

# 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 30 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。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 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>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 主要财务指标和基金净值表现</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 .....	8
3.3 其他指标 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
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 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
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 .....	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
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 .....	58
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 .....	59

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 .....	59
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 .....	59
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.11 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	63
<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>64</b>
12.1 备查文件目录 .....	64
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	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划		
基金简称	东吴安鑫中短债		
场内简称	-		
基金主代码	970087		
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 12 月 20 日		
基金管理人	东吴证券股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	142,781,186.27 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	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
下属分级基金的场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	970087	970088	970089
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	88,594,978.35 份	20,010.00 份	54,166,197.92 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和谨慎控制组合净值波动率的前提下,重点投资中短债主题证券,追求集合计划的长期、持续增值,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划将通过分析宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪,捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会,确定固定收益类资产、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例,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.债券投资策略;3.杠杆策略;4.国债期货投资策略;5.资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率×80%+一年期定期存款利率

	(税后) × 20%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其风险收益水平低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划，高于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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王硕	吴旻
	联系电话	021-60199757	0512-65008710
	电子邮箱	xuxue@dwzq.com.cn	wum02-sz@js.icbc.com.cn
客户服务电话		95330	0512-65008710
传真		021-60199532	010-82918115-2329
注册地址		苏州市工业园区星阳街 5 号	北京市西城区复兴门内大街 55 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	苏州工业园区旺墩路 122 号 8 楼
邮政编码		200127	215000
法定代表人		范力	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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
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
会计师事务所	公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）	无锡市太湖新城嘉业财富中心 5-1001 室

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)		
数据和指标	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
本期已实现收益	1,911,054.20	344.02	941,046.97
本期利润	2,057,182.64	379.40	996,764.98

加权平均基金份额本期利润	0.0151	0.0152	0.0136
本期加权平均净值利润率	1.50%	1.51%	1.35%
本期基金份额净值增长率	1.57%	1.56%	1.43%
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	1,459,710.25	292.61	717,621.98
期末可供分配基金份额利润	0.0165	0.0146	0.0132
期末基金资产净值	90,054,688.60	20,337.84	54,980,459.41
期末基金份额净值	1.0165	1.0164	1.0150
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	1.65%	1.64%	1.50%

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）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 12 月 20 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

东吴安鑫中短债 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	0.18%	0.01%	0.10%	0.02%	0.08%	-0.01%
过去三个月	0.85%	0.01%	0.69%	0.02%	0.16%	-0.01%
过去六个月	1.57%	0.01%	1.30%	0.03%	0.27%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.65%	0.01%	1.49%	0.03%	0.16%	-0.02%

东吴安鑫中短债 B

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	0.18%	0.01%	0.10%	0.02%	0.08%	-0.01%
过去三个月	0.85%	0.01%	0.69%	0.02%	0.16%	-0.01%
过去六个月	1.56%	0.01%	1.30%	0.03%	0.26%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.64%	0.01%	1.49%	0.03%	0.15%	-0.02%

东吴安鑫中短债 C

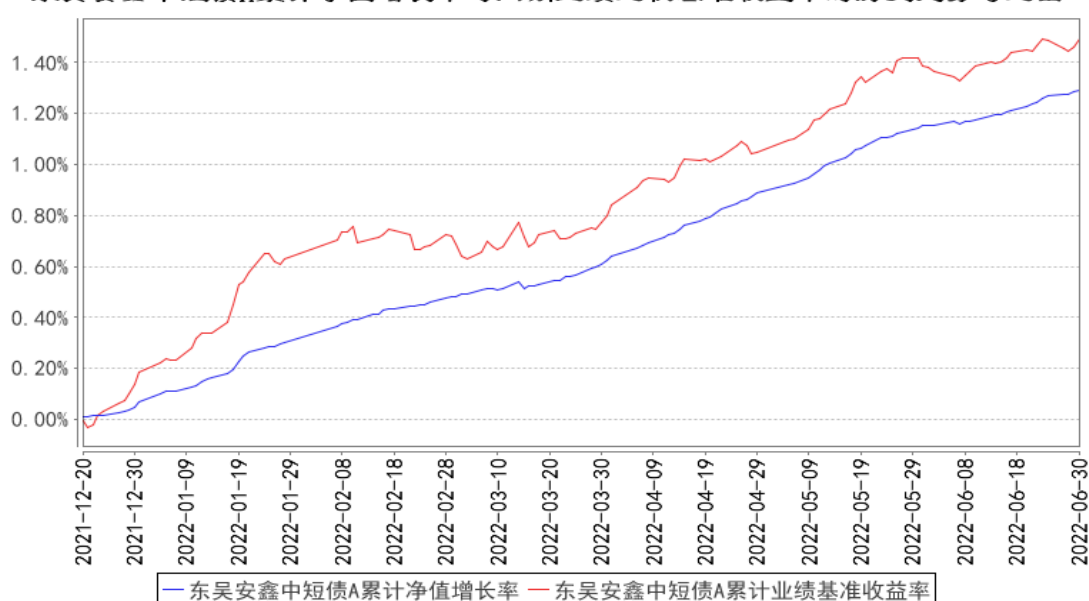
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.16%	0.01%	0.10%	0.02%	0.06%	-0.01%



