

东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合
资产管理计划
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴证券股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	10
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
§ 5 托管人报告	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
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	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	55
7.1 期末基金资产组合情况	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60

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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 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	160,925,523.69 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	91,506,653.45 份	33,577,974.63 份	35,840,895.61 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	陆志俊
	联系电话	021-60199757	95559
	电子邮箱	xuxue@dwzq.com.cn	luzj@bankcomm.com
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 18 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.dwzq.com.cn/
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	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

§ 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 数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
本期已实现 收益	1,419,871.05	516,018.06	555,793.43
本期利润	2,108,843.56	693,738.47	895,031.38

加权平均基金份额本期利润	0.0208	0.0204	0.0217
本期加权平均净值利润率	2.60%	2.53%	2.73%
本期基金份额净值增长率	2.24%	2.55%	2.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
期末可供分配利润	-18,960,965.25	-6,663,794.98	-7,633,254.46
期末可供分配基金份额利润	-0.2072	-0.1985	-0.2130
期末基金资产净值	72,545,688.20	26,914,179.65	28,207,641.15
期末基金份额净值	0.7928	0.8015	0.7870
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-20.72%	-19.85%	-21.30%

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
过去一个月	1.98%	0.66%	-0.28%	0.55%	2.26%	0.11%
过去三个月	-1.71%	0.70%	-2.48%	0.49%	0.77%	0.21%
过去六个月	2.24%	0.69%	2.39%	0.47%	-0.15%	0.22%
过去一年	-14.10%	0.77%	-2.48%	0.57%	- 11.62%	0.20%
自基金合同生效起至今	-20.72%	0.86%	-6.28%	0.70%	- 14.44%	0.16%

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
过去一个月	2.02%	0.66%	-0.28%	0.55%	2.30%	0.11%
过去三个月	-1.57%	0.70%	-2.48%	0.49%	0.91%	0.21%
过去六个月	2.55%	0.69%	2.39%	0.47%	0.16%	0.22%
过去一年	-13.58%	0.77%	-2.48%	0.57%	- 11.10%	0.20%
自基金合同生效起至今	-19.85%	0.86%	-6.28%	0.70%	- 13.57%	0.16%

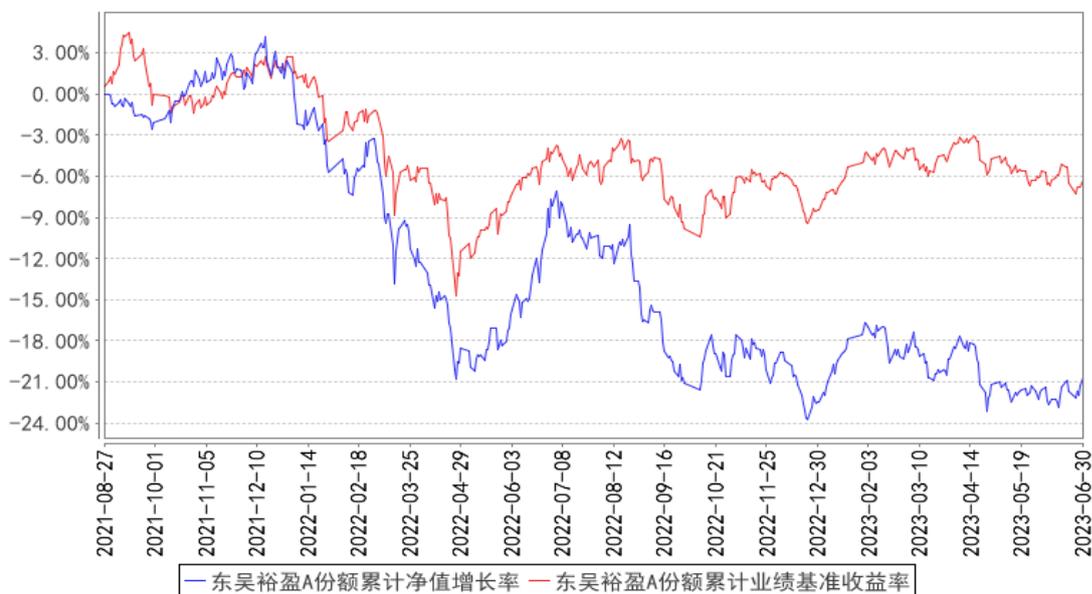
东吴裕盈 C 份额

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
过去一个月	1.94%	0.66%	-0.28%	0.55%	2.22%	0.11%
过去三个月	-1.82%	0.70%	-2.48%	0.49%	0.66%	0.21%
过去六个月	2.04%	0.69%	2.39%	0.47%	-0.35%	0.22%
过去一年	-14.45%	0.77%	-2.48%	0.57%	- 11.97%	0.20%

