

东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合
资产管理计划
2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 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

报告送出日期：2022 年 4 月 21 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 2022 年 4 月 19 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 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 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	234,277,431.50 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	134,773,734.92 份	35,733,409.23 份	63,770,287.35 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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 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	-14,052,174.26	-3,694,002.67	-6,702,604.12
2. 本期利润	-19,799,254.80	-5,231,474.06	-9,414,756.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1472	-0.1463	-0.1479
4. 期末基金资产净值	118,233,803.17	31,457,224.50	55,816,328.62
5. 期末基金份额净值	0.8773	0.8803	0.8753

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，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	-14.38%	1.12%	-8.19%	0.91%	-6.19%	0.21%
过去六个月	-10.41%	0.93%	-5.74%	0.71%	-4.67%	0.22%
自基金合同 生效起至今	-12.27%	0.86%	-5.73%	0.72%	-6.54%	0.14%

东吴裕盈 B 份额

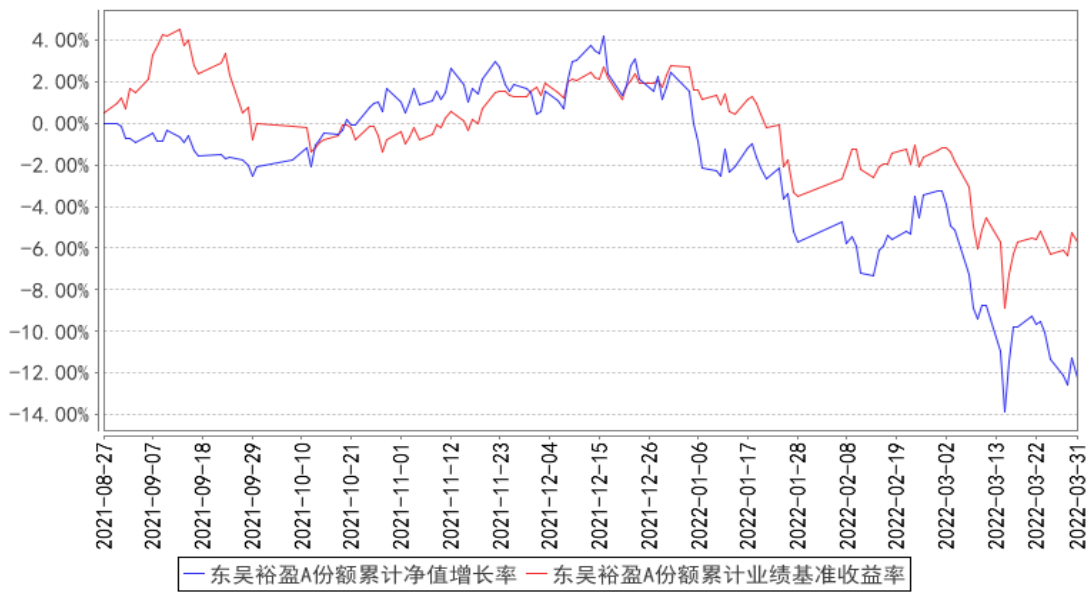
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-14.25%	1.12%	-8.19%	0.91%	-6.06%	0.21%
过去六个月	-10.15%	0.93%	-5.74%	0.71%	-4.41%	0.22%
自基金合同 生效起至今	-11.97%	0.87%	-5.73%	0.72%	-6.24%	0.15%