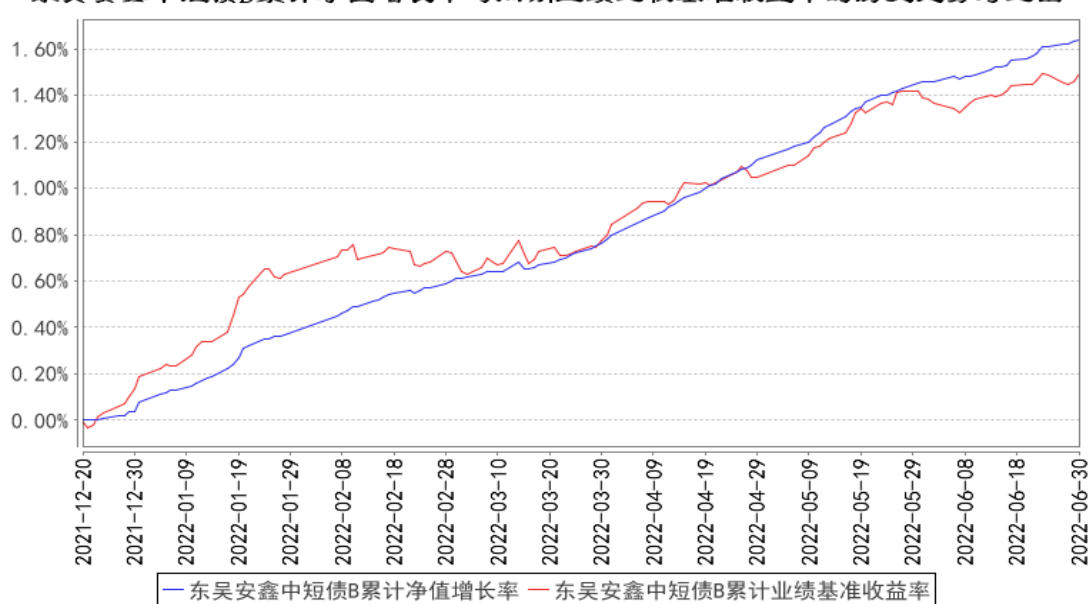
过去三个月	0.78%	0.01%	0.69%	0.02%	0.09%	-0.01%
过去六个月	1.43%	0.01%	1.30%	0.03%	0.13%	-0.02%
自基金合同生效 起至今	1.50%	0.01%	1.49%	0.03%	0.01%	-0.02%

### 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

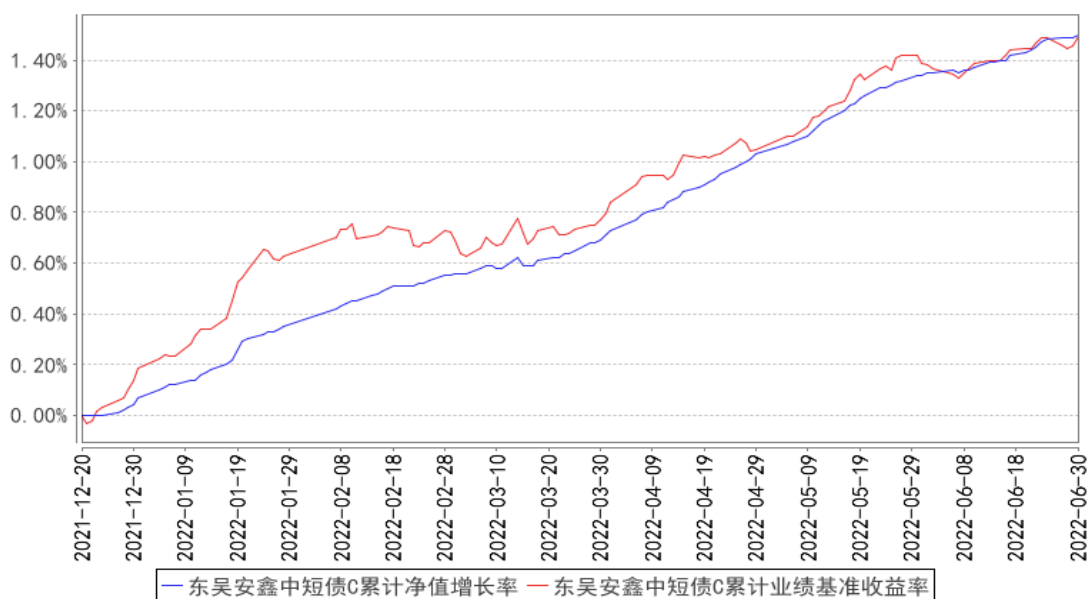
东吴安鑫中短债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴安鑫中短债B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