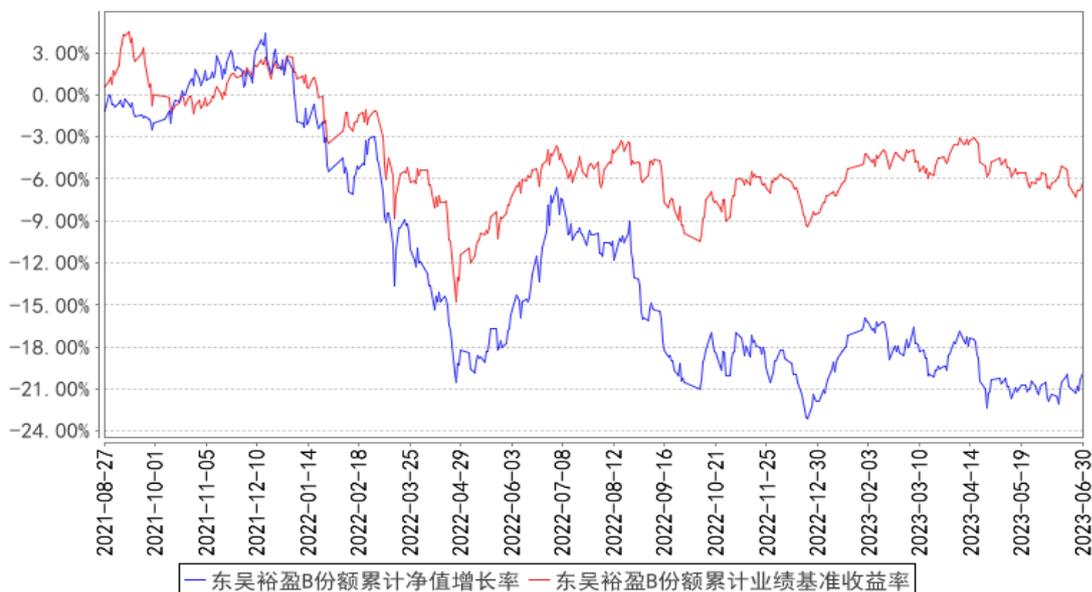
自基金合同生效 起至今	-21.30%	0.86%	-6.28%	0.70%	-	15.02%	0.16%
----------------	---------	-------	--------	-------	---	--------	-------

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

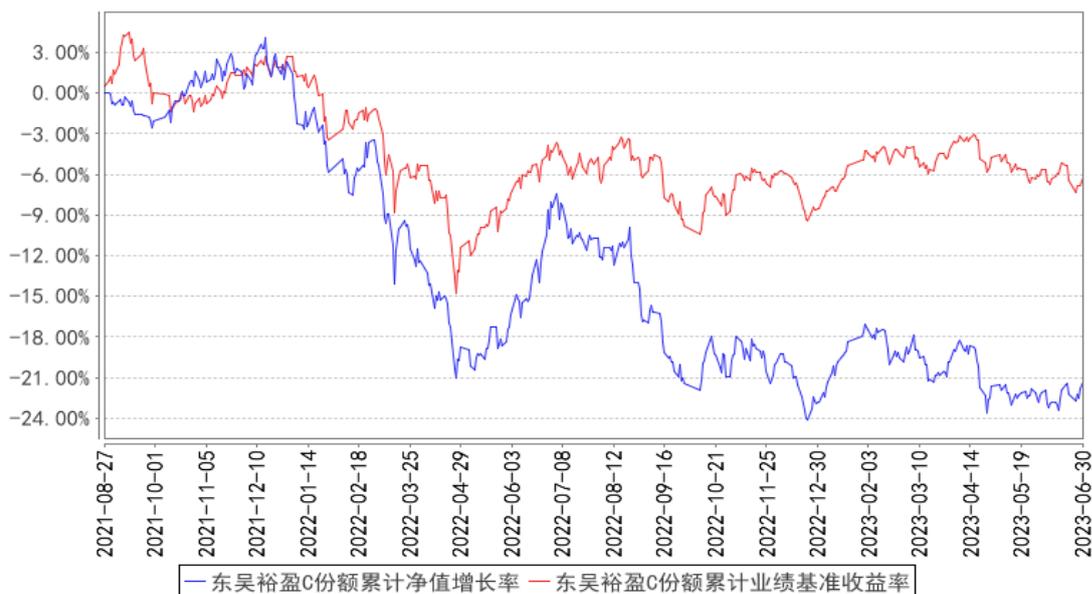
东吴裕盈A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2023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		
李果	投资经理	2021 年 8 月 27 日	-	11 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。

