

# 东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资 基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 26 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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                         | 5         |
| 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                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>32</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 32        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 32        |
| 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       | 32        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 32        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 33        |
| 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      | 33        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 33        |
| 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 ..... | 33        |
| 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 .....    | 33        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 33        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 34        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>34</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 34        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 34        |
| 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 .....      | 34        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>35</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>35</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 35        |
| 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 .....      | 35        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 35        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 35        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 35        |
| 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 .....         | 35        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 36        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 36        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>37</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 .....    | 37        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 37        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>37</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 37        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 38        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 38        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 东吴瑞盈 63 个月定开债券          |
| 基金主代码      | 010719                  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                  |
| 基金合同生效日    | 2021 年 2 月 8 日          |
| 基金管理人      | 东吴基金管理有限公司              |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 4,720,169,520.27 份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                     |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下，采用持有到期策略，力争实现长期稳定的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略   | <p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1.25%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

### 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          |      | 东吴基金管理有限公司                | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘婷婷                       | 张姗                          |
|             | 联系电话 | 021-50509888-8308         | 400-61-95555                |
|             | 电子邮箱 | liutt@scfund.com.cn       | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 021-50509666/400-821-0588 | 400-61-95555                |
| 传真          |      | 021-50509888-8211         | 0755-83195201               |
| 注册地址        |      | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明         | 深圳市深南大道 7088 号招商银           |

|       |                         |                      |
|-------|-------------------------|----------------------|
|       | 大厦 9 楼 901、902 室        | 行大厦                  |
| 办公地址  | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 200120                  | 518040               |
| 法定代表人 | 李素明                     | 缪建民                  |

## 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 | www.scfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及托管人办公处      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                    |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 东吴基金管理有限公司 | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 |

## § 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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 87,374,715.96                         |
| 本期利润          | 87,374,715.96                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0185                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.83%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.85%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | 99,955,288.65                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0212                                |
| 期末基金资产净值      | 4,820,124,808.92                      |
| 期末基金份额净值      | 1.0212                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)                 |
| 基金份额累计净值增长率   | 17.23%                                |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

