

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 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 03 月 29 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。本年度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 2024 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	71

8.1 期末基金资产组合情况	71
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	71
8.3 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	72
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
8.6 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	77
8.7 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	77
8.8 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	77
8.9 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	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.14 投资组合报告附注	78
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.3 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	80
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	80
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议	81
11.2 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	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8 其他重大事件	83
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1 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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 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	142,452,799.10 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	80,708,508.44 份	31,812,673.54 份	29,931,617.12 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dwzq.com.cn/
基金年度报告备置地点	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
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
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
-	-	-

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年			2022 年			2021 年 8 月 27 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日		
	东吴裕 盈 A 份 额	东吴裕 盈 B 份 额	东吴裕 盈 C 份 额	东吴裕 盈 A 份 额	东吴裕 盈 B 份 额	东吴裕 盈 C 份 额	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	- 4,312, 156.06	- 1,620, 047.33	- 1,652, 702.25	- 32,418 ,839.6 5	- 8,745, 434.95	- 15,220 ,999.9 0	5,044, 811.83	1,595, 296.65	2,268, 394.33
本期利润	- 5,334, 762.68	- 2,072, 624.88	- 1,980, 921.67	- 32,655 ,663.3 8	- 8,591, 535.29	- 15,479 ,288.0 7	4,138, 885.60	1,307, 320.10	1,939, 693.64
加权平均基金份额本期利润	- 0.0573	- 0.0623	- 0.0542	- 0.2526	- 0.2447	- 0.2566	0.0346	0.0366	0.0348
本期加权平均净值利润率	-7.48%	-8.08%	-7.12%	- 29.17%	- 28.18%	- 29.69%	3.43%	3.53%	3.42%
本期基金份额净值增长率	-8.59%	-8.03%	-8.96%	- 24.32%	- 23.87%	- 24.62%	2.46%	2.66%	2.32%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
期末可供分配利润	- 23,505 ,420.9 6	- 8,947, 033.28	- 8,914, 088.74	- 24,818 ,015.9 5	- 7,470, 622.59	- 10,928 ,186.6 8	3,298, 341.72	953,32 7.66	1,474, 636.16
期末可供分配基金份额利润	- 0.2912	- 0.2812	- 0.2978	- 0.2246	- 0.2184	- 0.2287	0.0246	0.0266	0.0232
期末基金资产净值	57,203 ,087.4 8	22,865 ,640.2 6	21,017 ,528.3 8	85,680 ,999.2 3	26,739 ,958.4 5	36,854 ,904.6 3	137,60 7,883. 39	36,789 ,117.4 6	64,962 ,244.3 4
期末基金份额净值	0.7088	0.7188	0.7022	0.7754	0.7816	0.7713	1.0246	1.0266	1.0232
3.1.3 累计期末指标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
基金份额累计净值增长率	- 29.12%	- 28.12%	- 29.78%	- 22.46%	- 21.84%	- 22.87%	2.46%	2.66%	2.32%

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
过去三个月	-1.83%	0.79%	-2.18%	0.51%	0.35%	0.28%
过去六个月	-10.60%	0.73%	-4.87%	0.51%	-5.73%	0.22%
过去一年	-8.59%	0.71%	-2.58%	0.49%	-6.01%	0.22%
自基金合同生效起至今	-29.12%	0.83%	-10.19%	0.66%	-18.93%	0.17%

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
过去三个月	-1.68%	0.79%	-2.18%	0.51%	0.50%	0.28%
过去六个月	-10.32%	0.73%	-4.87%	0.51%	-5.45%	0.22%
过去一年	-8.03%	0.71%	-2.58%	0.49%	-5.45%	0.22%
自基金合同生效起至今	-28.12%	0.83%	-10.19%	0.66%	-17.93%	0.17%