4.1.3 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，通过各项内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

A 股市场对经济复苏的态度经历了 22 年底很强的乐观预期，到 23 年 2 月份以后对复苏强度放缓的担忧，再到二季度逐月公布的宏观数据（PMI，PPI，工业利润、社融等）全面低于预期所带来的悲观情绪扩大的过程。与之呼应，投资者的情绪也呈现出“高开低走”状态。经济复苏的不达预期也使得人民币贬值压力上升，并在 6 月 30 日达到本轮贬值（中间价 7.2730）的低点。整个二季度北上资金也停下了净流入的步伐。

美债利率居高不下，国内经济复苏动能趋弱的大背景下，沪深 300 指数基本上将一季度累积的涨幅全部会吐，尤其整个总量经济板块在整个二季度表现乏善可陈。硬币的另一面，市场流动性继续宽松，也给以 AI 为代表的主题投资表现的机会。

市场呈现显著“存量博弈”板块轮动的特点。一方面，资金更加短视，更看重短期状况和边际变化，聚焦关注资产的月度、甚至更短维度的环比变化，而不愿意从年度或更长一点的时间评估企业价值。另一方面，传统估值锚不在，上涨的板块估值权重不高。

管理人在整个季度保持了中等偏高的仓位。持仓集中在光储、火绿电、TMT 和国央企。本季度产品净值跑赢沪深 300。

回望整个宏观经济，市场基本形成了共识，中国经济的决策机制发生了一定变化。未来较长的一段时间，“高质量发展”才是经济政策着力的核心，政策的主基调依然是托底。在此前提下，国内经济波动的斜率将大概率更加平缓。因此，市场的表现不应该寄希望于估值模型的分母端弹性。与此同时，我们认为中国经济没有系统性失速的大背景下，产业的微观结构会发生积极有益的变化。体现在，一方面宏观层面微小的改善会变成超预期因素，另一方面，行业供给侧的优化使得优秀的企业走出来，获取更大的市场份额，尤以上市公司为代表。

流动性层面，我们保持国内宽松，国外中性的判断。欧美虽然表态鹰派，短期美债收益率处于高位，但美国通胀大概率将在三季度见顶，对新兴市场的估值压制应该有所缓解。

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 2.24%，本集合计划 B 份额净值增长率为 2.55%，本集合计划 C 份额净值增长率为 2.04%，业绩比较基准收益率为 2.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点，市场预期和情绪均处于低点，A 股估值的整体性价比较高。我们认为三季度首先应

该重点关注板块和上市公司的业绩修复。这些板块集中在以光储为代表的新能源，以半导体为代表的高端制造板块，以医药生物和必选消费为代表的下游行业。其次，我们也会适当参与主题投资。中特估和受益 AI 的场景应用板块是主要选择的方向。

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、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。

4.7 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

2023 年上半年度，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、集合计划合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害集合计划持有人利益的行为。

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

2023 年上半年度，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、计划资产净值的计算、计划份额申购赎回价格的计算、费用开支等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