东吴安鑫中短债C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日至2022年6月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2022年6月30日）
-	-

## § 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”）前身为苏州证券，于1993年4月10日在苏州市成立。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。

目前，管理人旗下运作管理三只经公募化改造的大集合资产管理计划，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		
江逸舟	投资经理	2021 年 12 月 20 日	-	1 年	江逸舟，厦门大学经济学硕士，华中科技大学管理学学士，8 年自营、资管资产投资管理经验。历任兴业信托投资业务总部投资经理、厦门银行资产管理部投资经理、张家港农商行资产管理部投资经理。2021 年加入东吴证券资产管理总部，现任东吴证券资产管理总部投资经理。
薛辉蓉	投资经理	2021 年 12 月 20 日	2022 年 1 月 20 日	20 年	薛辉蓉，金融学硕士，10 年以上证券从业经历。2009 年 12 月起任职于东吴证券，历任东吴证券研究所行业研究员、固定收益总部信用分析师、资产管理总部研究员、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。

#### 4.2 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，本集合计划管理人认真遵循《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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《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 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

2022 年上半年债市利率债收益率低位震荡。1 月初降息后市场收益率快速下行,中短端下行幅度更大,收益率曲线陡峭。随后 1 月社融大幅超预期以及广州地产政策调整,极大扭转市场信用预期,收益率转而上行,叠加资管产品的赎回压力,收益率曲线向平坦变化。期间市场一直在降准降息预期与宽信用预期期间反复交易。3 月中旬后局部疫情增加对经济景气度担忧,中长端表现更好。3 月下旬随着财政支出以及公开市场操作增加短期投放,资金边际转松,中短端表现更好,曲线重回陡峭。4 月份开始由于降准、央行持续上缴利润等影响,准备金供给充足,同时受疫情等因素影响,信贷对准备金的消耗速度明显减慢,导致准备金十分充裕,银行间隔夜资金利率大幅偏离公开市场操作政策利率,大部分时间维持在 1.3%-1.4%,利率债收益率 4-5 月保持震荡下行态势,中短久期信用债收益率下行幅度更大。5 月底北京上海疫情拐点出现后,债市开始调整,但由于资金面始终保持十分宽松态势,债券收益率上行幅度有限,中短久期信用债表现仍更为强势。

报告期内,组合主要配置中短久期信用债,1-4 月组合久期偏短,但通过积极把握短久期利率债波段操作机会有效增厚组合收益。5 月底债市调整后增配中短久期信用债资产,以获取票息收益为主,组合久期回到中性水平,同时持续进行短久期利率债波段操作以增厚组合收益。

#### 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 1.57%,本集合计划 B 份额净值增长率为 1.56%,本集合计划 C 份额净值增长率为 1.43%,业绩比较基准收益率为 1.30%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年市场的关切点依然在资金面与经济复苏的斜率。从资金面来看,目前银行间资金利率大幅低于政策利率,预计资金宽松局面仍将延续。首先,央行展现出明确的宽货币意图,8 月份调降 MLF 与 LPR 利率,且后续仍有继续调降可能;其次,实体融资需求不佳使资金被动滞留银行间;最后,专项债发行高峰期已过,财政支出将吐纳部分流动性。因此资金宽松的局面并非由降息直接导致,但降息降低了市场对于市场利率因距政策利率太远而靠拢回归的担忧。从经

济复苏来看，7 月社融和信贷不及预期，8 月高频数据疲弱，宽货币传导至宽信用仍需等待。

资产配置上，债券组合久期后续继续保持中性水平，同时持续进行短久期利率债波段操作以增厚组合收益。

#### 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，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。

管理人制定了产品估值的相关政策和估值标准，设置了专门机构对集合计划的估值标准和业务执行等进行协调和保障，同时引用合规、风控、投资等岗位的工作成果以加强核算程序、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事务所的专业意见。

集合计划日常账务处理、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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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

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

本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下称“托管人”）在东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划（以下称“本计划”或“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资管计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资管计划合同和托管协议的规定，对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对计划资产净值的计算、份额申购

