖股票差价收入	9,902,703.37

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中金融商品转让增值税的影响。

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
证券出借差价收入	-

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	120,074.94
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	120,074.94

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	452,143.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	332,000.00
减：应收利息总额	68.81
买卖债券差价收入	120,074.94

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中金融商品转让增值税的影响。

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应收利息总额	-
赎回差价收入	-

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
-	-
申购差价收入	-

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应收利息总额	-
资产支持证券投资收益	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
赎回差价收入	-

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
	-
申购差价收入	-

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	-

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额

	2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
	-

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,430.00
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	3,430.00

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,573,947.79
股票投资	-1,573,947.79
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	-51,344.32
合计	-1,522,603.47

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	292.93
-	-
合计	292.93

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,033,529.03
银行间市场交易费用	-
	-
合计	1,033,529.03

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	6,789.21
合计	91,789.21

#### 7.4.7.21 分部报告

-

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴证券股份有限公司	集合计划份额持有人、集合计划管理人、集合计划推广机构
交通银行股份有限公司 (以下简称“交通银行”)	集合计划托管人、集合计划推广机构
东吴创新资本管理有限责任公司 (以下简称“东吴创新”)	集合计划份额持有人、集合计划管理人的子公司
东吴(苏州)金融科技有限公司 (以下简称“苏州金科”)	东吴创新的联营企业
东吴证券尊享 1 号 FOF 单一资产管理计划	集合计划管理人管理的结构化主体

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-



## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021 年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东吴证券股份有限公司	717,748,197.59	100.00

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东吴证券股份有限公司	455,746.00	100.00

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东吴证券股份有限公司	5,172,900,000.00	100.00

## 7.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月27日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例（%）
-	-	-

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东吴股份有限 公司	672,570.28	100.00	898,840.40	100.00

注：（1）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集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

（2）本集合计划合同生效日为 2021 年 8 月 27 日，无上年度同期对比数据

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	368,888.10
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：（1）支付集合计划管理人东吴证券股份有限公司的固定管理费按前一日集合计划资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的集合计划管理费=前一日该类集合计划资产净值×0.60%/365。

（2）本集合计划合同生效日为 2021 年 8 月 27 日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	148,130.43

注：（1）支付集合计划托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日集合计划资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×0.2%/365。

（2）本集合计划合同生效日为 2021 年 8 月 27 日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额	合计
东吴证券股份有限公司	-	-	78,016.51	78,016.51
合计	-	-	78,016.51	78,016.51

注：（1）销售服务费每日计提，按月支付。A 类、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额的资产净值的 0.40% 年费率计提。本集合计划 C 类份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

（2）本集合计划合同生效日为 2021 年 8 月 27 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 27 日（集合计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位：张)	出借期限(单位：天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年8月27日(集 合计划合同生效日) 至2021年12月31 日	本期 2021年8月27日(集 合计划合同生效日)至2021年 12月31日	本期 2021年8月27日(集 合计划合同生效日) 至2021年12月31 日
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
基金合同生效日 (2021年8月27日) 持有的基金份额	-	3,959,533.44	-
报告期初持有的基金 份额	-	3,959,533.44	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	1,080,743.95	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	-	5,040,277.39	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	-	2.16%	-

注：本集合计划合同生效日为2021年8月27日，无上年度同期对比数据。

## 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

## 东吴裕盈 A 份额

关联方名称	本期末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
-	-	-

份额单位：份

## 东吴裕盈 B 份额

关联方名称	本期末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
-	-	-

东吴创新资本管理有 限责任公司	17,784,286.27	7.61
东吴（苏州）金融科技 有限公司	177,745.53	0.08

份额单位：份

## 东吴裕盈 C 份额

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
东吴证券尊享 1 号 FOF 单一资产管理计划	1,015,847.22	0.43

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	2,089,456.26	102,981.18

注：集合计划银行存款由托管人交通银行股份有限公司保管，适用同业利率或约定利率计算存款利息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无其他关联方交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

东吴裕盈 A 份额								
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					
-	-	-	-	-	-	-	-	-

合计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴裕盈 B 份额									
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴裕盈 C 份额									
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						
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：份)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
-	-	-	-	-	-
合计				-	-

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本集合计划无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本集合计划无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

-

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人的风险管理组织架构由董事会下设的风险控制委员会、经营管理层下设的风险管理委员会及首席风险官、风险管理部门、业务部门和分支机构设立的合规风控专员四个层级构成。公司设首席风险官负责公司全面风险管理工作，风险管理部门推动全面风险管理工作，

监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构和子公司的风险管理工作。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划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；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本集合计划本报告期末未持有债券投资、同业存单投资、资产支持证券投资，评估应无重大信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-