本报告期内本集合计划未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2023 年上半年度，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 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,005,467.47	10,324,846.50
结算备付金		3,125,994.09	2,825,532.95
存出保证金		84,950.58	133,991.83
交易性金融资产	6.4.7.2	79,292,535.50	104,659,271.19
其中：股票投资		79,292,535.50	95,794,234.00
基金投资		-	-
债券投资		-	8,865,037.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	40,987,252.24	-8,097.53
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		2,917,226.12	36,016,195.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		134,413,426.00	153,951,740.01
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,981,919.66	1,488,740.08
应付赎回款		796.10	127,799.25
应付管理人报酬		50,012.90	64,571.90
应付托管费		21,031.15	26,146.99
应付销售服务费		9,232.75	12,948.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		29,221.90	68.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,653,702.54	2,955,602.10
负债合计		6,745,917.00	4,675,877.70
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	160,925,523.69	192,492,687.53
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-33,258,014.69	-43,216,825.22
净资产合计		127,667,509.00	149,275,862.31
负债和净资产总计		134,413,426.00	153,951,740.01

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 160,925,523.69 份。其中下属 A 类集合计划份额净值人民币 0.7928 元，份额总额 91,506,653.45 份；下属 B 类集合计划份额净值人民币 0.8015 元，份额总额 33,577,974.63 份；下属 C 类集合计划份额净值人民币 0.7870 元，份额总额 35,840,895.61 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,311,860.38	-22,800,841.41
1. 利息收入		343,740.50	604,425.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	88,005.48	153,801.58
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		255,735.02	450,623.67
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,749,768.86	-40,593,585.20
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,233,222.28	-41,701,751.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-971,887.93	88,668.93
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	488,434.51	1,019,497.86
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	1,205,930.87	17,188,221.38
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	12,420.15	97.16
减：二、营业总支出		614,246.97	953,072.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	339,970.72	526,640.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	140,514.99	207,306.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	65,326.68	112,658.81
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		15,586.32	2.35
8. 其他费用	6.4.7.23	52,848.26	106,464.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,697,613.41	-23,753,914.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,697,613.41	-23,753,914.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,697,613.41	-23,753,914.16

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	192,492,687.53	-	-43,216,825.22	149,275,862.31
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）	192,492,687.53	-	-43,216,825.22	149,275,862.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,567,163.84	-	9,958,810.53	-21,608,353.31
（一）、综合收益总额	-	-	3,697,613.41	3,697,613.41
（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）	-31,567,163.84	-	6,261,197.12	-25,305,966.72
其中：1. 基金申购款	66,094.69	-	-13,241.26	52,853.43
2. 基金赎回款	-31,633,258.53	-	6,274,438.38	-25,358,820.15

(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、本期末净资产(基金净值)	160,925,523.69	-	-33,258,014.69	127,667,509.00
项目	上年度可比期间 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)	233,632,939.65	-	5,726,305.54	239,359,245.19
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)	233,632,939.65	-	5,726,305.54	239,359,245.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	660,873.96	-	-23,824,691.17	-23,163,817.21
(一)、综合收益总额	-	-	-23,753,914.16	-23,753,914.16
(二)、本期基金份额	660,873.96	-	-70,777.01	590,096.95

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	1,069,767.21	-	-106,406.75	963,360.46
2. 基金赎回款	-408,893.25	-	35,629.74	-373,263.51
(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、本期末净资产(基金净值)	234,293,813.61	-	-18,098,385.63	216,195,427.98

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：

高海明

姚眺

丁俊

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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与

格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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。

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

本集合计划本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

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，印花税暂行条例同时废止。

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法》、《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。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	8,005,467.47
等于：本金	8,003,111.16
加：应计利息	2,356.31
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	8,005,467.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	77,391,976.04	-	79,292,535.50	1,900,559.46
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	77,391,976.04	-	79,292,535.50	1,900,559.46

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 2023 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	-	-	-	
-	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
-	-	-	-	
权益衍生 工具	-	-	-	
-	-	-	-	

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。

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 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	40,987,252.24	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	40,987,252.24	-

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 2023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。

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 2023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
----	-----

		2023 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	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
	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 2023年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有其他权益工具投资。

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 2023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 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30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	-
应付交易费用	3,406,879.68
其中：交易所市场	3,406,879.68
银行间市场	-

-	-
应付利息	-
预提费用	246,822.86
合计	3,653,702.54

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东吴裕盈 A 份额

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,499,015.18	110,499,015.18
本期申购	51,675.91	51,675.91
本期赎回（以“-”号填列）	-19,044,037.64	-19,044,037.64
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	91,506,653.45	91,506,653.45