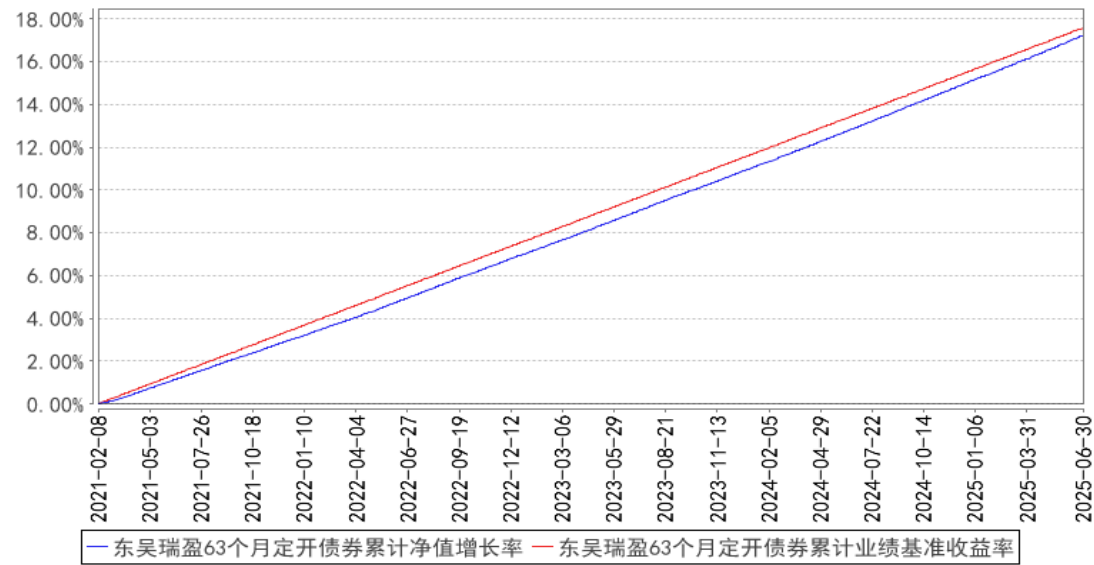
3.2 基金净值表现

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

| 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      | 0.32%    | 0.01%       | 0.33%      | 0.01%         | -0.01% | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.95%    | 0.01%       | 1.00%      | 0.01%         | -0.05% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.85%    | 0.01%       | 1.98%      | 0.01%         | -0.13% | 0.00% |
| 过去一年       | 3.77%    | 0.01%       | 4.00%      | 0.01%         | -0.23% | 0.00% |
| 过去三年       | 11.66%   | 0.01%       | 12.01%     | 0.01%         | -0.35% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.23%   | 0.01%       | 17.58%     | 0.01%         | -0.35% | 0.00% |

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

东吴瑞盈63个月定开债券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



§ 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

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[2004]32 号开业批文, 并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币, 公司所在地为上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 901、902 室。目前由东吴证券股份有限公司和海澜集团有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来, 始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化, 追求为投资者奉献

第 7 页 共 38 页

可持续的长期回报。近年来，在泛资管大背景下，公司推进公募基金、私募资产管理业务协同发展，涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线，可满足不同类型投资者的投资需求，进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

#### 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 王明欣 | 基金经理 | 2022 年 5 月 9 日  | —    | 7 年    | 王明欣女士，中国国籍，上海社会科学院经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。2017 年 7 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2021 年 7 月 12 日至 2023 年 11 月 6 日担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月 8 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2022 年 11 月 9 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                                       |
| 邵笛  | 基金经理 | 2022 年 12 月 2 日 | —    | 18 年   | 邵笛先生，中国国籍，上海财经大学工商管理硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职上海广大律师事务所；上海文筑建筑咨询公司；上海永一房产咨询有限公司。2006 年 9 月起加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日及 2022 年 12 月 2 日至 2025 年 1 月 21 日担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 2 日至 2020 年 7 月 7 日担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 2 日至 2021 年 7 月 28 日担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至 2023 年 7 月 27 日担任东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至 2024 年 4 月 10 日担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日及 2024 年 9 月 25 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2014 年 10 月 30 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 9 日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 6 日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 7 月 21 日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 9 月 25 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 9 月 25 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2025 年 6 月 17 日至今担任东吴中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和损害基金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

本基金管理人建立了严格的投资权限、研究管理、投资决策制度、投资备选库管理制度和集中交易制度，以保障各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会，并落实交易执行环节公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行交易指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，尽可能确保公平对待各投资组合，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对公司旗下所有投资组合及交易进行了相关分析，未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 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

根据统计局数据，今年上半年 GDP 同比增长 5.3%，高于全年 5% 目标。一季度实现经济“开门红”，GDP 同比增长 5.4%，二季度起，由于美国加征关税、地产走弱和消费下行影响，经济波动加大，GDP 同比增长 5.2%。新质生产力崛起，出口韧性显现，出口结构继续优化。受益于“以旧换新”政策推动，消费表现有企稳迹象。但也存在一定风险和挑战，例如房地产开发投资和销售面积同比仍然偏弱，外部关税影响仍有不确定性。宏观政策方面，财政前置发力，专项债、超长特别国债发行加速，货币政策方面，由审慎转向宽松，一季度暂停国债买入，强调“防资金空转”，二季度政策重心转向“稳增长”，加大流动性放松力度，五月一揽子宽松政策落地，货币政策与财政协同不断优化。上半年人民币汇率贬值压力缓解，兑美元汇率升值压力初显。