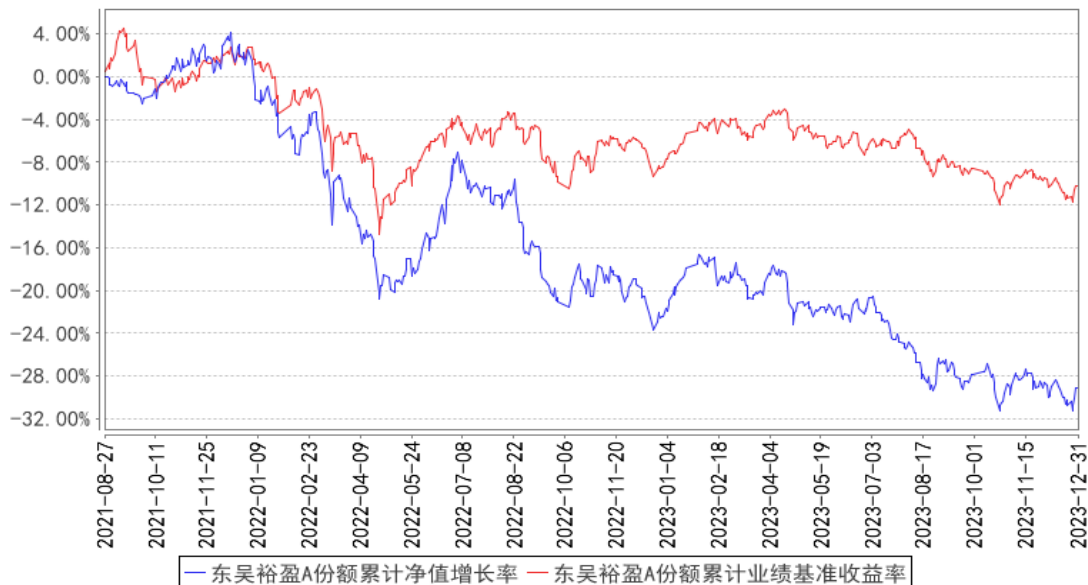
东吴裕盈 C 份额

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
过去三个月	-1.93%	0.79%	-2.18%	0.51%	0.25%	0.28%
过去六个月	-10.78%	0.73%	-4.87%	0.51%	-5.91%	0.22%
过去一年	-8.96%	0.71%	-2.58%	0.49%	-6.38%	0.22%
自基金合同生效起至今	-29.78%	0.83%	-10.19%	0.66%	-19.59%	0.17%

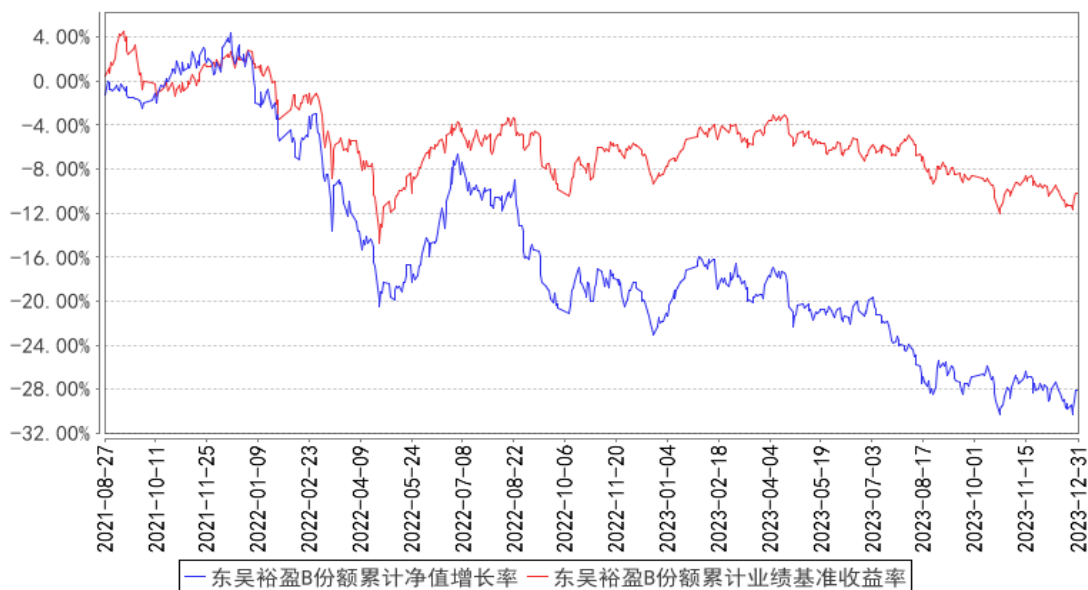
起至今					19.59%	
-----	--	--	--	--	--------	--