东吴裕盈 B 份额

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,210,581.04	34,210,581.04
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-632,606.41	-632,606.41
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	33,577,974.63	33,577,974.63

东吴裕盈 C 份额

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,783,091.31	47,783,091.31
本期申购	14,418.78	14,418.78
本期赎回（以“-”号填列）	-11,956,614.48	-11,956,614.48
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	35,840,895.61	35,840,895.61

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

东吴裕盈 A 份额

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-23,261,633.07	-1,556,382.88	-24,818,015.95
本期利润	1,419,871.05	688,972.51	2,108,843.56
本期基金份额交易产生的变动数	3,712,468.19	35,738.95	3,748,207.14
其中：基金申购款	-10,036.50	-223.98	-10,260.48
基金赎回款	3,722,504.69	35,962.93	3,758,467.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,129,293.83	-831,671.42	-18,960,965.25

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
上年度末	-3,706,176.54	-3,764,446.05	-7,470,622.59
本期利润	516,018.06	177,720.41	693,738.47
本期基金份额交易产生的变动数	52,570.42	60,518.72	113,089.14
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	52,570.42	60,518.72	113,089.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,137,588.06	-3,526,206.92	-6,663,794.98

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
上年度末	-10,251,907.39	-676,279.29	-10,928,186.68
本期利润	555,793.43	339,237.95	895,031.38
本期基金份额交易产生的变动数	2,391,641.34	8,259.50	2,399,900.84
其中：基金申购款	-2,877.90	-102.88	-2,980.78
基金赎回款	2,394,519.24	8,362.38	2,402,881.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,304,472.62	-328,781.84	-7,633,254.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	65,870.93
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	21,246.10
其他	888.45
合计	88,005.48

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,233,222.28
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	3,233,222.28

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	355,780,457.41

减：卖出股票成本总额	351,484,464.24
减：交易费用	1,062,770.89
买卖股票差价收入	3,233,222.28

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。

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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,561.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-975,449.88
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	-971,887.93

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,732,077.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,678,893.07
减：应计利息总额	27,972.65
减：交易费用	661.54
买卖债券差价收入	-975,449.88

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。

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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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 2023年1月1日至2023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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
-	-

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	488,434.51
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	488,434.51

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,209,061.79
股票投资	206,442.38
债券投资	1,002,619.41
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	3,130.92
合计	1,205,930.87

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,420.15
-	-
合计	12,420.15

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,025.40

账户维护费	-36,000.00
合计	52,848.26

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。

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	集合计划托管人
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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	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	690,689,712.66	100.00	1,152,810,329.95	100.00
------------	----------------	--------	------------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	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	16,538,374.05	100.00	7,732,314.70	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	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	2,974,000,000.00	100.00	5,330,900,000.00	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	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 2023年1月1日至2023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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
东吴证券股份有限公司	652,469.65	100.00	3,406,879.68	100.00

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东吴证券股份有 限公司	1,089,414.77	100.00	1,988,255.23	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 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	339,970.72	526,640.94
其中：支付销售机构的客户维护 费	-	-

注：本集合计划 B 类份额不收取固定管理费，A 类份额、C 类份额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：

$$\text{每日应计提的集合计划管理费} = \text{前一日该类集合计划资产净值} \times 0.60\% / 365。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 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	140,514.99	207,306.04

注：本集合计划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：

$$\text{每日应计提的集合计划托管费} = \text{前一日集合计划资产净值} \times 0.2\% / 365。$$

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 2023年1月1日至2023年6月30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	-	-	65,171.13	65,171.13
合计	-	-	65,171.13	65,171.13
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	112,427.86	112,427.86
合计	-	-	112,427.86	112,427.86

注：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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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：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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
-	-	-	-	-
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
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	-	5,040,277.39	-

份额			
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	-	-	-
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	-	3.1300%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
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	-	5,040,277.39	-
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	-	-	-
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	-	2.1500%	-

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

东吴裕盈 A 份额

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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

东吴裕盈 B 份额

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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（苏州）金融科技有限公司	177,745.53	0.1100	177,745.53	0.0900
东吴创新资本管理有限责任公司	17,784,286.27	11.0500	17,784,286.27	9.2400