上半年利率债发行同比大幅增加，受外部因素和政策变化影响，债券收益率显著波动，大致可分三个阶段。年初至 3 月中旬，由于经济数据超预期，资金面收敛以及政策预期变化，债券收益率大幅上行。此后至 4 月底，美国加征关税引发市场避险情绪，债市快速修复。最后阶段，中美关税阶段性缓和，债市小幅调整后进入区间震荡。信用债方面，在配置盘推动下，信用利差持续收窄，科创债成为新的市场热点。上半年资金面由紧转松，央行通过降准、MLF、OMO、买断式逆回购及其他结构化工具为市场提供流动性支持，并持续规范操作方式，增强流动性预期管理。商业银行“负债荒”压力明显缓解，并跟随政策利率下调存款利率，存单利率自 3 月起趋势下行，银行间市场均衡宽松，资金利率保持在低位水平。

本基金在报告期内保持杠杆运作，根据市场变化以及对资金面的判断，合理安排融资结构，努力控制融资成本，致力防范流动性风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0212 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，关税不确定性仍在，出口压力或将增加，内需偏弱的问题仍待解决，预计经济增速可能较上半年温和回落。关税负面影响叠加“抢出口”透支效应和美国加征关税带来的全球

贸易收缩效应，预计出口可能转弱，对我国经济的影响或将由支撑转为拖累。由于房价下跌和出口压力加大会压制消费倾向，因此消费下行压力可能加大，以旧换新、服务消费等支持政策有待加码。投资方面，基础设施建设投资增速可能继续走高，从而可能抵消地产和制造业投资的不足。

预计下半年政策可能难以强刺激，或将更注重抓落实、做好增量政策储备，注重体制机制改革。财政政策力度上可能更接近“托而不举”，也将视基本面表现灵活调整。货币政策方面，保持宽松可能还是大方向，重点关注稳增长和就业方面。在基本面保持可控和资金面平稳宽松的条件下，债券市场可能保持区间震荡走势。同时也要关注财政政策超预期、股债跷跷板、供给侧改革等事件可能带来的影响。

#### 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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、督察长、分管固定收益总部和专户投资总部的公司副总经理、投研部门（包括但不限于权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、权益研究部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，公司总经理担任基金资产估值委员会主席，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理可参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 140,594.61             | 77,763.55                |
| 结算备付金    |         | -                      | -                        |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | -                      | -                        |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | -                      | -                        |
| 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    | -                              | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | 6,359,328,532.38               | 6,460,564,408.40                 |
| 其中：债券投资       |            | 6,359,328,532.38               | 6,460,564,408.40                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 6,359,469,126.99               | 6,460,642,171.95                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 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     |            | 1,538,388,987.59               | 1,726,816,719.21                 |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 593,311.21                     | 606,507.84                       |
| 应付托管费         |            | 197,770.39                     | 202,169.29                       |
| 应付销售服务费       |            | -                              | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | -                                |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.7    | 164,248.88                     | 266,682.65                       |
| 负债合计          |            | 1,539,344,318.07               | 1,727,892,078.99                 |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.8    | 4,720,169,520.27               | 4,720,169,520.27                 |
| 其他综合收益        |            | -                              | -                                |
| 未分配利润         | 6.4.7.9    | 99,955,288.65                  | 12,580,572.69                    |
| 净资产合计         |            | 4,820,124,808.92               | 4,732,750,092.96                 |
| 负债和净资产总计      |            | 6,359,469,126.99               | 6,460,642,171.95                 |