赎回价格的计算以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现集合计划管理人有关损害份额持有人利益的行为。报告期内，本计划未实施利润分配。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划

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	2,071,835.40	2,743,036.08
结算备付金		970,595.03	114,337.55
存出保证金		32,601.06	578.65
交易性金融资产	6.4.7.2	149,205,510.77	37,009,649.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		149,205,510.77	37,009,649.00
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	3,000,000.00	26,040,514.56
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,020,190.48	372,720.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,414,180.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	776,658.20
资产总计		157,361,225.37	68,471,675.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		9,821,366.51	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,993,348.92	684,223.28
应付管理人报酬		328,541.52	527,516.60
应付托管费		86,305.63	2,384.14
应付销售服务费		13,145.54	835.74
应付投资顾问费		-	5,979.70
应交税费		21,792.91	1,250.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	41,238.49	29,007.75
负债合计		12,305,739.52	1,251,197.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	142,781,186.27	67,167,233.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,274,299.58	53,244.04
净资产合计		145,055,485.85	67,220,477.42
负债和净资产总计		157,361,225.37	68,471,675.21

## 6.2 利润表

会计主体：东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划

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
<b>一、营业总收入</b>		3,761,018.16
1. 利息收入		185,303.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,683.58
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		163,619.82
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,242,708.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	3,242,708.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
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）	6.4.7.20	201,881.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	131,124.67
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>706,691.14</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	314,705.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	83,921.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	91,825.16
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		76,130.95
其中：卖出回购金融资产支出		76,130.95
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		10,907.75
8. 其他费用	6.4.7.23	129,200.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,054,327.02</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,054,327.02</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,054,327.02</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划

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）	67,167,233.38	-	53,244.04	67,220,477.42
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）	67,167,233.38	-	53,244.04	67,220,477.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	75,613,952.89	-	2,221,055.54	77,835,008.43
（一）、综合收益总额	-	-	3,054,327.02	3,054,327.02
（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）	75,613,952.89	-	-833,271.48	74,780,681.41
其中：1. 基金申购款	667,048,902.71	-	3,607,048.90	670,655,951.61
2. 基金赎回款	-591,434,949.82	-	-4,440,320.38	-595,875,270.20
（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）	-	-	-	-
（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）	142,781,186.27	-	2,274,299.58	145,055,485.85

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>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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本计划”或“本集合计划”）系原东吴财富 2 号基金优选集合资产管理计划依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《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）改造并经中国证监会规范验收、批准而来的，参照证券投资基金相关规范运作、管理的券商集合资产管理计划。《东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》自 2021 年 12 月 20 日起生效。

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）规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。自 2021 年 12 月 20 日起，《东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《东吴财富 2 号基金优选集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划自本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。本集合计划的管理人为东吴证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司，中国证券登记结算有限责任公司是本计划的注册登记机构。

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、可分离交易可转换债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货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）。其中企业债、公司债、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于 AA，短期融资券债项评级不低于 A-1。本集合计划不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品

种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的资产比例不低于非现金集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货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合计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、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构允许集合计划投资其他品种或变更投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以相应调整上述集合计划的投资范围和投资比例规定。

本集合计划的业绩比较基准为：中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划财务报表以持续经营假设为基础，按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规规定进行确认和计量，基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和持有人权益（计划净值）变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所列示财务信息均按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规规定的政策和规则进行编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币为人民币。除非特别说明，均以人民币元为单位。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成集合计划的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

###### 1. 金融资产的分类

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。金融资产分类取决于资产现金流量特征、合同业务模式，以及本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。

本集合计划的股票投资、债券投资和基金投资等项目于初始确认时即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。

本集合计划将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

## 2. 金融负债的分类

本集合计划的金融负债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负债和其他金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划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；(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1. 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。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。

与上述投资品种形同，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，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2. 对不存在活跃市场的投资品种，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，才可以使用不可观察输入值。

3. 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当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。

#### 6.4.4.7 实收基金

本集合计划的份额面值为人民币 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

#### 6.4.4.8 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基金份额时，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）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 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. 衍生工具收益/（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；

8. 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；

9. 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；

10. 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按本计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本计划投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为本计划费用计入当年损益。

本计划的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认。直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本计划的其他费用如不影响估值日本计划份额净值小数点后第四位，发生时直接计入本集合计划损益；如果影响本集合计划份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入本集合计划损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关集合计划分红条件的前提下，管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时管理人发布的公告，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

3. 集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 由于本集合计划 A 类份额、B 类份额和 C 类份额的费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

5. 法律法规或监管机关、资产管理合同另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期内无外币交易。

#### 6.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

1. 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

2. 本集合计划的管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

3. 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期间无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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

财政部自 2017 年相继发布了《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》等系列具体准则（简称新金融工具准则）。