份额单位：份

东吴裕盈 C 份额

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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 (%)
东吴证券尊享1号FOF单一资产管理计划	1,015,847.22	0.6300	1,015,847.22	0.5300

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	8,005,467.47	65,870.93	44,857,942.68	108,686.67

注：集合计划银行存款由托管人交通银行保管，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 2023年1月1日至2023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）	总金额

				位：张)	
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-

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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 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					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
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未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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：截至本报告期末，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：截至本报告期末，本集合计划未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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，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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

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：截至本报告期末，本集合计划本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划债券投资的信用评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	8,865,037.19
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	8,865,037.19

注：报告期末，本集合计划未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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 2023 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 2022 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 6.4.12 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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	8,005,467.47	-	-	-	8,005,467.47
结算备付金	3,125,994.09	-	-	-	3,125,994.09
存出保证金	84,950.58	-	-	-	84,950.58
交易性金融资产	-	-	-	79,292,535.50	79,292,535.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	40,987,252.24	-	-	-	40,987,252.24
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,917,226.12	2,917,226.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,203,664.38	-	-	82,209,761.62	134,413,426.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	796.10	796.10
应付管理人报酬	-	-	-	50,012.90	50,012.90
应付托管费	-	-	-	21,031.15	21,031.15
应付清算款	-	-	-	2,981,919.66	2,981,919.66
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	9,232.75	9,232.75
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	29,221.90	29,221.90
其他负债	-	-	-	3,653,702.54	3,653,702.54
负债总计	-	-	-	6,745,917.00	6,745,917.00
利率敏感度缺口	52,203,664.38	-	-	75,463,844.62	127,667,509.00
上年度末 2022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	10,315,433.89	-	-	9,412.61	10,324,846.50
结算备付金	2,824,135.07	-	-	1,397.88	2,825,532.95
存出保证金	133,925.50	-	-	66.33	133,991.83
交易性金融资产	-	3,854,473.04	4,997,275.80	95,807,522.35	104,659,271.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-8,097.53	-8,097.53

债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	36,016,195.07	36,016,195.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,273,494.46	3,854,473.04	4,997,275.80	131,826,496.71	153,951,740.01
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	127,799.25	127,799.25
应付管理人报酬	-	-	-	64,571.90	64,571.90
应付托管费	-	-	-	26,146.99	26,146.99
应付清算款	-	-	-	1,488,740.08	1,488,740.08
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	12,948.44	12,948.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	68.94	68.94
其他负债	-	-	-	2,955,602.10	2,955,602.10
负债总计	-	-	-	4,675,877.70	4,675,877.70
利率敏感度缺口	13,273,494.46	3,854,473.04	4,997,275.80	127,150,619.01	149,275,862.31

6.4.13.4.1.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
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 2022 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	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
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	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	-	-	-

6.4.13.4.3 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。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	79,292,535.50	62.11	95,794,234.00	64.17
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	79,292,535.50	62.11	95,794,234.00	64.17

6.4.13.4.3.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	权益投资公允价值减少 5%	-3,964,626.77	-4,789,711.70
	权益投资公允价值增加 5%	3,964,626.77	4,789,711.70

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 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	79,292,535.50	104,659,271.19
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	79,292,535.50	104,659,271.19

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

不以公允价值计量的金融工具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。

6.4.14.4 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。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。

6.4.15 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	79,292,535.50	58.99
	其中：股票	79,292,535.50	58.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	40,987,252.24	30.49
	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	11,131,461.56	8.28
-	-	-	-
8	其他各项资产	3,002,176.70	2.23
9	合计	134,413,426.00	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	46,662,336.50	36.55
D	电力、热力、燃气及水生产和	10,942,974.00	8.57

	供应业		
E	建筑业	4,769,154.00	3.74
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,077,856.00	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,840,215.00	11.62
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	79,292,535.50	62.11

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：本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002129	TCL 中环	316,850	10,519,420.00	8.24
2	002324	普利特	706,000	10,074,620.00	7.89
3	688036	传音控股	36,152	5,314,344.00	4.16
4	601868	中国能建	2,038,100	4,769,154.00	3.74
5	600050	中国联通	918,000	4,406,400.00	3.45
6	600021	上海电力	391,500	4,216,455.00	3.30
7	002475	立讯精密	123,700	4,014,065.00	3.14
8	601991	大唐发电	1,199,900	3,971,669.00	3.11
9	300682	朗新科技	161,600	3,762,048.00	2.95
10	600132	重庆啤酒	33,300	3,068,928.00	2.40
11	600079	人福医药	108,500	2,922,990.00	2.29
12	600011	华能国际	297,500	2,754,850.00	2.16
13	003021	兆威机电	30,600	2,684,538.00	2.10
14	300760	迈瑞医疗	8,800	2,638,240.00	2.07