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

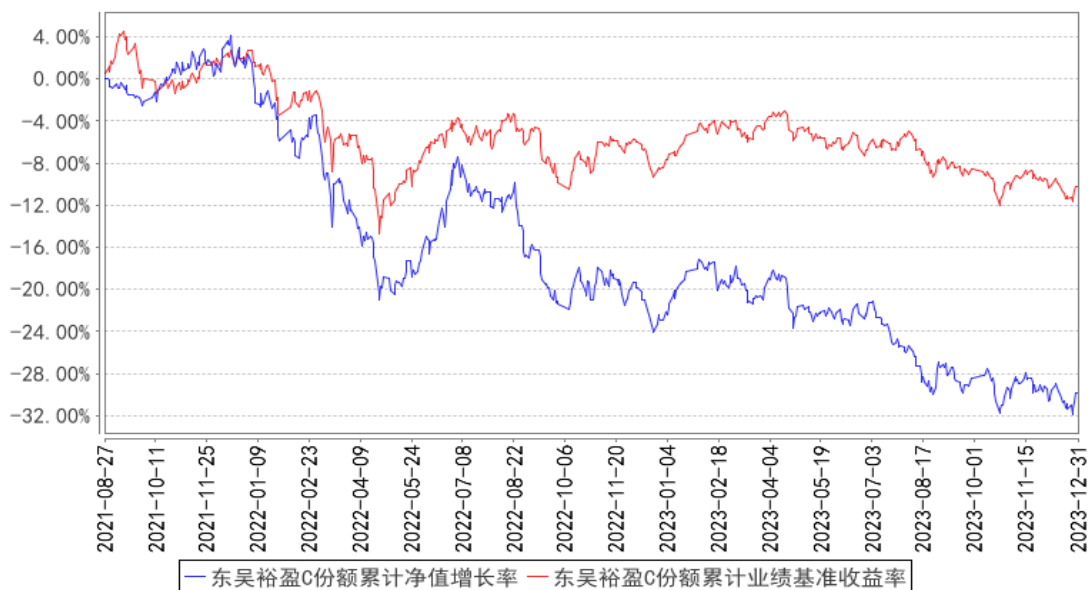
东吴裕盈A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