2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）规定资产管理产品于 2022 年 1 月 1 日执行新金融工具相关会计准则。

为进一步适用《中国人民银行 中国银行保险监督管理委员会 中国证券监督管理委员会 国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号）所涉资产管理

产品的会计处理，细化会计处理指导，财政部编制了《资产管理产品相关会计处理的规定》，并于 2022 年 6 月 2 日印发了财会〔2022〕14 号通知，明确该规定于 2022 年 7 月 1 日起执行。

根据新金融工具会计准则，资管产品持仓金融资产分类调整为“三分类”，即根据产品业务模式和业务合同现金流量特征划分为“以摊余成本计量的金融资产”、“以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产”及“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”。

本集合计划于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。管理人依据新准则的相关规定于报告期初对本集合计划的相关业务模式和金融工具进行了分析，并对部分核算科目等做了调整处理。报告期末管理人依据新金融工具列示规则、中国证监会修订发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》的相关规则编制了本集合计划的财务报表。

本集合计划上个会计期末持有的以摊余成本列示的金融工具的应收利息项目，原经“应收利息”、“应付利息”一级科目单独列示，调整合并至“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”等项目的下级明细科目列示。

以摊余成本计量的金融工具自原“应收利息”项目转入 22,351.73 元至对应金融资产科目。“减值准备”项目无变动，余额为 0.00 元。调整后，转出科目对应项目余额为 0.00 元。

本集合计划上个会计期末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的应收利息项目，原经“应收利息”一级科目单独列示，调整、合并至交易类债券投资等项目下级明细科目列示。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中交易性债券投资项目自“应收利息”项目转入 754,306.47 元。调整后，转出科目对应项目余额为 0.00 元。

除上述变动事项外，新金融工具准则执行事项对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。新金融工具准则的执行对本集合计划金融资产减值准备、公允价值项目无重大影响，对本期期初未分配利润数不构成影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期间无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期间无差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 增值税及附加税

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。此外，应按照增值税的 7% 计算城市建设维护税，按增值税的 3% 计算教育费附加，2% 计算地方教育附加。

## 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)交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

2021 年 6 月 10 日第十三届全国人民代表大会常务委员会第二十九次会议通过《中华人民共和国印花税法》，规定证券交易印花税率为 1%。自 2022 年 7 月 1 日起施行，印花税法同时废止。

## 3. 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。

## 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	2,071,835.40
等于：本金	2,071,349.04
加：应计利息	486.36
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	2,071,835.40

## 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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,235,332.11	383,861.29	18,651,981.09	32,787.69
	银行间市场	127,978,723.00	2,384,987.68	130,553,529.68	189,819.00
	-	-	-	-	-
	合计	146,214,055.11	2,768,848.97	149,205,510.77	222,606.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	146,214,055.11	2,768,848.97	149,205,510.77	222,606.69	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	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金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
净额				-

注：报告期末，本集合计划未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
净额				-

注：报告期末，本集合计划未持有黄金衍生品。

#### 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	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	3,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 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 2022年6月30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					-	-	-
----	--	--	--	--	---	---	---

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-
---

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2022年6月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有列示为债权投资的金融资产。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备

债券	交易所市场	-	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-	-
	OTC 市场	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有权益工具投资。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
应计利息	-
合计	60,492.63

## 6.4.7.9 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	2.50
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,400.20
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,400.20

-	-
应付利息	-
预提费用	28,835.79
合计	41,238.49

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 东吴安鑫中短债 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
上年度末	48,053,361.72	48,053,361.72
本期申购	386,207,215.67	386,207,215.67
本期赎回（以“-”号填列）	-345,665,599.04	-345,665,599.04
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	88,594,978.35	88,594,978.35

## 东吴安鑫中短债 B

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
上年度末	30,010.00	30,010.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000.00	-10,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	20,010.00	20,010.00

## 东吴安鑫中短债 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
上年度末	19,083,861.66	19,083,861.66
本期申购	280,841,687.04	280,841,687.04
本期赎回（以“-”号填列）	-245,759,350.78	-245,759,350.78
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	54,166,197.92	54,166,197.92

## 6.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	减：所得税费用	
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他权益工具投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
二、将重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债权投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投资信用减值准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 东吴安鑫中短债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,494,334.78	-2,454,654.88	39,679.90
本期利润	1,911,054.20	146,128.44	2,057,182.64
本期基金份额交易产生的变动数	1,440,038.40	-2,077,190.69	-637,152.29
其中：基金申购款	21,536,805.40	-19,474,424.24	2,062,381.16
基金赎回款	-20,096,767.00	17,397,233.55	-2,699,533.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,845,427.38	-4,385,717.13	1,459,710.25