15	688088	虹软科技	50,956	2,178,369.00	1.71
16	600794	保税科技	590,300	2,077,856.00	1.63
17	002436	兴森科技	130,100	2,016,550.00	1.58
18	601698	中国卫通	97,000	1,928,360.00	1.51
19	002401	中远海科	51,500	1,355,480.00	1.06
20	300408	三环集团	46,000	1,350,100.00	1.06
21	688596	正帆科技	30,985	1,341,650.50	1.05
22	002268	电科网安	43,400	1,209,558.00	0.95
23	002865	钧达股份	4,700	716,891.00	0.56

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600021	上海电力	20,038,750.00	13.42
2	600079	人福医药	15,560,336.00	10.42
3	600011	华能国际	14,914,510.34	9.99
4	601868	中国能建	12,761,184.00	8.55
5	601991	大唐发电	12,285,300.00	8.23
6	300316	晶盛机电	11,460,984.64	7.68
7	000786	北新建材	10,776,473.00	7.22
8	300760	迈瑞医疗	8,979,018.00	6.02
9	000589	贵州轮胎	8,103,429.40	5.43
10	002436	兴森科技	7,585,445.00	5.08
11	002865	钧达股份	7,309,776.35	4.90
12	600050	中国联通	7,135,988.00	4.78
13	002714	牧原股份	6,693,947.00	4.48
14	002049	紫光国微	6,677,539.00	4.47
15	000938	紫光股份	6,658,300.00	4.46
16	688025	杰普特	5,952,019.92	3.99
17	688036	传音控股	5,926,360.66	3.97
18	002475	立讯精密	5,687,890.00	3.81
19	002129	TCL 中环	5,417,705.00	3.63
20	600557	康缘药业	5,222,612.00	3.50
21	002324	普利特	5,197,485.00	3.48
22	002116	中国海诚	5,068,560.00	3.40
23	002011	盾安环境	5,067,992.00	3.40
24	688088	虹软科技	4,966,369.03	3.33
25	300682	朗新科技	4,628,610.00	3.10
26	002120	韵达股份	4,562,369.00	3.06
27	601888	中国中免	4,421,966.00	2.96
28	002291	遥望科技	4,040,804.43	2.71
29	002268	电科网安	3,878,700.00	2.60

30	600030	中信证券	3,873,512.00	2.59
31	600478	科力远	3,842,544.00	2.57
32	603688	石英股份	3,839,457.00	2.57
33	600498	烽火通信	3,502,640.00	2.35
34	688596	正帆科技	3,494,193.53	2.34
35	003021	兆威机电	3,467,787.00	2.32
36	600132	重庆啤酒	3,288,343.00	2.20
37	601208	东材科技	3,173,638.00	2.13
38	600418	江淮汽车	3,102,809.00	2.08
39	600499	科达制造	3,006,818.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600021	上海电力	16,516,036.18	11.06
2	300316	晶盛机电	16,199,177.50	10.85
3	000786	北新建材	13,426,391.18	8.99
4	600011	华能国际	13,403,133.13	8.98
5	600079	人福医药	13,306,607.00	8.91
6	600030	中信证券	11,213,015.25	7.51
7	300760	迈瑞医疗	10,229,853.00	6.85
8	002268	电科网安	9,667,394.20	6.48
9	601991	大唐发电	9,059,248.00	6.07
10	000589	贵州轮胎	8,504,948.40	5.70
11	002291	遥望科技	8,257,833.00	5.53
12	601868	中国能建	7,694,388.00	5.15
13	000983	山西焦煤	7,238,167.00	4.85
14	002865	钧达股份	7,066,186.62	4.73
15	000938	紫光股份	6,935,888.00	4.65
16	688025	杰普特	6,751,572.35	4.52
17	002179	中航光电	6,207,244.43	4.16
18	002324	普利特	6,177,629.00	4.14
19	002049	紫光国微	6,003,060.72	4.02
20	002714	牧原股份	5,836,015.00	3.91
21	600557	康缘药业	5,735,230.00	3.84
22	002436	兴森科技	5,536,318.00	3.71
23	002352	顺丰控股	5,423,315.00	3.63
24	002120	韵达股份	5,196,764.00	3.48
25	002011	盾安环境	5,141,469.00	3.44
26	300087	荃银高科	5,024,025.00	3.37
27	600316	洪都航空	4,918,954.80	3.30
28	002116	中国海诚	4,913,224.00	3.29
29	600905	三峡能源	4,872,518.00	3.26