东吴裕盈 C 份额

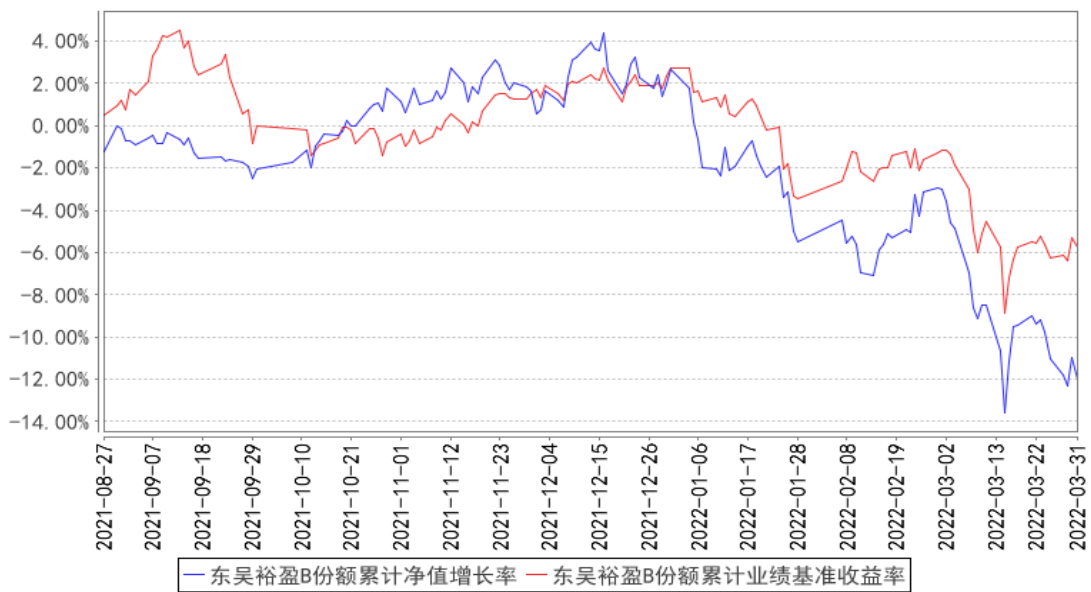
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-14.45%	1.12%	-8.19%	0.91%	-6.26%	0.21%
过去六个月	-10.59%	0.93%	-5.74%	0.71%	-4.85%	0.22%
自基金合同 生效起至今	-12.47%	0.86%	-5.73%	0.72%	-6.74%	0.14%

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

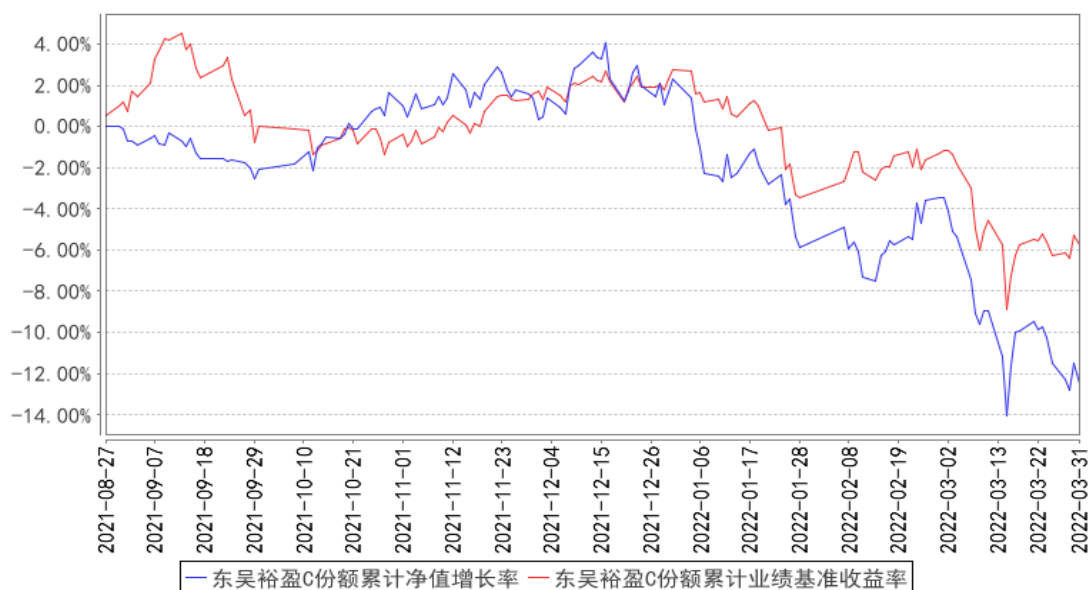
东吴裕盈A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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（2022年1月1日-2022年3月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2022年3月31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	-	10年	李果，工学博士，10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。

4.1.1 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	-	-	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

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

2022 年是新冠疫情肆虐全球的第三个年头。全球范围内，经济面临一定滞胀甚至衰退的风险。国内一季度情况来看，2021 年底中央经济工作会议提到的“需求收缩、供给冲击、预期转弱”在上半年似乎有放大的趋势。美联储收缩加速的大背景，叠加俄乌冲突、全球供应链危机、中美关系紧张，以及近期新冠疫情在沪广深苏等工业城市的爆发，国内经济数据下滑显著。