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,720,169,520.27 份，基金份额净值 1.0212 元。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                           | 附注号        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                |            | 107,297,591.50                           | 107,820,278.60                                |
| 1. 利息收入                       |            | 107,297,591.50                           | 107,820,278.60                                |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.10   | 364.10                                   | 1,044.05                                      |
| 债券利息收入                        |            | 107,262,123.98                           | 107,819,234.55                                |
| 资产支持证券利息收入                    |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入                    |            | 35,103.42                                | -                                             |
| 其他利息收入                        |            | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）             |            | -                                        | -                                             |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.11   | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                        |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.12   | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资                      | 6.4.7.13   | -                                        | -                                             |
| 收益                            |            | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益                       |            | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                          | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益 |            | -                                        | -                                             |
| 其他投资收益                        |            | -                                        | -                                             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）    | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）        |            | -                                        | -                                             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）        | 6.4.7.17   | -                                        | -                                             |
| <b>减：二、营业总支出</b>              |            | 19,922,875.54                            | 21,223,890.07                                 |
| 1. 管理人报酬                      | 6.4.10.2.1 | 3,552,245.52                             | 3,564,904.94                                  |
| 其中：暂估管理人报酬                    |            | -                                        | -                                             |
| 2. 托管费                        | 6.4.10.2.2 | 1,184,081.78                             | 1,188,301.64                                  |
| 3. 销售服务费                      | 6.4.10.2.3 | -                                        | -                                             |
| 4. 投资顾问费                      |            | -                                        | -                                             |
| 5. 利息支出                       |            | 15,076,825.48                            | 16,360,714.39                                 |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出             |            | 15,076,825.48                            | 16,360,714.39                                 |
| 6. 信用减值损失                     | 6.4.7.18   | -                                        | -                                             |
| 7. 税金及附加                      |            | -                                        | -                                             |

|                     |             |                  |                  |
|---------------------|-------------|------------------|------------------|
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 19 | 109, 722. 76     | 109, 969. 10     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |             | 87, 374, 715. 96 | 86, 596, 388. 53 |
| 减：所得税费用             |             | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |             | 87, 374, 715. 96 | 86, 596, 388. 53 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -                | -                |
| 六、综合收益总额            |             | 87, 374, 715. 96 | 86, 596, 388. 53 |

6.3 净资产变动表

会计主体：东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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                           | 4, 720, 169, 520. 27                  | -      | 12, 580, 572. 69 | 4, 732, 750, 092. 96 |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -                | -                    |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -                | -                    |
| 其他                                  | -                                     | -      | -                | -                    |
| 二、本期期初净资产                           | 4, 720, 169, 520. 27                  | -      | 12, 580, 572. 69 | 4, 732, 750, 092. 96 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -                                     | -      | 87, 374, 715. 96 | 87, 374, 715. 96     |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 87, 374, 715. 96 | 87, 374, 715. 96     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -                                     | -      | -                | -                    |
| 其中：1. 基金申购款                         | -                                     | -      | -                | -                    |
| 2. 基金赎回款                            | -                                     | -      | -                | -                    |
| （三）、本期向基                            | -                                     | -      | -                | -                    |

|                                          |                                            |        |                |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）         |                                            |        |                |                  |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 4,720,169,520.27                           | -      | 99,955,288.65  | 4,820,124,808.92 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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                                | 4,720,169,520.27                           | -      | 25,728,523.15  | 4,745,898,043.42 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -              | -                |
| 其他                                       | -                                          | -      | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 4,720,169,520.27                           | -      | 25,728,523.15  | 4,745,898,043.42 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                          | -      | -7,807,001.78  | -7,807,001.78    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -      | 86,596,388.53  | 86,596,388.53    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -                                          | -      | -              | -                |
| 其中：1. 基金申购款                              | -                                          | -      | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                          | -      | -              | -                |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                          | -      | -94,403,390.31 | -94,403,390.31   |

|                  |                  |   |               |                  |
|------------------|------------------|---|---------------|------------------|
| 填列)              |                  |   |               |                  |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | -                | - | -             | -                |
| 四、本期期末净资产        | 4,720,169,520.27 | - | 17,921,521.37 | 4,738,091,041.64 |

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：

李素明  
基金管理人负责人

李素明  
主管会计工作负责人

骆银  
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）系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[2020]2831 号《关于准予东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 2 月 8 日正式生效。首次设立募集规模为 4,720,169,520.27 份基金份额。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为东吴基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债）、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）、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票，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基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1.25%。

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金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、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金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。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2. 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）及地方教育附加。

3. 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[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。

