

# 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划 2024年第3季度报告

2024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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024年10月23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。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	东吴安鑫中短债
场内简称	-
基金主代码	970087
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 20 日
报告期末基金份额总额	55,263,240.95 份
投资目标	本集合计划在严格控制风险和谨慎控制组合净值波动率的前提下，重点投资中短债主题证券，追求集合计划的长期、持续增值，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划将通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、杠杆策略；4、国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%

风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其风险收益水平低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划，高于货币型基金和货币型集合计划。		
基金管理人	东吴证券股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
下属分级基金的场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	970087	970088	970089
下属分级基金的前端交易代码	-	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	32,923,499.37 份	100.00 份	22,339,641.58 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）		
	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
1. 本期已实现收益	254,214.38	0.89	166,090.97
2. 本期利润	131,120.51	0.50	78,405.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0038	0.0050	0.0031
4. 期末基金资产净值	35,320,266.97	107.64	23,793,872.08
5. 期末基金份额净值	1.0728	1.0764	1.0651

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

东吴安鑫中短债 A

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	0.36%	0.02%	0.56%	0.03%	-0.20%	-0.01%
过去六个月	1.08%	0.02%	1.43%	0.03%	-0.35%	-0.01%
过去一年	2.72%	0.02%	3.00%	0.03%	-0.28%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	7.28%	0.02%	7.64%	0.03%	-0.36%	-0.01%

## 东吴安鑫中短债 B

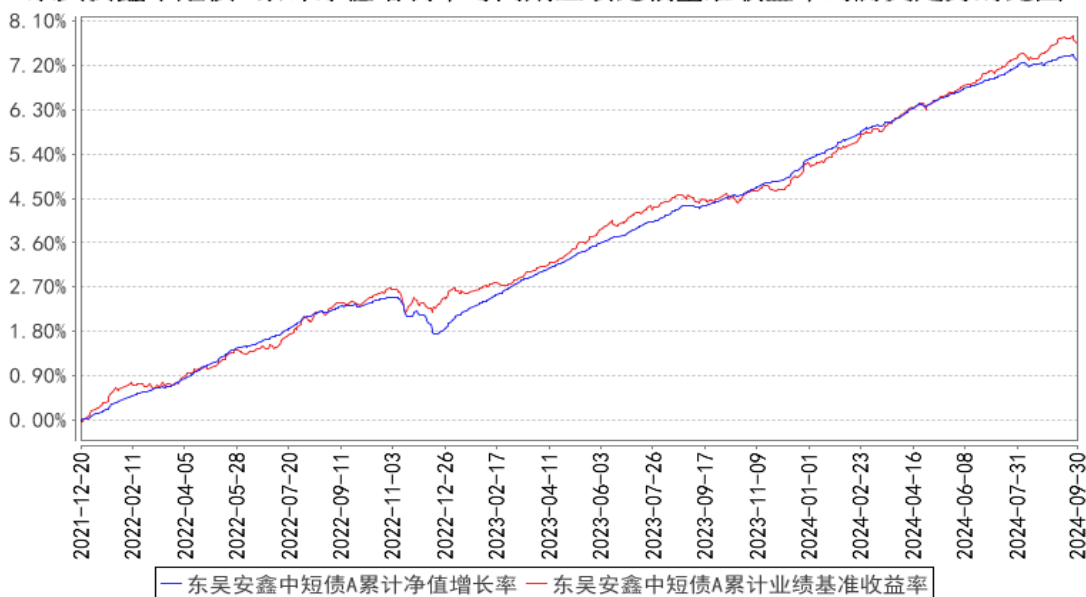
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.47%	0.02%	0.56%	0.03%	-0.09%	-0.01%
过去六个月	1.34%	0.02%	1.43%	0.03%	-0.09%	-0.01%
过去一年	3.17%	0.02%	3.00%	0.03%	0.17%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	7.64%	0.02%	7.64%	0.03%	0.00%	-0.01%

