

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 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：东吴证券股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	东吴裕盈一年持有期混合
场内简称	-
基金主代码	970043
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 27 日
报告期末基金份额总额	148,772,965.16 份
投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置，充分捕捉各子市场的绝对收益机会，力求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划将根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析，充分考虑大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性，形成前瞻性预测，以此确定股票、固定收益证券和现金等各类资产在给定区间内的动态配置，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。主要投资策略包括： 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货、国债期货、股票期权等投资策略；5、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划，其风险收益水平低于股

	票型基金和股票型集合计划，高于债券型基金、债券型集合计划、货币型基金和货币型集合计划。		
基金管理人	东吴证券股份有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
下属分级基金的场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	970043	970044	970045
下属分级基金的前端交易代码	-	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	84,855,721.41 份	32,376,381.50 份	31,540,862.25 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-	-

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）		
	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
1. 本期已实现收益	-4,722,689.65	-1,778,229.45	-1,812,037.14
2. 本期利润	-6,314,836.76	-2,370,814.66	-2,436,147.27
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0721	-0.0716	-0.0730
4. 期末基金资产净值	61,267,084.45	23,670,101.88	22,584,458.86
5. 期末基金份额净值	0.7220	0.7311	0.7160

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

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴裕盈 A 份额

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.93%	0.68%	-2.83%	0.50%	-6.10%	0.18%

过去六个月	-10.49%	0.69%	-5.14%	0.50%	-5.35%	0.19%
过去一年	-8.49%	0.72%	1.13%	0.51%	-9.62%	0.21%
自基金合同生效起至今	-27.80%	0.84%	-8.61%	0.68%	-19.19%	0.16%

## 东吴裕盈 B 份额

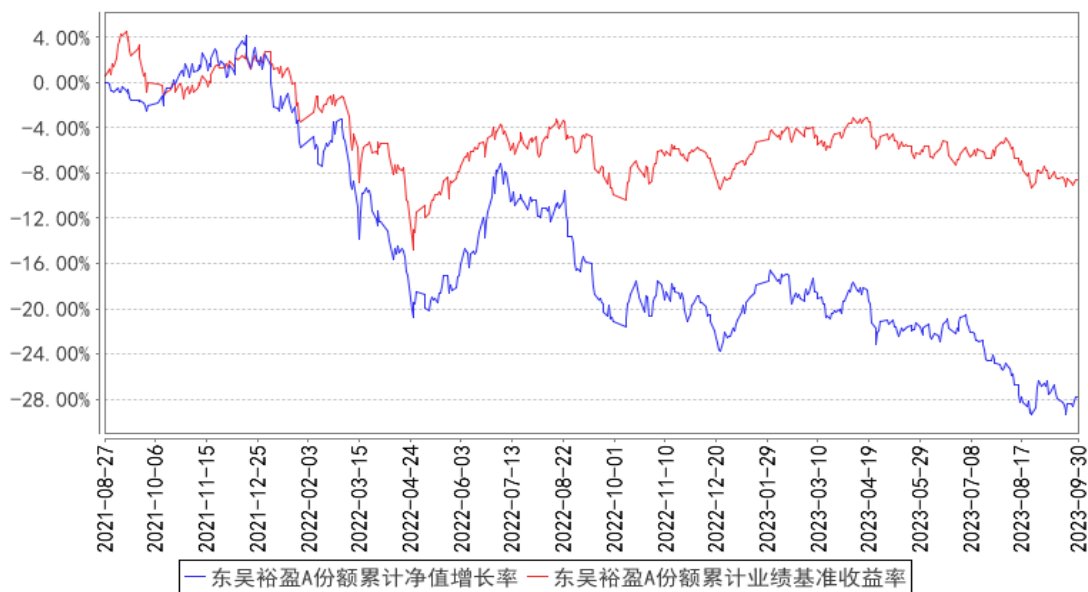
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.78%	0.68%	-2.83%	0.50%	-5.95%	0.18%
过去六个月	-10.22%	0.69%	-5.14%	0.50%	-5.08%	0.19%
过去一年	-7.95%	0.73%	1.13%	0.51%	-9.08%	0.22%
自基金合同生效起至今	-26.89%	0.84%	-8.61%	0.68%	-18.28%	0.16%