4. 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 货币资金

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 140,594.61             |

|                |            |
|----------------|------------|
| 等于：本金          | 140,588.53 |
| 加：应计利息         | 6.08       |
| 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             | 140,594.61 |

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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<br>2025 年 6 月 30 日 |               |               |        |                  |
|----|-------|------------------------|---------------|---------------|--------|------------------|
|    |       | 初始成本                   | 利息调整          | 应计利息          | 减：减值准备 | 账面价值             |
| 债券 | 交易所市场 | 80,000,000.00          | -21,506.91    | 722,586.30    | -      | 80,701,079.39    |
|    | 银行间市场 | 6,230,000,000.00       | -1,025,138.79 | 49,652,591.78 | -      | 6,278,627,452.99 |
|    | 小计    | 6,310,000,000.00       | -1,046,645.70 | 50,375,178.08 | -      | 6,359,328,532.38 |

|        |                  |               |               |   |                  |
|--------|------------------|---------------|---------------|---|------------------|
| 资产支持证券 | -                | -             | -             | - | -                |
| 其他     | -                | -             | -             | - | -                |
| 合计     | 6,310,000,000.00 | -1,046,645.70 | 50,375,178.08 | - | 6,359,328,532.38 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资减值准备计提。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 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      | 65,988.73              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 65,988.73              |
| 应付利息        | -                      |
| 应付信息披露费     | 59,507.37              |
| 应付审计费       | 29,752.78              |
| 应付账户维护费     | 9,000.00               |
| 合计          | 164,248.88             |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 4,720,169,520.27                      | 4,720,169,520.27 |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 本期末           | 4,720,169,520.27                      | 4,720,169,520.27 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | 12,580,572.69 | -     | 12,580,572.69 |
| 本期期初 | 12,580,572.69 | -     | 12,580,572.69 |

|                |               |   |               |
|----------------|---------------|---|---------------|
| 本期利润           | 87,374,715.96 | - | 87,374,715.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | - | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | - | -             |
| 基金赎回款          | -             | - | -             |
| 本期已分配利润        | -             | - | -             |
| 本期末            | 99,955,288.65 | - | 99,955,288.65 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |  |
|-----------|---------------------------------|--|
|           | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |  |
| 活期存款利息收入  | 364.10                          |  |
| 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 | -                               |  |
| 其他        | -                               |  |
| 合计        | 364.10                          |  |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 汇划费     | 1,862.61                              |
| 账户维护费   | 18,000.00                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 109,722.76                            |

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他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

本报告期基金关联方未发生变化。

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             |
|--------------------|---------------------|
| 东吴基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司         | 基金托管人、基金代销机构        |
| 东吴证券股份有限公司（“东吴证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构     |

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 3,552,245.52                          | 3,564,904.94                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 32.58                                 | 28.86                                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,552,212.94                          | 3,564,876.08                               |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,184,081.78                             | 1,188,301.64                                  |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

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

本基金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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30<br>日 |        | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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 |

|            |            |        |           |          |
|------------|------------|--------|-----------|----------|
| 招商银行股份有限公司 | 140,594.61 | 364.10 | 59,532.03 | 1,044.05 |
|------------|------------|--------|-----------|----------|

注：本基金的银行存款由托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

截止本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出证券款余额为人民币 1,538,388,987.59 元，是以如下债券作为质押：

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           |
|--------|----------|----------------|--------|------------|------------------|
| 160210 | 16 国开 10 | 2025 年 7 月 1 日 | 100.56 | 7,695,000  | 773,839,617.52   |
| 160418 | 16 农发 18 | 2025 年 7 月 1 日 | 100.80 | 7,483,000  | 754,304,753.45   |
| 160418 | 16 农发 18 | 2025 年 7 月 7 日 | 100.80 | 1,031,000  | 103,927,328.72   |
| 合计     |          |                |        | 16,209,000 | 1,632,071,699.69 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无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

本基金为债券型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债）、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）、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。

开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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。