## 东吴安鑫中短债 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------



本期期初	18.00	5.44	23.44
本期利润	344.02	35.38	379.40
本期基金份额交易产生的变动数	-69.41	-5.59	-75.00
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-69.41	-5.59	-75.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	292.61	35.23	327.84

## 东吴安鑫中短债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	10,079.39	3,461.31	13,540.70
本期利润	941,046.97	55,718.01	996,764.98
本期基金份额交易产生的变动数	-233,504.38	37,460.19	-196,044.19
其中：基金申购款	1,290,573.88	254,093.86	1,544,667.74
基金赎回款	-1,524,078.26	-216,633.67	-1,740,711.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	717,621.98	96,639.51	814,261.49

## 6.4.7.13 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	13,141.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,412.52
其他	129.11
合计	21,683.58

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-
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	-

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	-
减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	-
买卖股票差价收入	-

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	-
减：交易费用	-
证券出借差价收入	-

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,340,569.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-97,861.13
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	3,242,708.26

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,195,182,443.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,176,447,492.48
减：应计利息总额	18,816,846.30
减：交易费用	15,965.36
买卖债券差价收入	-97,861.13

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
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：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
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：申购债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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：应计利息总额	-
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购资产支持证券成本总额	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	-

## 6.4.7.17.2 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
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	-

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
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	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
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	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	-
买卖权证差价收入	-

## 6.4.7.18.2 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
-	-

## 6.4.7.19 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	-
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	-
----	---

## 6.4.7.20 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	202,611.23
股票投资	-
债券投资	202,611.23
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	729.40
合计	201,881.83

## 6.4.7.21 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	131,124.67
-	-
合计	131,124.67

## 6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
-	-
合计	-

## 6.4.7.23 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	19,835.79

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	15,327.04
账户维护费	18,000.00
货币经纪费	11,329.98
咨询服务费	600.00
证券转换费	4,600.00
合计	129,200.18

#### 6.4.7.24 分部报告

-

#### 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，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本期财务报表批准日，本集合计划无需要披露的日后事项。

#### 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

本报告期内，未发生存在控制关系或重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 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
东吴证券股份有限公司	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国工商银行股份有限公司	集合计划托管人

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内，本集合计划关联方交易主要包括通过集合计划通过关联方交易单元实施的证券交易，关联方通过集合计划取得约定报酬，以及集合计划在关联方开立的资金账户产生的孳息等情形。

##### 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
-	-	-

## 6.4.10.1.2 债券交易

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	
	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	1,449,764,640.65	100.00

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	627,280,000.00	100.00

## 6.4.10.1.4 权证交易

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	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 (%)
-	-	-

## 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 (%)
-	-	-	-	-

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	314,705.61
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值



集合计划的管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	83,921.49

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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			
	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C	合计
东吴证券股份有限公司	-	-	91,187.10	91,187.10
合计	-	-	91,187.10	91,187.10

注：本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，B 类份额的销售服务费按前一日 B 类份额资产净值的 0.01% 年费率计提，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为该类份额每日应计提的销售服务费

E 为该类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中划出，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法

定节假日、公休假等，支付日期顺延。销售服务费由管理人代收，管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。

#### 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30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：报告期内，本集合计划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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30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
-	-	-	-	-

注：报告期内，本集合计划无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30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：股）	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：报告期内，本集合计划无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。

## 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

份额单位：份

项目	本期	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 20 日）持有的基金份额	679,877.07	-	-
报告期初持有的基金份额	681,056.49	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	681,056.49	-	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-	-

注：报告期末，集合计划管理人未持有本集合计划份额。

## 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

份额单位：份

## 东吴安鑫中短债 A

关联方名称	本期末		上年度末	
	2022 年 6 月 30 日		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 (%)	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	-	-	1,361,804.55	2.0300

份额单位：份

## 东吴安鑫中短债 B

关联方名称	本期末	上年度末
	2022 年 6 月 30 日	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 (%)	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

## 东吴安鑫中短债 C

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 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 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

## 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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,071,835.40	13,141.95

注：集合计划银行存款由托管人中国工商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。

## 6.4.10.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划无其他关联方交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

东吴安鑫中短债 A								
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	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴安鑫中短债 B								

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	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴安鑫中短债 C								
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：报告期内，本集合计划未实施利润分配。

#### 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 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	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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：报告期末，本集合计划未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 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：报告期末，本集合计划未持有的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

-

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
012280162	22 海安城建 SCP001	2022 年 7 月 6 日	101.77	100,000	10,177,094.66
合计				100,000	10,177,094.66

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本集合计划未持有交易所市场债券正回购。

#### 6.4.12.4 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	-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有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