30	601778	晶科科技	4,567,207.00	3.06
31	300747	锐科激光	4,447,217.00	2.98
32	601888	中国中免	4,155,990.68	2.78
33	600478	科力远	3,844,178.00	2.58
34	603688	石英股份	3,823,850.00	2.56
35	603345	安井食品	3,607,920.00	2.42
36	600887	伊利股份	3,560,625.00	2.39
37	600498	烽火通信	3,429,880.00	2.30
38	600418	江淮汽车	3,340,331.00	2.24
39	300142	沃森生物	3,207,421.00	2.15
40	601208	东材科技	3,188,859.00	2.14
41	002129	TCL 中环	3,160,027.00	2.12
42	601985	中国核电	3,036,495.00	2.03
43	600309	万华化学	3,017,910.00	2.02

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	334,750,232.38
卖出股票收入（成交）总额	355,780,457.41

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。

7.5 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投资。

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（%）
-	-	-	-	-	-

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：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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。

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：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本集合计划投资的前十名证券内，“TCL 中环”（证券代码：002129）的发行主体 TCL 中环新能源科技股份有限公司公告称，其董事王成先生因原任职公司在收购项目中未按规定履行报告、公

告等信息披露义务，未按规定履行收购的公告、发出收购要约义务，于本报告编制日前一年内收到广东证监局出具的《行政处罚事先告知书》（广东证监处罚字[2022]19号），被给予警告，并处以 100 万元罚款。上述《行政处罚事先告知书》涉及的被处罚主体并非该公司，且涉及的事项与该公司无关。

本集合计划管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本集合计划管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本集合计划投资的其余前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	84,950.58
2	应收清算款	2,917,226.12
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	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	3,002,176.70

7.12.4 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（%）
-	-	-	-	-

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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 (%)
东吴裕盈 A 份额	1,035	88,412.23	2,571,071.58	2.81	88,935,581.87	97.19
东吴裕盈 B 份额	140	239,842.68	23,002,309.19	68.50	10,575,665.44	31.50
东吴裕盈 C 份额	408	87,845.33	1,015,847.22	2.83	34,825,048.39	97.17
合计	1,583	101,658.57	26,589,227.99	16.52	134,336,295.70	83.48

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	东吴裕盈 A 份额	100,745.52	0.0600
	东吴裕盈 B 份额	285,248.27	0.1800
	东吴裕盈 C 份额	-	-
	合计	385,993.79	0.2400

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	东吴裕盈 A 份额	0
	东吴裕盈 B 份额	0~10
	东吴裕盈 C 份额	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴裕盈 A 份额	10~50
	东吴裕盈 B 份额	10~50
	东吴裕盈 C 份额	-
	合计	10~50

§ 9 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	-
本报告期期初基金份额总额	110,499,015.18	34,210,581.04	47,783,091.31
本报告期基金总申购份额	51,675.91	-	14,418.78
减：本报告期基金总赎回份额	19,044,037.64	632,606.41	11,956,614.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	91,506,653.45	33,577,974.63	35,840,895.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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，无涉及本集合计划管理人、托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为外部审计服务机构，未改聘会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
------	----

受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	690,689,712.66	100.00	652,469.65	100.00	-

注：截至报告期末，当期佣金支付金额为 0.00 元。

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 (%)
东吴证券股份有限公司	16,538,374.05	100.00	2,974,000,000.00	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 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-1-20
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 2022 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-3-31
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 2023 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-4-21

§ 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

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

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 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。

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：www.dwzq.com.cn。

东吴证券股份有限公司

2023 年 8 月 30 日