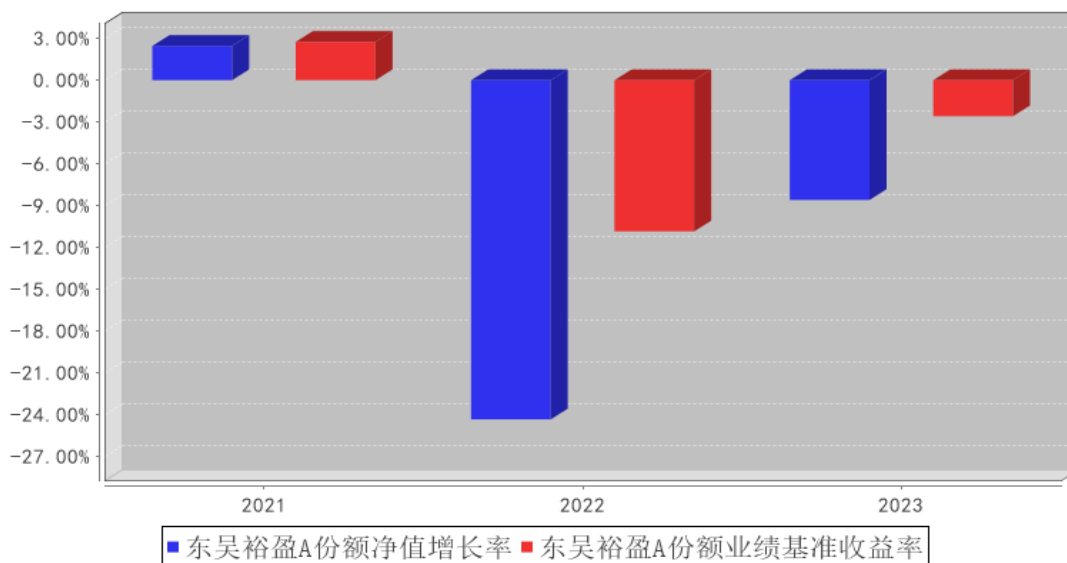


东吴裕盈C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

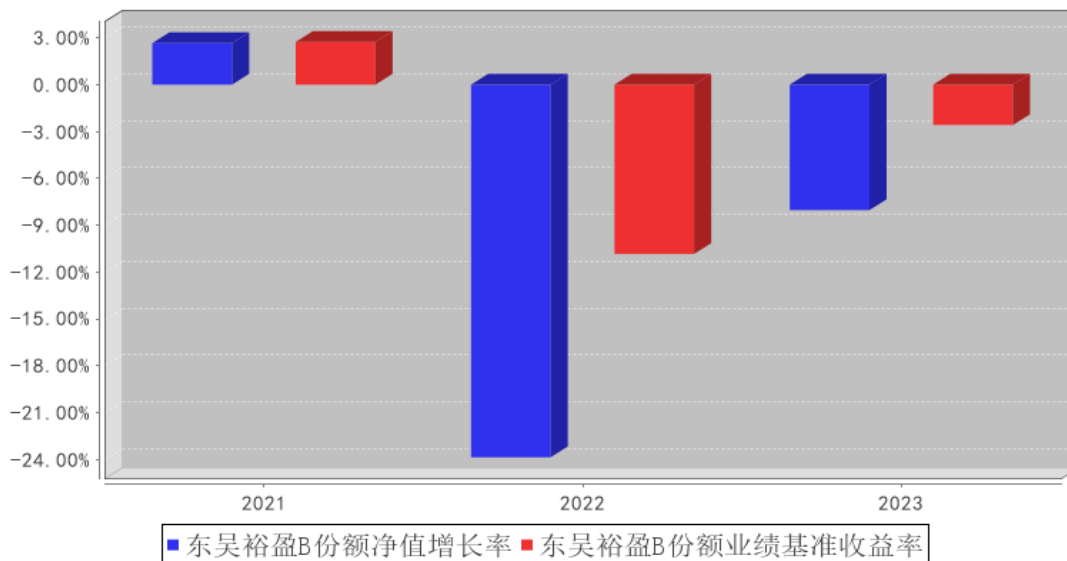


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

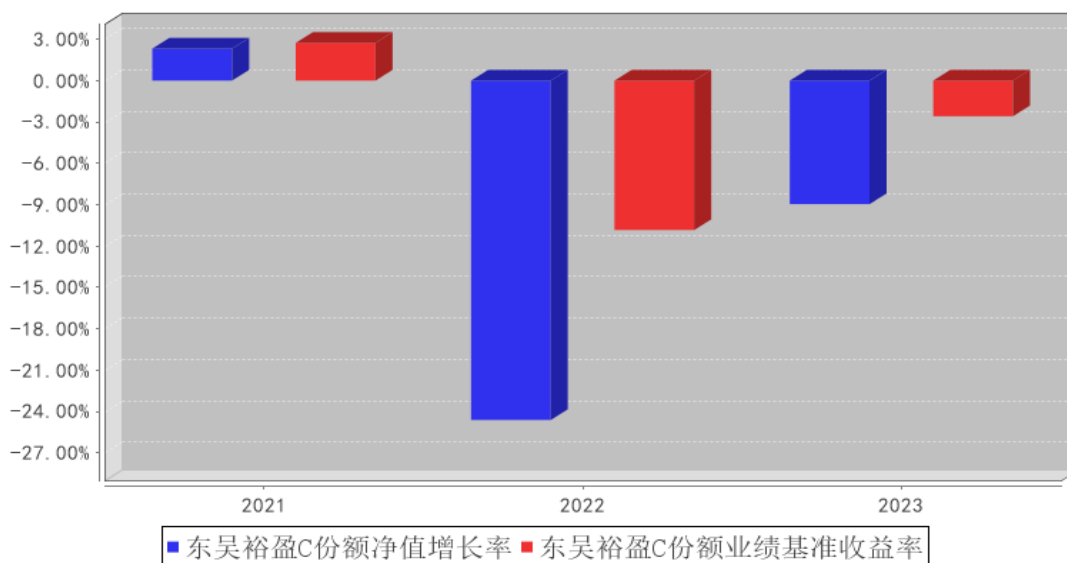
东吴裕盈A份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东吴裕盈B份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东吴裕盈C份额基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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12月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2023年12月31日）
-	-

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东吴裕盈 A 份额

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

东吴裕盈 B 份额

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

东吴裕盈 C 份额

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：无。

§ 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	-	12年	李果，工学博士，12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）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。

4.1.3 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：（1）“任职时间”为同时兼任多种类型产品的基金经理/投资经理在东吴证券股份有限公司首次开始管理本类产品的时间。