合计	-
----	---

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

## 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

## 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				

-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债	-	-	-	-
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的集合计划管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全集合计划流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的集合计划管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的集合计划管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 7.4.12 中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过集合计划资产净值的 15%。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	2,089,456.26	-	-	-	2,089,456.26
结算备付金	6,303,080.03	-	-	-	6,303,080.03
存出保证金	66,620.85	-	-	-	66,620.85
交易性金融资产	-	-	-	-155,774,167.44	155,774,167.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-21,960.85	-21,960.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,125.54	1,125.54
应收证券清算款	-	-	-	78,027,549.92	78,027,549.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,459,157.14	-	-	-233,780,882.05	242,240,039.19
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,765.09	7,765.09
应付管理人报酬	-	-	-	301,129.18	301,129.18
应付托管费	-	-	-	118,844.57	118,844.57
应付证券清算款	-	-	-	1,192,268.76	1,192,268.76
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	78,142.67	78,142.67
应付交易费用	-	-	-	898,840.46	898,840.46
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	198,803.27	198,803.27
其他负债	-	-	-	85,000.00	85,000.00
负债总计	-	-	-	2,880,794.00	2,880,794.00
利率敏感度缺口	8,459,157.14	-	-	-230,900,088.05	239,359,245.19

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	-	-

注：本集合计划本期末未持有债券投资（不含可转债），因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划未持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此不存在相应的外汇风险。

## 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算 款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净	-	-	-	-

额				
---	--	--	--	--

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本集合计划得单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取得风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	港币相对人民币贬值 1%	-	
	港币相对人民币升值 1%	-	

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指集合计划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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	155,774,167.44	65.08
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	155,774,167.44	65.08

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除权益投资公允价值发生变动，其他影响集合计划资产公允价值的风险变量保持
----	-------------------------------------

	不变。	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	权益投资公允价值增加 5%	7,788,708.37
	权益投资公允价值减少 5%	-7,788,708.37

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-	
	-	
	-	
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2021年12月31日）
	-	-
	合计	-

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	155,774,167.44	64.31
	其中：股票	155,774,167.44	64.31
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	8,392,536.29	3.46
-	-	-	-
8	其他各项资产	78,073,335.46	32.23
9	合计	242,240,039.19	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	150,608,685.44	62.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,485,956.00	1.04
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	2,679,526.00	1.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	155,774,167.44	65.08

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002129	中环股份	495,773	20,698,522.75	8.65
2	300747	锐科激光	179,937	10,636,076.07	4.44
3	601966	玲珑轮胎	247,300	9,038,815.00	3.78
4	002409	雅克科技	98,800	8,019,596.00	3.35
5	600887	伊利股份	188,207	7,803,062.22	3.26
6	600210	紫江企业	822,900	7,554,222.00	3.16
7	300316	晶盛机电	108,100	7,512,950.00	3.14
8	300124	汇川技术	95,800	6,571,880.00	2.75
9	688036	传音控股	41,156	6,457,376.40	2.70
10	002324	普利特	429,340	6,062,280.80	2.53
11	603866	桃李面包	193,160	5,485,744.00	2.29
12	600111	北方稀土	116,600	5,340,280.00	2.23
13	002291	星期六	267,400	5,337,304.00	2.23
14	603501	韦尔股份	16,600	5,158,782.00	2.16
15	603987	康德莱	221,200	4,806,676.00	2.01
16	600519	贵州茅台	2,200	4,510,000.00	1.88
17	600732	爱旭股份	187,400	4,377,664.00	1.83
18	300331	苏大维格	130,300	4,342,899.00	1.81
19	300702	天宇股份	85,600	4,138,760.00	1.73
20	000630	铜陵有色	999,500	3,478,260.00	1.45
21	603308	应流股份	155,300	3,466,296.00	1.45
22	300529	健帆生物	57,100	3,043,430.00	1.27
23	000831	五矿稀土	69,400	2,707,988.00	1.13
24	002268	卫士通	47,900	2,679,526.00	1.12
25	600483	福能股份	152,700	2,485,956.00	1.04
26	300115	长盈精密	69,500	1,378,880.00	0.58
27	600060	海信视像	86,200	1,159,390.00	0.48
28	688266	泽璟制药	19,044	1,119,787.20	0.47
29	688208	道通科技	5,060	401,764.00	0.17

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600483	福能股份	31,610,112.99	13.21
2	002129	中环股份	23,277,325.45	9.72
3	601966	玲珑轮胎	18,984,832.77	7.93



4	300316	晶盛机电	15,328,841.00	6.40
5	600111	北方稀土	15,293,723.00	6.39
6	000001	平安银行	14,822,363.00	6.19
7	688036	传音控股	13,026,599.12	5.44
8	002291	星期六	12,523,824.00	5.23
9	002409	雅克科技	11,698,702.12	4.89
10	600210	紫江企业	11,223,435.00	4.69
11	603987	康德莱	11,182,149.00	4.67
12	300331	苏大维格	10,881,114.00	4.55
13	300115	长盈精密	10,364,680.00	4.33
14	601899	紫金矿业	10,310,027.00	4.31
15	000831	五矿稀土	9,960,001.00	4.16
16	300747	锐科激光	9,894,149.06	4.13
17	600519	贵州茅台	9,420,208.00	3.94
18	601877	正泰电器	9,367,597.90	3.91
19	600732	爱旭股份	9,364,944.00	3.91
20	300124	汇川技术	8,769,853.62	3.66
21	600887	伊利股份	7,909,535.00	3.30
22	002268	卫士通	7,783,855.40	3.25
23	600406	国电南瑞	7,557,310.00	3.16
24	603866	桃李面包	7,154,543.80	2.99
25	002415	海康威视	6,520,982.54	2.72
26	600885	宏发股份	6,503,125.00	2.72
27	603501	韦尔股份	5,585,063.00	2.33
28	600600	青岛啤酒	5,534,100.00	2.31
29	603305	旭升股份	5,339,161.00	2.23
30	002230	科大讯飞	5,258,802.00	2.20
31	002324	普利特	5,156,006.80	2.15