具体到经济增长的三驾马车上。投资有一定压力，但自主把控能力相对较强。政府工作报告定调了“稳增长”，为了实现年初制定的 5.5% 的目标增速，基建是重要抓手，我们觉得也大概率是最确定的投资环节，后续政策应该会陆续落地。房地产是托而不举。而制造业重镇长三角和珠三角均遭遇疫情，供应和需求的不确定性双向压制制造业的投资。出口大概率前高后低。1-2 月份出口数据强劲，韧性十足。2 月底的俄乌冲突，3 月份开始的疫情对整个供应链和物流影响显著，也进一步扰动外需订单，出口数据后续转弱是大概率事件。消费数据的恢复依然低于预期，且在

奥密克戎变种出现带来多地疫情反弹后，我们的担忧有所加剧。两年多的疫情反复使得很多中小微企业经营困难，服务型企业受冲击尤其显著，制造业企业深受原材料价格大幅上涨、供应链和物流运转不畅的影响。居民消费意愿的低迷短期看不到修复的迹象。显然，必选消费要远好于可选消费。整体而言，全球不再宽松甚至收紧的货币环境，叠加动荡的地缘政治局势加剧了资本对经济滞涨甚而衰退的担忧。中国多地疫情的反弹使得国内经济的短期情况雪上加霜，也进一步加速了上市公司盈利的下滑。

在经济增长放缓的背景下，A 股核心指数一季度全面下跌。上证综指跌 10.6%，沪深 300 跌 14.5%，创业板指跌 20.0%，万得全 A 指数跌幅为 13.92%。具体到风格上，低估值顺周期板块表现显著优于成长板块。一季度市场表现最好的四个板块分别是房地产（+7.27%）、综合（+3.45%）、银行（+1.66%）和采掘（+0.00%），而跌幅超过 20%的板块就包括电子、军工、汽车、家电和食品饮料。整体来看，上涨的几个方向，稳增长标签显著。这也是在经济增长预期未见好转的情况下，市场倾向于寻找需求确定性强、供给受到冲击小的方向。

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、制造智造、半导体、消费等板块。整个季度来看，投资业绩基本和沪深 300 指数和中证 500 指数持平。整体来看，净值回撤创了管理人产品管理以来的历史最大回撤，反思之处较多。首先，在联储缩表加速的大背景下，市场资金实际上处于存量甚至减量博弈的环境，核心优质公司虽然长期竞争优势突出，但筹码相对集中，这是减量博弈背景下难以获得绝对收益的一个方向。其次，我们年初的预期是，21 年全年大宗商品和上游原材料在经历了全年的强势之后，22 年的上游原材料价格大概率处于同比下行的趋势中，但俄乌冲突客观上加剧了原材料上行的速度，进一步挤压了中游制造业的利润空间。我们对持仓较重的中游制造公司减仓不够及时，对产品净值的拖累较大。最后，煤炭板块确实不在我们的能力圈范围，这是今年年初以来盈利最确定的方向。

一季度市场羸弱，除了外围紧缩加速对成长股估值的压制，并引发部分外资的流出外，背后的原因还包括外围地缘政治问题带来上游原材料涨价进而冲击中游制造业的盈利、国内多点爆发的新冠疫情对消费和制造业的干扰，以及中概股退市风波对风险偏好阶段性的压制。

目前看来，短期上游大宗商品价格上行给中游制造业带来的潜在成本压力短期依然无解，但俄乌冲突的直接冲击的边际影响正在减弱。中概股的监管问题更多需要中美双方的沟通，但在板块估值大幅调整后，其对 A 股风险偏好的直接影响也日趋减弱。我们觉得，以上海疫情为代表的国内新冠疫情变化可能成为二季度市场表现的核心决定因素。本轮上海疫情的影响已经不仅局限于消费服务领域，而是延伸到了制造业，而且是中国工业重镇长三角的制造业。上海部分重点企业 4 月中下旬陆续复工的操作值得重点关注。疫情后政策如何给企业补充现金流，保证市场主体