本基金的货币资金均存放于信用良好的银行，因而与货币资金相关的信用风险不重大。另外，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；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | -                        |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 6,359,328,532.38       | 6,460,564,408.40         |
| 合计     | 6,359,328,532.38       | 6,460,564,408.40         |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》《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》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金

管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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

利率风险是指基金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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于固定收益品种，对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的投资风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内            | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计               |
|------------------------|------------------|-------|-------|-----|------------------|
| 资产                     |                  |       |       |     |                  |
| 货币资金                   | 140,594.61       | -     | -     | -   | 140,594.61       |
| 结算备付金                  | -                | -     | -     | -   | -                |
| 存出保证金                  | -                | -     | -     | -   | -                |
| 交易性金融资产                | -                | -     | -     | -   | -                |
| 衍生金融资产                 | -                | -     | -     | -   | -                |
| 买入返售金融资产               | -                | -     | -     | -   | -                |
| 债权投资                   | 6,359,328,532.38 | -     | -     | -   | 6,359,328,532.38 |
| 应收证券清算款                | -                | -     | -     | -   | -                |
| 应收股利                   | -                | -     | -     | -   | -                |
| 应收申购款                  | -                | -     | -     | -   | -                |
| 其他资产                   | -                | -     | -     | -   | -                |

|                          |                  |                  |       |             |                  |
|--------------------------|------------------|------------------|-------|-------------|------------------|
| 资产总计                     | 6,359,469,126.99 | -                | -     | -           | 6,359,469,126.99 |
| 负债                       |                  |                  |       |             |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 1,538,388,987.59 | -                | -     | -           | 1,538,388,987.59 |
| 应付清算款                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应付赎回款                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -     | 593,311.21  | 593,311.21       |
| 应付托管费                    | -                | -                | -     | 197,770.39  | 197,770.39       |
| 应付销售服务费                  | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应交税费                     | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应付利润                     | -                | -                | -     | -           | -                |
| 其他负债                     | -                | -                | -     | 164,248.88  | 164,248.88       |
| 负债总计                     | 1,538,388,987.59 | -                | -     | 955,330.48  | 1,539,344,318.07 |
| 利率敏感度缺口                  | 4,821,080,139.40 | -                | -     | -955,330.48 | 4,820,124,808.92 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内            | 1-5 年            | 5 年以上 | 不计息         | 合计               |
| 资产                       |                  |                  |       |             |                  |
| 货币资金                     | 77,763.55        | -                | -     | -           | 77,763.55        |
| 结算备付金                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 存出保证金                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 交易性金融资产                  | -                | -                | -     | -           | -                |
| 衍生金融资产                   | -                | -                | -     | -           | -                |
| 买入返售金融资产                 | -                | -                | -     | -           | -                |
| 债权投资                     | 181,218,035.53   | 6,279,346,372.87 | -     | -           | 6,460,564,408.40 |
| 应收清算款                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应收股利                     | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应收申购款                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 其他资产                     | -                | -                | -     | -           | -                |
| 资产总计                     | 181,295,799.08   | 6,279,346,372.87 | -     | -           | 6,460,642,171.95 |
| 负债                       |                  |                  |       |             |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 1,726,816,719.21 | -                | -     | -           | 1,726,816,719.21 |
| 应付清算款                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应付赎回款                    | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -     | 606,507.84  | 606,507.84       |
| 应付托管费                    | -                | -                | -     | 202,169.29  | 202,169.29       |
| 应付销售服务费                  | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应交税费                     | -                | -                | -     | -           | -                |
| 应付利润                     | -                | -                | -     | -           | -                |

|         |                   |                  |   |               |                  |
|---------|-------------------|------------------|---|---------------|------------------|
| 其他负债    | -                 | -                | - | 266,682.65    | 266,682.65       |
| 负债总计    | 1,726,816,719.21  | -                | - | 1,075,359.78  | 1,727,892,078.99 |
| 利率敏感度缺口 | -1,545,520,920.13 | 6,279,346,372.87 | - | -1,075,359.78 | 4,732,750,092.96 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有分类为交易性金融资产的债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债），债权投资利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金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。本基金主要投资于证券交易所或银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金未持有以公允价值计量的金融工具。