（2）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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

管理人对于基金经理主要考核投资业绩，绩效系数和基金经理 KPI 考核挂钩，薪酬激励与绩效系数及管理产品的业绩挂钩，以自然年度设定考评期限，定期检视。除此之外，对于投资过程中可能产生各类合规风险、客户投诉事件，将根据不同的情况予以不同程度奖金扣减。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人依据《证券法》、《证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、规范制定了《东吴证券股份有限公司资产管理总部公平交易管理办法》。管理人严格设置了相关流程，在一级、二级市场投资管理活动的授权、研究分析、投资决策、交易执行等环节建立公平交易的规则、监控、报告披露机制。通过具体的工作程序、技术手段确保公平交易的实现，并于事后进行必要的稽核和分析，以确保对过程和结果的控制。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

4.3.3 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

经过 3 年疫情的封控以及 2022 年 A 股市场的低迷，2023 年初市场对中国权益市场有了美好的期待，并体现在一季度大部分时间指数和部分行业的涨幅上。然而，疫情后强修复的预期被证伪，国内消费动能不足，地产基建投资大幅下行，外部去全球化的大环境下，出口乏力。与此同时，美债利率向上，中美利差倒挂且阶段性走阔，人民币汇率承压，外资在年初大幅流入的基础上大幅流出。最终结果和预期相比，存在较大的反差：一致预期不断下修，市场在行业轮动加剧和整体下跌中切换。另一项反差是，年初大家普遍觉得有风险的海外市场，特别是发达市场大幅跑赢。A 股在新兴市场中走势垫底，继 2022 年之后连续第二年迎来戴维斯双杀。

指数的乏力表现并不能掩盖 A 股市场的结构性机会。存量甚至减量博弈下，市场积极拥抱以 TMT 和智能驾驶为代表的科技成长板块，和以煤炭、公共事业为代表的红利低波板块，而以新能源为代表的赛道方向和地产链方向表现在所有行业方向上垫底。除了基本面的因素外，筹码结构也是重要原因。机构重仓或者超配的方向大都遭遇了市场的摒弃。筹码结构成为重要决策依据的另