-

##### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。信用风险管理的控制目标是对交易对手、投资品种的信用风险进行有效的评估和防范，将信用风险控制于可接受范围内的前提下，获得最高的风险调整收益。

本集合计划的银行存款存放于本集合计划的基金托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在证券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并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

本集合计划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。截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占计划资产净值的比例为 93.71%。

##### 6.4.13.2.1 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	113,755,117.62	4,999,000.00
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	12,871,905.42	21,019,585.00
合计	126,627,023.04	26,018,585.00

注：1. 短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要为剩余期限在一年以内的国债。

2. 本期末债券投资列示数据为期末公允价值（含息）。

##### 6.4.13.2.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	7,183,540.00
AAA 以下	22,180,144.94	3,807,524.00
-	-	-
未评级	398,342.79	-
合计	22,578,487.73	10,991,064.00

注：1. 长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

2. 本期末债券投资列示数据为期末公允价值（含息）。

#### 6.4.13.2.5 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-



-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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 2022 年 6 月 30 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	-	-	-	-
上年度末 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	-	-	-	-

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在基金运作过程中按照《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》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划所持大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。期末除本报告“期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券”章节中所列示的债券外，其余资产均能及时变现，投资组合变现能力较好。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性资产的公允价值或未来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资及买入返售金融资产；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。管理人通过久期、压力测试等指标或方法评估组合面临的利率风险敞口，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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,071,835.40	-	-	-	2,071,835.40
结算备付金	970,595.03	-	-	-	970,595.03
存出保证金	32,601.06	-	-	-	32,601.06
交易性金融资产	126,627,023.04	22,180,144.94	398,342.79	-	149,205,510.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,020,190.48	2,020,190.48
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	132,702,054.53	22,180,144.94	398,342.79	2,080,683.11	157,361,225.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,993,348.92	1,993,348.92
应付管理人报酬	-	-	-	328,541.52	328,541.52
应付托管费	-	-	-	86,305.63	86,305.63
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	9,821,366.51	-	-	-	9,821,366.51
应付销售服务费	-	-	-	13,145.54	13,145.54
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21,792.91	21,792.91
其他负债	-	-	-	41,238.49	41,238.49
负债总计	9,821,366.51	-	-	2,484,373.01	12,305,739.52
利率敏感度缺口	122,880,688.02	22,180,144.94	398,342.79	-403,689.90	145,055,485.85

上年度末 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	2,743,036.08	-	-	-	2,743,036.08
结算备付金	114,337.55	-	-	-	114,337.55
存出保证金	578.65	-	-	-	578.65
交易性金融资产	33,202,125.00	3,807,524.00	-	-	37,009,649.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	26,040,514.56	-	-	-	26,040,514.56
应收利息	-	-	-	776,658.20	776,658.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,414,180.35	1,414,180.35
应收证券清算款	-	-	-	372,720.82	372,720.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	62,100,591.84	3,807,524.00	-	2,563,559.37	68,471,675.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	684,223.28	684,223.28
应付管理人报酬	-	-	-	527,516.60	527,516.60
应付托管费	-	-	-	2,384.14	2,384.14
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	835.74	835.74
应付交易费用	-	-	-	5,979.70	5,979.70
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,250.58	1,250.58
其他负债	-	-	-	29,007.75	29,007.75
负债总计	-	-	-	1,251,197.79	1,251,197.79
利率敏感度缺口	62,100,591.84	3,807,524.00	-	1,312,361.58	67,220,477.42

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本集合计划于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 50 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析仅包含证券公允价值变动对基金资产净值的影响		
	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）
分析	市场利率下降 50	372,291.77	40,550.63

	个基点		
	市场利率上升 50 个基点	-366,364.86	-40,379.69

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务	-	-	-	-

费				
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-
	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
项目	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 汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	-	-	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本集合计划所持有的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本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债券，其他价格风险对于本集合计划的基金净值无重大影响。

##### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	149,205,510.77	102.86	37,009,649.00	55.06
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	149,205,510.77	102.86	37,009,649.00	55.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变 动	本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月 31日）
分析	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 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（2022年6月 30日）	上年度末（2021年 12月31日）
	-	-	-
	合计	-	-

#### 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	-	-
第二层次	149,205,510.77	37,763,955.47
第三层次	-	-
合计	149,205,510.77	37,763,955.47

注：本期末和上年度末金融工具中交易性债券投资列示数据均包含期间利息。

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

报告期末，本集合计划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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,205,510.77	94.82
	其中：债券	149,205,510.77	94.82
	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	3,000,000.00	1.91
	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	3,042,430.43	1.93
-	-	-	-
8	其他各项资产	2,113,284.17	1.34
9	合计	157,361,225.37	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-