## 东吴安鑫中短债 C

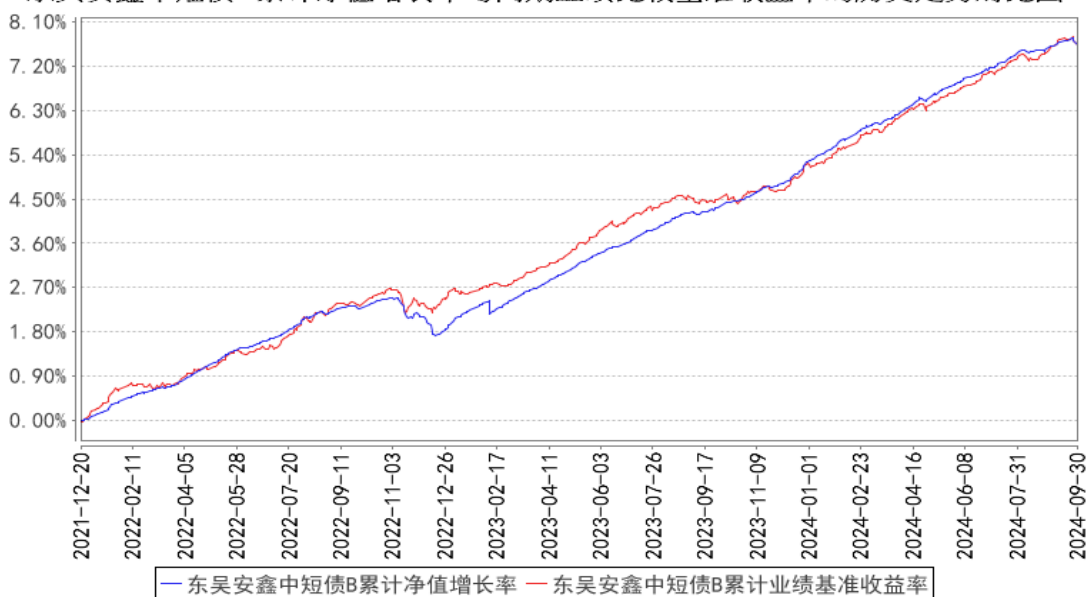
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.29%	0.02%	0.56%	0.03%	-0.27%	-0.01%
过去六个月	0.96%	0.02%	1.43%	0.03%	-0.47%	-0.01%
过去一年	2.45%	0.02%	3.00%	0.03%	-0.55%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	6.51%	0.02%	7.64%	0.03%	-1.13%	-0.01%

### 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

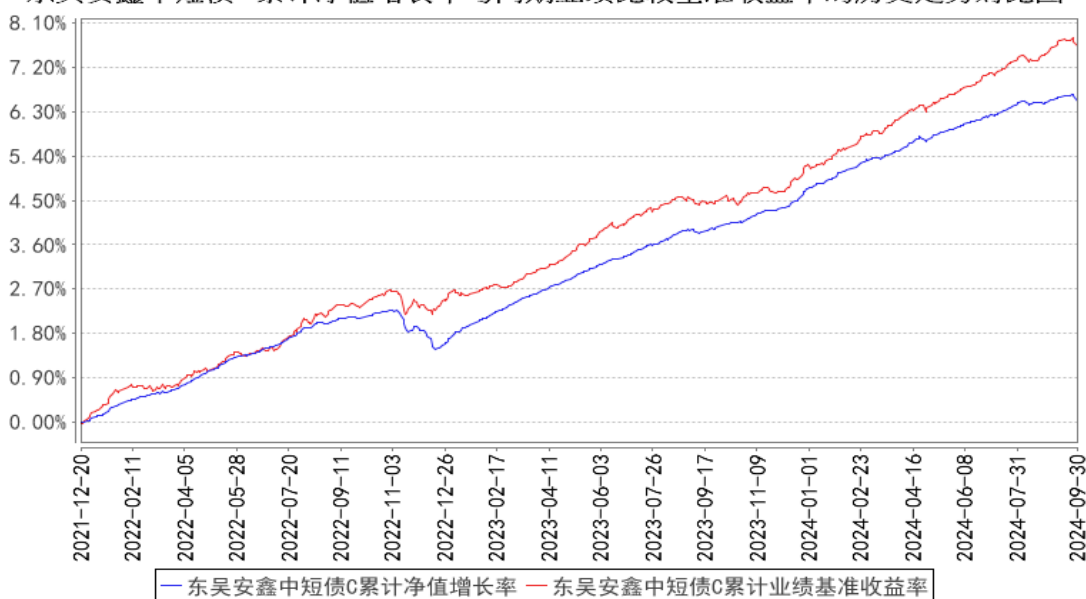
东吴安鑫中短债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴安鑫中短债B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴安鑫中短债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2024年7月1日-2024年9月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2024年9月30日）
-	-