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

不适用。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

不适用。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。于本基金本报告期末，本基金持有的债权投资的账面价值为人民币 6,359,328,532.38 元，公允价值为人民币 6,451,548,178.08 元，属于第二层次。（上年度末：本基金持有的不以公允价值计量的金融

工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。于上年度末，本基金持有的债权投资的账面价值为人民币 6,460,564,408.40 元，公允价值为人民币 6,627,648,163.10 元，属于第二层次。)

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金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            | 6,359,328,532.38 | 100.00        |
|    | 其中：债券             | 6,359,328,532.38 | 100.00        |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 140,594.61       | 0.00          |
| 8  | 其他各项资产            | -                | -             |
| 9  | 合计                | 6,359,469,126.99 | 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**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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**

本基金本报告期内未买入股票。

#### 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

本基金本报告期内未卖出股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

#### 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      | 6,359,328,532.38 | 131.93       |
|    | 其中：政策性金融债 | 6,359,328,532.38 | 131.93       |
| 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        | 6,359,328,532.38 | 131.93       |

#### 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  | 160418 | 16 农发 18 | 31,700,000 | 3,195,437,750.14 | 66.29        |
| 2  | 160210 | 16 国开 10 | 23,200,000 | 2,333,083,707.15 | 48.40        |
| 3  | 210203 | 21 国开 03 | 4,500,000  | 454,600,242.36   | 9.43         |
| 4  | 200315 | 20 进出 15 | 1,800,000  | 184,258,924.90   | 3.82         |
| 5  | 018063 | 进出 2101  | 800,000    | 80,701,079.39    | 1.67         |

#### 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

本基金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

本基金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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券中“20 进出 15（证券代码：200315）、进出 2101（证券代码：018063）”的发行主体在报告编制日前一年内受到监管部门的处罚。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有股票。

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，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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>例 (%) | 持有份额      | 占总份额比例<br>(%) |
| 227          | 20,793,698.33 | 4,720,085,000.00 | 100.00         | 84,520.27 | 0.00          |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 2,352.85   | 0.0000       |

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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 2 月 8 日）基金份额总额 | 4,720,169,520.27 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 4,720,169,520.27 |
| 本报告期基金总申购份额                   | —                |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | —                |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | —                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 4,720,169,520.27 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其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 (%) |    |
| 长江证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准：公司根据合规风控能力、信息系统建设、产品管理规模等情况，合理选择证券交易模式，降低交易成本。公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准建立白名单，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施。

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 (%) |
| 长江证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

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  | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 年 4 季度报告提示性公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 2  | 东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告 | 公司网站、中证信息网站                       | 2025 年 1 月 22 日 |
| 3  | 东吴基金管理有限公司关于基金经理王明欣女士结束产假恢复履行职务的公告     | 上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站       | 2025 年 1 月 23 日 |
| 4  | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报             | 2025 年 3 月 31 日 |

|    |                                              |                                   |                 |
|----|----------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|
|    |                                              | 报、公司网站、中证信息网站                     |                 |
| 5  | 东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年年度报告           | 公司网站、中证信息网站                       | 2025 年 3 月 31 日 |
| 6  | 东吴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况            | 公司网站、中证信息网站                       | 2025 年 3 月 31 日 |
| 7  | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 8  | 东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告       | 公司网站、中证信息网站                       | 2025 年 4 月 22 日 |
| 9  | 东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站 | 2025 年 4 月 28 日 |
| 10 | 东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台部分业务服务的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站 | 2025 年 5 月 21 日 |
| 11 | 东吴基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站 | 2025 年 5 月 27 日 |
| 12 | 东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台部分业务服务的提示性公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站 | 2025 年 6 月 18 日 |

§ 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金在中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

## 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日