## 东吴裕盈 C 份额

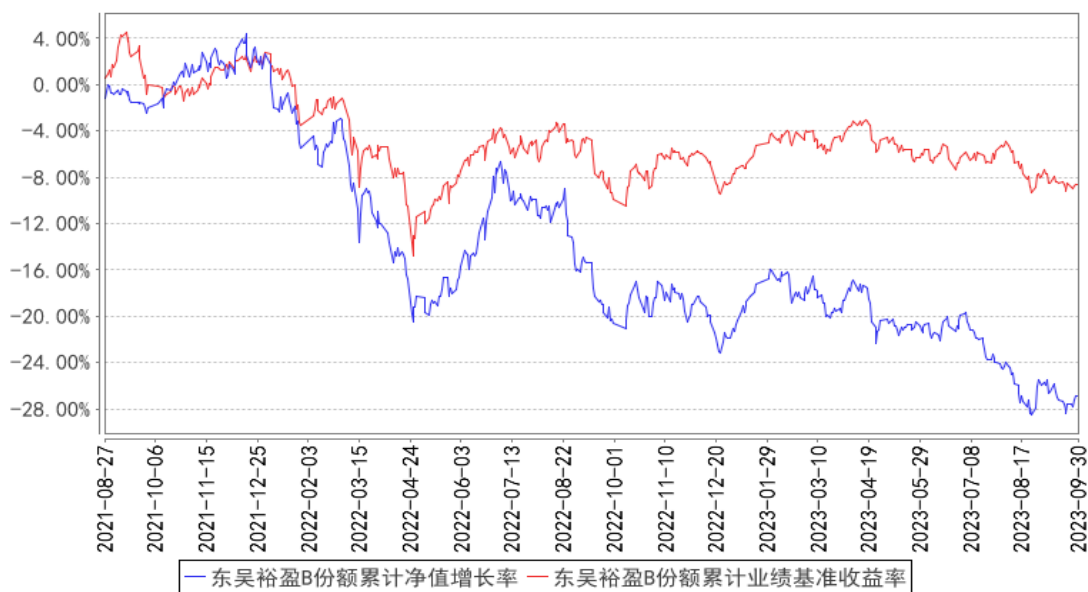
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.02%	0.68%	-2.83%	0.50%	-6.19%	0.18%
过去六个月	-10.68%	0.69%	-5.14%	0.50%	-5.54%	0.19%
过去一年	-8.87%	0.72%	1.13%	0.51%	-10.00%	0.21%
自基金合同生效起至今	-28.40%	0.84%	-8.61%	0.68%	-19.79%	0.16%

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

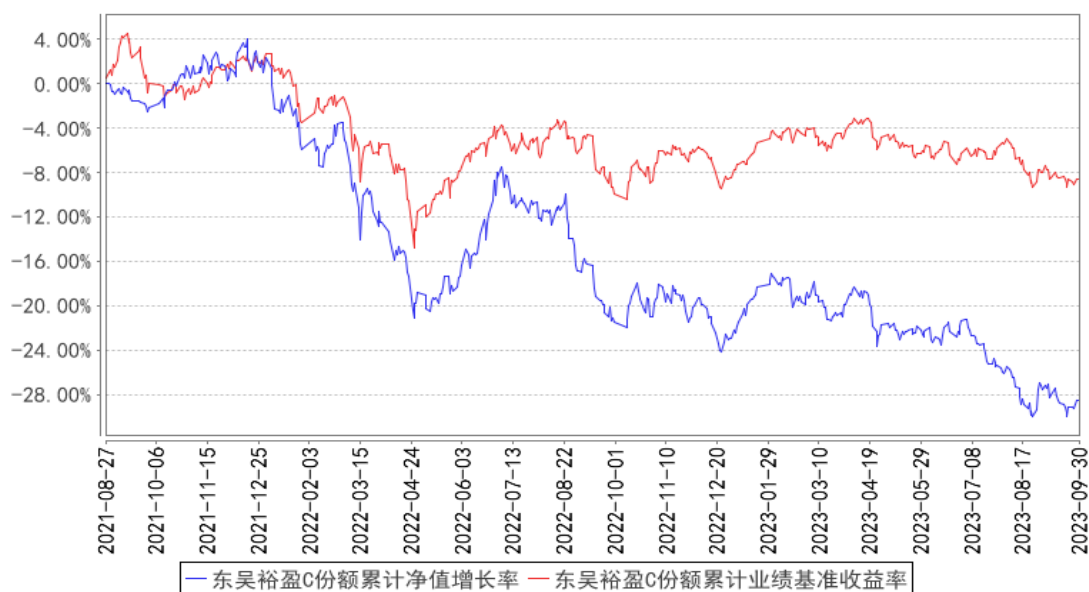
东吴裕盈A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴裕盈B份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴裕盈C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2023年7月1日-2023年9月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2023年9月30日）
-	-