的经营存续是迫切需要解决的问题，比如社融信贷支持，各种退税，减租政策。另外，如何降低疫情对中国制造业产业链的影响，从而保持中国出口的竞争力，也是政策需要重点布局的方向。

回到市场本身，今年以来顺周期稳增长低估值板块乐观预期持续发酵，一定程度上折射出投资者对稳增长必然见效的强烈预期，即宏观数据低于预期，经济刺激政策力度更大。显然板块的快速上行，意味着预期的提高，进一步意味着相关板块的股价反复的可能性大幅提升。我们始终认为，“经济越差，稳增长板块表现越好”的循环大概率难以为继，稳增长政策落地对板块股价的刺激效果将边际递减。短期而言，全国疫情出现拐点或者美债收益率趋于稳定，可能是成长股调整的阶段性拐点。

3月16日召开的金融委会议呵护市场的意图明确，针对宏观经济、货币政策、房地产、平台经济治理等热点议题重新定调，引发市场调整的部分因素已经得到监管层的积极回应。本轮政策底的确认已成市场共识。但按照一般规律，在政策底到市场底的过程中，应该有各种政策的逐步出台落地。4月份开始市场进入重要的政策落地窗口。4月份恰逢一季报密集期，也是景气方向上个股成色的验证期。光伏、功率半导体、新能源汽车是主要发酵的方向。一季报的披露成为资金再次评估景气的窗口，寻找高景气可持续、低景气有望反转的细分板块也是方向之一。

整体而言，二季度政策底之后一般有市场底，我们判断稳增长和新经济的预期收益率都会比较有限。稳增长和低估值方向上，地产、银行、煤炭、基本金属和农资产品值得重点关注，大概率将继续贡献相对收益。景气方向上，光伏、功率半导体、新能源车细分方向和新冠治疗等板块的景气值得重点跟踪。受宏观环境影响较小的军工方向的估值修复也值得关注。个股，自下而上寻找 Alpha 是关键。

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-14.38%，本集合计划B份额净值增长率为-14.25%，本集合计划C份额净值增长率为-14.45%，业绩比较基准收益率为-8.19%。

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	118,493,967.01	55.01

	其中：股票	118,493,967.01	55.01
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	73,000,000.00	33.89
	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	18,029,210.12	8.37
-	-	-	-
8	其他资产	5,891,959.52	2.74
9	合计	215,415,136.65	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	95,966,299.01	46.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,580,127.00	2.23
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	6,761,549.00	3.29
J	金融业	9,608,040.00	4.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,577,952.00	0.77
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	118,493,967.01	57.66

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：报告期末，本集合计划未持有港股通股票。

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	002129	中环股份	425,073	18,150,617.10	8.83
2	600887	伊利股份	281,607	10,388,482.23	5.06
3	600036	招商银行	205,300	9,608,040.00	4.68
4	002415	海康威视	209,200	8,577,200.00	4.17
5	002268	卫士通	148,900	6,761,549.00	3.29
6	002324	普利特	486,740	6,006,371.60	2.92
7	688036	传音控股	61,349	5,865,577.89	2.85
8	603501	韦尔股份	29,386	5,683,252.40	2.77
9	601966	玲珑轮胎	226,877	5,007,175.39	2.44
10	002597	金禾实业	126,400	4,982,688.00	2.42

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）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有债券。

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（%）
-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有债券。

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：报告期末，本集合计划未持有资产支持证券。

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：报告期末，本集合计划未持有贵金属。

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：报告期末，本集合计划未持有权证。

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：报告期末，本集合计划未持有股指期货。

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。

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：报告期末，本集合计划未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本集合计划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

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。

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	125,887.28
2	应收证券清算款	5,765,903.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	168.75
6	其他应收款	-
-	-	-
7	其他	-
8	合计	5,891,959.52

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：报告期末，本集合计划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	占基金资产净	流通受限情
----	------	------	-------------	--------	-------

			(元)	值比例 (%)	况说明
-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划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	134,309,541.67	35,835,789.80	63,487,608.18
报告期期间基金总申购份额	464,193.25	-	282,679.17
减：报告期期间基金总赎回份额	-	102,380.57	-
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	134,773,734.92	35,733,409.23	63,770,287.35

§ 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 (%)	-	14.11	-

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：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：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

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。

东吴证券股份有限公司

2022 年 04 月 21 日