一表现是，微盘股指数大幅跑赢市场，其成分股均属于机构轻仓或者无持仓的品种。

管理人在全年保持了中等偏高的仓位，并在年中做了一定的仓位调整。全年的收益优于沪深 300 指数，但离绝对收益依然有一定距离。

2023 年的市场，操作和策略层面有不少地方值得我们反思。其中最为重要的一条，我们觉得是在策略层面，历史规律可以参考，但一定要厘清背后的逻辑。2023 年我们之前用得不错的估值分位，股债性价比分位，风险溢价模型等纷纷失效。我们反思，均值回归的思想也要充分考虑市场范式发生改变的大趋势。在增长中枢下移的背景下，曾经的规律需要参考当前的政策反馈机制，地缘政治环境，房地产周期，人口周期等做一定程度的修正。

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-8.59%，本集合计划 B 份额净值增长率为-8.03%，本集合计划 C 份额净值增长率为-8.96%，业绩比较基准收益率为-2.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面层面，2023 年三季度经济景气度有所回升，但节奏不连贯。我们判断中央财政将加码，“三大工程”将助力降低地产投资的拖累，经济将保持温和复苏态势。

流动性层面，2024 年有望迎来美国降息，市场流动性迎来拐点。预期美债利率下行幅度温和。国内方面，货币宽松的主基调不变，发债和汇率对流动性的压制因素或将缓解，国内资金利率中枢有望下行。但中美利差将高位震荡。外资流出的速度有望较 2023 年下半年缓解。

市场情绪上，当前情绪降至低位，股债风险溢价显示权益市场具备中期性价比，因此基于估值，我们战略性看多市场，市场的估值中枢有望抬升。但市场向上的弹性取决于宏观波动。风格上，哑铃型结构有望延续，即小盘成长和大盘红利品种将继续保持强势，风格的切换需要宏观要素的驱动。

行业配置上，我们将关注：

1、科技成长方向，关注重点细分方向是人工智能、消费电子（包括 MR）、华为产业链、智能驾驶、人形机器人、卫星互联网；

2、从逆境反转（赔率）角度选择医药生物、军工；

3、如果中美利差阶段性走阔，选择防御性的红利资产，关注现金流稳定、股息高的煤炭和公用事业；

4、若稳增长落地超预期，“哑铃型”结构有望转向市场风格再平衡，阶段性看多顺周期，包括消费、小金属和汽车。

市场主要的风险来自于地缘政治扰动加剧、稳增长政策低于预期（房地产市场进一步调整）

和美联储政策利率维持高位。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本集合计划的监察稽核工作主要由资产管理总部合规与法律事务部、风控部以及公司合规法务部、风险管理部、稽核审计部负责，其中，公司合规法务部负责对本集合计划涉及的所有业务环节的合法性、合规性、合理性、有效性进行控制、检查、评价、建议和报告；稽核审计部负责对本集合计划涉及的经营活动的合规性、内部控制的有效性、财务信息的可靠性进行常规稽核和专项稽核，并负责对关键岗位人员的任期届满、工作调动或离职进行稽核。