注：无

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李果	投资经理	2021年8月27日	-	11年	李果，工学博士，11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。
刘欣瑜	投资经理	2023年7月13日	-	6年	刘欣瑜，复旦大学硕士。曾任职于上海期货信息技术有限公司、友山基金。2017年加入东吴证券股份有限公司，历任东吴证券股份有限公司资产管理总部权益研究员，现任投资经理。

注：（1）投资经理李果的任职日期是指公司公告本集合计划合同生效的日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

注：本报告期末，基金经理无兼任私募资管计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

整个三季度，A股市场呈震荡下行态势。一方面，美国经济基本面的坚韧程度超出市场预期，带来无风险利率的大幅上行；另一方面，价格下行叠加企业端去库存，三季度经济复苏较二季度进一步放缓。市场的风险偏好不断下行，北上资金持续大幅流出，市场进入存量博弈甚至减量博弈的负向反馈阶段。

市场结构也呈高度分化态势。整个季度，上证综指和沪深300指数分别下跌2.86%和3.98%，而中证500下跌5.13%，创业板指下跌9.53%，科创50指数下跌11.67%。整体而言，中大盘成长

股领跌全市场，大盘价值股和小盘题材股表现领先。具体的行业和板块分化也较为明显，非银金融、煤炭、石油石化和钢铁四个行业涨幅居前；而电力设备、传媒、计算机和通信四个行业跌幅均超过 10%。

客观地说，中大盘成长股大幅跑输市场，筹码结构问题首当其冲，以新能源为代表的赛道方向上有大量浮盈筹码，其不仅是机构持仓较为集中的方向，也是北上资金重仓持有的方向。北上资金的大量流出，此类品种首先成为了筹码博弈的牺牲品。其次，今年二季度以来经济基本面的改善程度大幅低于市场预期，且目前来看市场对远期预期能够带来的相应板块的成长弹性缺乏信心和耐心，习惯于“量增”逻辑的成长类资金自然选择避而远之。换言之，市场选择在偏价值型的板块中定价经济企稳，一定程度也折射出当前经济基本面缺乏弹性。而机构持仓极轻的小盘题材股则受益于流动性的外溢和部分成长类资金对远期或有成长性的追逐。

管理人在整个季度保持了中等偏高的仓位。相对二季度末，管理人对系统性下行的光储方向进行了减仓操作，主要的考量是相关方向因为筹码问题，中短期对资金吸引力下降。当然从基本面层面考量，我们依然觉得行业总量增速不错，所选个股依然具备阿尔法。另外，我们增加了半导体和消费电子的持仓，半导体板块的主要着眼点是国产化，而消费电子不仅有筹码结构的考量，也有行业周期的考量。最后，我们部分仓位配置了中特估方向上的运营商和部分红利品种。

操作上，我们值得反思的地方有：其一，我们看好红利方向上的品种，但配置的仓位不够重；其二，针对持有的火绿电品种，我们预判到了季度环比业绩改善减弱的趋势，但寄希望于三季度还有水电改善的逻辑而减仓太迟了。

经济基本面层面，年内中国经济经历了复苏和放缓的多次反复。7 月份以来，宏观政策调节力度不断加大，地方化债、地产因城施策放松、城中村改造等政策小步快走，甚至针对一线城市也祭出了“认房不认贷”的政策。8 月和 9 月的多项数据指标（包括 PPI, PMI 和社融数据），都显示国内经济基本面的内生性动能有望逐步修复，市场对经济底部企稳的感知度不断提升。

市场政策层面，7 月的政治局会议多年来首次提出“要活跃资本市场，提振投资者信心”，这是一个标志性的事件。随后，我们看到了“活跃资本市场”系列政策的陆续落地。降低印花税，提高减持的门槛，收紧 IPO 和再融资，加强量化资金监管，调整融券和转融通政策、汇金增持四大行股票等系列措施出台，一方面有利于切实提升上市公司质量和营造良好投资环境，另一方面也有利于持续引导长线资金入市，改善资本市场的微观流动性。

风险偏好层面，短期而言，我们看到了中美关系阶段性地缓和可能正在提升中，人民币汇率的外部扰动有望缓解。当然，近期中东的冲突对全球风险偏好构成扰动，美元指数继续上行，大宗商品原油和黄金飙升，进而对全球权益市场带来一定冲击。



总体而言，我们认为积极因素正不断累积。

目前看来，市场的底部特征比较明显。7 月底的政治局会议标志着“政策底”的出现。8-9 月的经济数据显示，国内经济层面在三季度也呈现逐月改善的迹象，经济底基本确认。市场层面，一定程度反映投资者情绪和市场活跃度的换手率数据显示成交量较为清淡；而主观上，近期依然惯性下滑的市场对利好“无动于衷”，对利空因素极其敏感，部分投资者已经“麻木”的现象也是市场情绪普遍悲观的真实反映。