## §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		
江逸舟	投资经理	2021年12月20日	-	2年	江逸舟，厦门大学经济学硕士，华中科技大学管理学学士，11年自营、资管资产管理经验。历任兴业信托投资业务总部投资经理、厦门银行资产管理部投资经理、张家港农商行资产管理部投资经理。2021年加入东吴证券资产管理总部，现任东吴证券资产管理总部投资经理。

注：（1）任职日期是指公司公告本集合计划合同生效的日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
-	公募基金	-	-	-

	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	-	-	-

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

三季度资金面先松后紧，利率债收益率曲线陡峭化下行。三季度，1年期国债收益率下行 17bp 至 1.37%，10年期国债收益率下行 5bp 至 2.15%，30年期国债收益率下行 7bp 至 2.36%。具体来看，7月至8月上旬，由于跨季后流动性投放和降息落地，资金面宽松，收益率加速下行。8月中旬，央行通过卖债等手段提示长债市场风险，收益率出现较大调整。8月下旬至9月下旬，经济数据走弱，叠加央行降准降息等超预期货币政策出台，收益率持续下行。9月底政治局会议后市场宽信用预期升温，收益率大幅上行。信用利差方面，7月信用利差持续压缩至极低位，8月起有所走扩，9月底因宽信用预期与流动性压力大幅走扩。

报告期内，组合配置中短久期信用债获取票息收益，同时积极参与全期限利率债交易，灵活调整组合久期，增厚组合收益。

#### 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 0.36%，本集合计划 B 份额净值增长率为 0.47%，本集合计划 C 份额净值增长率为 0.29%，业绩比较基准收益率为 0.56%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,154,861.67	93.44
	其中：债券	59,154,861.67	93.44
	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	900,055.97	1.42
	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	1,325,729.83	2.09
-	-	-	-
8	其他资产	1,926,570.85	3.04
9	合计	63,307,218.32	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-



I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有股票资产。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

注：报告期末，本集合计划未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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

注：报告期末，本集合计划未持有股票投资。

### 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	6,637,414.69	11.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,083,946.52	6.91
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	29,246,223.83	49.47
5	企业短期融资券	14,108,330.73	23.87
6	中期票据	5,078,945.90	8.59
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,154,861.67	100.07

## 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	012480907	24 悦达 SCP005	50,000	5,077,182.60	8.59
2	042480297	24 大丰海港 CP001	50,000	5,025,489.66	8.50
3	112999	19 河钢 01	45,000	4,667,131.23	7.90
4	138901	23 海国 02	40,000	4,112,893.15	6.96
5	2028017	20 农业银行永续债 01	40,000	4,083,946.52	6.91

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

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

注：报告期末，本集合计划未持有资产支持证券投资。

## 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：报告期末，本集合计划未持有贵金属投资。

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

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

注：报告期末，本集合计划未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 5.9.1 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。

## 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：报告期末，本集合计划未持有国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本集合计划未进行国债期货交易。

## 5.10 投资组合报告附注

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

本集合计划投资前十名证券的发行主体在本报告期内未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期末，本集合计划未持有股票资产。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,796.26
2	应收证券清算款	1,908,774.59
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	1,926,570.85

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

注：报告期末，本集合计划未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.10.5 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：报告期末，本集合计划前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 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	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
报告期期初基金份额总额	34,403,009.92	100.00	26,567,485.66
报告期期间基金总申购份额	2,566,987.94	-	5,017,170.45
减：报告期期间基金总赎回份额	4,046,498.49	-	9,245,014.53
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	32,923,499.37	100.00	22,339,641.58

## §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	东吴安鑫中短债 A	东吴安鑫中短债 B	东吴安鑫中短债 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	4,906,271.47	-	-
报告期期间买入/申购总份额	0.00	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,906,271.47	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	8.88	-	-

### 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		或者超过 20%的时间 区间					
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

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

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

## §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 2 号基金优选集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划招募说明书；
3. 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同；
4. 东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划托管协议；
5. 管理人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期期内披露的各项公告。

### 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

2024 年 10 月 23 日