注：本报告期末，本集合计划未持境内股票资产。

### 7.2.2 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，本集合计划未持有经港股通投资的股票资产。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有股票资产。

## 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（%）
-	-	-	-	-

注：报告期内，本集合计划未参与股票交易业务。

## 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（%）
-	-	-	-	-

注：报告期内，本集合计划未参与股票交易业务。

## 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	-
卖出股票收入（成交）总额	-

注：报告期内，本集合计划未参与股票交易业务。

## 7.5 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	13,270,248.21	9.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,381,732.88	3.71
5	企业短期融资券	103,297,157.07	71.21
6	中期票据	27,256,372.61	18.79
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,205,510.77	102.86

## 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

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（%）
1	102002037	20 上虞国投 MTN002	100,000	10,426,203.29	7.19
2	012103820	21 中关村科技 SCP004	100,000	10,221,742.47	7.05
3	012280162	22 海安城建 SCP001	100,000	10,177,094.66	7.02
4	012280314	22 丹投 SCP001	100,000	10,167,319.18	7.01
5	042280120	22 南部新城 CP001	100,000	10,113,570.55	6.97

### 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

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：报告期末，本集合计划未持有资产支持证券资产。

### 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

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：报告期末，本集合计划未持有贵金属资产。

### 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

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：报告期末，本集合计划未持有权证资产。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

报告期末，本集合计划未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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

报告期末，本集合计划未持有股票资产。

### 7.11.3 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	32,601.06
2	应收清算款	2,020,190.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
-	-	-
8	其他	-
9	合计	2,113,284.17

### 7.11.4 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：报告期末，本集合计划未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 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：报告期末，本集合计划未持有股票资产。

### 7.11.6 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。

## § 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 (%)
东吴安鑫中短债 A	466	190,117.98	29,343,028.69	33.12	59,251,949.66	66.88
东吴安鑫中短债 B	2	10,005.00	0.00	0	20,010.00	100
东吴安鑫中短债 C	167	324,348.49	2,885,573.22	5.33	51,280,624.70	94.67
合计	635	224,852.26	32,228,601.91	22.57	110,552,584.36	77.43

### 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	东吴安鑫中短债 A	-	-
	东吴安鑫中短债 B	-	-
	东吴安鑫中短债 C	-	-
	合计	-	-

注：报告期末，本集合计划从业人员无持有本计划份额的情况。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东吴安鑫中短债 A	-
	东吴安鑫中短债 B	-
	东吴安鑫中短债 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴安鑫中短债 A	-
	东吴安鑫中短债 B	-
	东吴安鑫中短债 C	-
	合计	-

注：报告期末，管理人公司高级管理人员、集合计划投资和研究部门负责人、集合计划投资经理无持有本计划份额的情况。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 20 日）基金份额总额	19,375,828.72	-	-
本报告期期初基金份额总额	48,053,361.72	30,010.00	19,083,861.66
本报告期基金总申购份额	386,207,215.67	-	280,841,687.04
减：本报告期基金总赎回份额	345,665,599.04	10,000.00	245,759,350.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	88,594,978.35	20,010.00	54,166,197.92

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召集份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，无涉及本集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

报告期内，管理人东吴证券股份有限公司总裁由范力变更为薛臻。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本集合计划投资策略未发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划聘请公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）为外部审计服务机构。

## 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

报告期内，本集合计划管理人、托管人及其相关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	0.00	0.00	0.00	0.00	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东吴证券	1,449,764,640.65	100.00	627,280,000.00	100.00	-	-

## 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	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划投资经理变更公告	证券时报、基金电子披露网站及管理人网站	2022-1-20
2	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划 2021 年第 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2022-1-21
3	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划招募说明书更新、基金产品资料概要更新	基金电子披露网站及管理人网站	2022-1-25
4	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划暂停申购公告	证券时报、基金电子披露网站及管理人网站	2022-1-25
5	东吴证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、基金电子披露网站及管理人网站	2022-3-14
6	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划暂停申购公告	证券时报、基金电子披露网站及管理人网站	2022-3-31
7	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划 2021 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2022-3-31
8	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划限制大额申购（含定投）业务的公告	证券时报、基金电子披露网站及管理人网站	2022-4-6
9	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划 2022 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2022-4-21

10	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划暂停申购公告	证券时报、基金电子披露网站及管理人网站	2022-4-22
11	东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2022-7-21

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会关于准予东吴财富 2 号基金优选集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划招募说明书；
3. 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同；
4. 东吴安鑫中短债债券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。



## 12.2 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。

## 12.3 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：<http://www.dwzq.com.cn>。

东吴证券股份有限公司

2022 年 8 月 30 日