客观地说，中国经济增速进一步下台阶已经被市场部分定价了。四季度潜在的风险可能来自海外通胀再次走高带来的无风险利率进一步上行，以及中美关系的不稳定性，特别是大选压力下，民主党可能会频繁利用“中国牌”，对中国部分产业的打压性贸易政策。

展望四季度，我们觉得四季度 A 股上行的风险略大于下行的风险。A 股估值和相对位置的性价比有望逐步体现在股价上。

我们会继续保持中高仓位。大盘价值股和中小盘成长股的“哑铃”组合将继续占据较大比例的持仓，组合的进攻性会提升，科技股方向会提升持仓比重。

其一，高质量发展中寻找中期基本面逻辑较顺的方向，特别是以华为产业链为代表的 TMT 板块，包括消费电子和半导体国产化等、经历过回调的人工智能板块、机器人板块、数字要素板块等；

其二，顺周期板块中具备供给约束且需求稳定的上游资源品值得关注。

其三，央国企做优做强（“中特估”），优选兼具分红比例高的品种。

其四，经历了两年多调整近期又遭遇反腐利空，筹码结构良好的医药生物板块。重点关注扎实做研发，管线梯队扎实，具备国家化能力的创新药械企业。另外，密切关注减肥药有由主题投资逐步转向基本面投资的可能性。

最后，在通胀粘性，加息接近尾声，边缘政治纷争又起的大背景下，贵金属可能是一个新增的不错的方向。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本集合计划 A 份额净值增长率为-8.93%，本集合计划 B 份额净值增长率为-8.78%，本集合计划 C 份额净值增长率为-9.02%，业绩比较基准收益率为-2.83%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	67,921,312.79	61.47
	其中：股票	67,921,312.79	61.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,232,876.77	2.02
	其中：债券	2,232,876.77	2.02
	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	27,728,536.81	25.10
	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	12,532,238.03	11.34
-	-	-	-
8	其他资产	78,138.90	0.07
9	合计	110,493,103.30	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,352,442.59	50.55
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	1,044,961.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,136,647.20	7.57
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	3,714,080.00	3.45
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	673,182.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	67,921,312.79	63.17

注：报告期末，本集合计划未持有港股通股票。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

注：本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688596	正帆科技	142,131	5,301,486.30	4.93
2	688208	道通科技	146,435	4,338,869.05	4.04
3	600019	宝钢股份	696,700	4,242,903.00	3.95
4	600050	中国联通	842,300	4,135,693.00	3.85
5	300416	苏试试验	222,400	3,714,080.00	3.45
6	002324	普利特	278,700	3,572,934.00	3.32
7	603986	兆易创新	31,600	3,115,760.00	2.90
8	688036	传音控股	20,719	3,019,587.06	2.81
9	600438	通威股份	83,400	2,690,484.00	2.50
10	601677	明泰铝业	168,300	2,197,998.00	2.04

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,232,876.77	2.08
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,232,876.77	2.08

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	20,520	2,232,876.77	2.08

注：本集合计划本报告期末仅持有 1 支债券。

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

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券投资。

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

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

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属资产。

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

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

注：本集合计划本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注：本集合计划本报告期末未持有股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。管理人将结合国债交

易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期内未进行国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票在本报告期内未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	78,138.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
-	-	-
7	其他	-
8	合计	78,138.90

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	2,232,876.77	2.08

注：无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	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。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
报告期期初基金份额总额	91,506,653.45	33,577,974.63	35,840,895.61
报告期期间基金总申购份额	22,490.70	-	26,775.81
减：报告期期间基金总赎回份额	6,673,422.74	1,201,593.13	4,326,809.17
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	84,855,721.41	32,376,381.50	31,540,862.25

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	东吴裕盈 A 份额	东吴裕盈 B 份额	东吴裕盈 C 份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	5,040,277.39	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	5,040,277.39	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	3.39	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

合计			-	-	
----	--	--	---	---	--

注：本报告期内，集合计划管理人未运用固有资金申购或赎回本集合计划。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

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

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，本资管计划的投资经理于 2023 年 7 月 13 日由李果调整为李果、刘欣瑜，相关事项已经管理人网站披露。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区源深北路 38 弄富源置地广场 3 幢 2 号。

### 9.3 查阅方式

1. 书面查阅：可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。
2. 网络查阅：管理人网站：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)。

东吴证券股份有限公司

2023 年 10 月 24 日