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600483	福能股份	30,782,972.00	12.86
2	000001	平安银行	15,839,487.00	6.62
3	601966	玲珑轮胎	11,106,404.00	4.64
4	300115	长盈精密	10,405,109.00	4.35
5	601899	紫金矿业	10,238,931.00	4.28
6	600111	北方稀土	10,184,533.00	4.25
7	000831	五矿稀土	9,280,631.00	3.88
8	601877	正泰电器	9,126,300.00	3.81
9	600885	宏发股份	8,627,756.45	3.60
10	603987	康德莱	8,044,864.60	3.36

11	002415	海康威视	7,871,317.00	3.29
12	300316	晶盛机电	7,793,948.00	3.26
13	600406	国电南瑞	7,300,061.00	3.05
14	300331	苏大维格	7,299,694.00	3.05
15	002291	星期六	6,926,772.00	2.89
16	688036	传音控股	6,845,961.44	2.86
17	002230	科大讯飞	6,321,014.00	2.64
18	600600	青岛啤酒	6,265,196.00	2.62
19	600732	爱旭股份	5,909,783.00	2.47
20	002268	卫士通	5,768,009.00	2.41
21	603305	旭升股份	5,716,929.00	2.39
22	002409	雅克科技	5,497,390.00	2.30
23	002389	航天彩虹	5,136,403.00	2.15

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	420,459,372.39
卖出股票收入（成交）总额	296,991,744.10

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中金融商品转让增值税的影响。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	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。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

金额单位：人民币元

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。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 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。

**8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本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和期货市场的收益性、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。

**8.11.2 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	风险指标说明
----	----	----------	---------	--------	--------

		卖)		(元)	
-	-	-	-	-	-
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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

本集合计划投资前十名证券的发行主体在本报告期内未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,620.85
2	应收证券清算款	78,027,549.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-21,960.85
5	应收申购款	1,125.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	78,073,335.46

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

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。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
东吴裕盈 A 份额	1,533	87,612.23	3,565,107.37	2.65	130,744,434.30	97.35
东吴裕盈 B 份额	180	199,087.72	23,003,056.66	64.19	12,832,733.14	35.81
东吴裕盈 C 份额	651	97,523.21	1,219,016.66	1.92	62,268,591.52	98.08
合计	2,364	98,829.50	27,787,180.69	11.89	205,845,758.96	88.11

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴裕盈 A 份额	100,745.52	0.04
	东吴裕盈 B 份额	285,248.27	0.12
	东吴裕盈 C 份额	-	-
	合计	385,993.79	0.17

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和相关部门	东吴裕盈 A 份额	10~50
	东吴裕盈 B 份额	0~10

负责人持有本开放式基金	东吴裕盈 C 份额	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴裕盈 A 份额	-
	东吴裕盈 B 份额	10~50
	东吴裕盈 C 份额	-
	合计	-

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间(万份)
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	合计	-

### § 10 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
基金合同生效日(2021年8月27日)基金份额总额	-	28,569,490.62	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	134,309,541.67	-	63,487,608.18
减:基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	531,666.04	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	7,797,965.22	-
本报告期末基金份额总额	134,309,541.67	35,835,789.80	63,487,608.18

注：本集合计划于 2021 年 8 月 30 日进行了份额折算操作，B 类份额单位净值调整为 1.0000 元，

原来每 1 份集合计划份额变为 1.272947296 份。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，集合计划管理人未发生重大人事变动。托管人交通银行股份有限公司托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划自合同变更生效以来聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为 45000.00 元，已提供审计服务年限为 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本集合计划管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券股份有限公司	2	717,748,197.59	100.00%	672,570.28	100.00%	-

注：截至报告期末，当期佣金支付金额为 0.00 元。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
东吴证券股份有限公司	455,746.00	100.00%	5,172,900,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴证券股份有限公司东吴财富 1 号集合资产管理计划（展期）正式变更为东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划及合同生效的公告	上海证券报、基金电子披露网站及管理人网站	2021-08-27
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开放日常申购、赎回、定投业务公告	上海证券报、基金电子披露网站及管理人网站	2021-08-30
3	东吴证券股份有限公司东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划份额折算结果公告	上海证券报、基金电子披露网站及管理人网站	2021-09-01
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 2021 年第三季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2021-10-27

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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							
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额 20%的情况。							



## 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2022 年 3 月 31 日