管理人从合法合规运作、切实维护投资者合法权益的角度出发，持续推进全面风险管理理念，加强事前、事中、事后的风险管理。管理人通过及时检查和评价公司公募资产管理业务内部控制制度的合法性、合规性、合理性、完备性和有效性，从而不断完善公司公募资产管理业务内部控制机制；关注销售业务所涉及的合法性、合规性、有效性、合理性，包括但不限于反洗钱、销售适当性、客户身份识别、客户投诉与处理等情况，重点关注本集合计划销售是否遵守法律法规、集合计划合同和招募说明的规定，是否存在误导、欺诈投资者和不正当竞争等违法违规行为；关注投研业务、营运业务及信息技术信托运行情况，关注本集合计划投资是否符合法律法规和集合计划合同的规定，是否遵守公司制定的投资业务流程等相关制度，是否存在内幕交易、操作市场等违法行为以及不正当关联交易、利益输送和不公平对待不同投资者的行为，关注本集合计划运营环境是否安全，信息技术系统运行是否稳定，是否出现延时交易、数据遗失等情况。管理人的监察稽核工作始终遵循独立、客观、公正、全面等原则，并不断强化员工合规和风险意识，从而推动公司的合规文化和内部风险控制机制逐步完善与优化，维护集合计划投资者的合法权益。

4.7 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。

管理人组织合规法务、风控、核算、投资监督等岗位形成专门职能，对集合计划的估值标准和业务执行等进行检视和保障，以加强核算程序、结果数据的可靠性、完整性和及时性。必要时管理人同时就具体事项征询外部会计师事务所的专业意见。

集合计划日常账务处理、净值计算由集合计划管理人独立完成，托管人对账户和计算结果进行复核。管理人于交易日终取得完整业务数据等并审核无误后，经由核算系统生成的估值结果经电子化专门渠道发送至托管人，净值经托管人复核无误后签名返回，后由管理人完成披露。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本集合计划未被出具非标准意见审计报告。

4.10 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 年度，本集合计划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份额持有人利益的行为。

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、份额申购赎回价格的计算、费用开支等问题上，托管人未发现损害份额持有人利益的行为。

本报告期内本计划未进行收益分配，符合集合计划合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2023 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70027437_B02 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划全

	体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了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财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的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财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>东吴证券股份有限公司负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，东吴证券股份有限公司负责评估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持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起</p>

	<p>来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与东吴证券股份有限公司就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈 露 莫艾琦
会计师事务所的地址	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
审计报告日期	2024 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	5,410,656.83	10,324,846.50
结算备付金		1,982,203.50	2,825,532.95
存出保证金		86,704.58	133,991.83
交易性金融资产	7.4.7.2	69,210,448.52	104,659,271.19
其中：股票投资		69,210,448.52	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	14,697,363.41	-8,097.53
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		10,886,854.59	36,016,195.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		102,274,231.43	153,951,740.01
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		126,778.65	1,488,740.08
应付赎回款		313,799.43	127,799.25
应付管理人报酬		40,038.62	64,571.90
应付托管费		17,230.36	26,146.99
应付销售服务费		7,144.39	12,948.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	68.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	682,983.52	2,955,602.10
负债合计		1,187,975.31	4,675,877.70
净资产：			

实收基金	7.4.7.10	142,452,799.10	192,492,687.53
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-41,366,542.98	-43,216,825.22
净资产合计		101,086,256.12	149,275,862.31
负债和净资产总计		102,274,231.43	153,951,740.01

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 142,452,799.10 份，其中下属 A 类集合计划份额总额为 80,708,508.44 份，集合计划份额净值人民币 0.7088 元；其中下属 B 类集合计划份额总额为 31,812,673.54 份，集合计划份额净值人民币 0.7188 元；其中下属 C 类集合计划份额总额为 29,931,617.12 份，集合计划份额净值人民币 0.7022 元。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-8,270,531.91	-54,925,067.51
1. 利息收入		740,783.70	1,082,545.36
其中：存款利息收入	7.4.7.13	155,137.71	284,602.54
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		585,645.99	797,942.82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,224,174.61	-55,683,309.80
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-7,029,587.49	-57,089,522.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-959,237.45	-516,276.74
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	764,650.33	1,922,489.10
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)	7.4.7.20	-1,803,403.59	-341,212.24
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	16,262.59	16,909.17
减：二、营业总支出		1,117,777.32	1,801,419.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	597,772.62	986,710.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	250,677.79	389,935.49
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	112,010.88	209,111.82
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		15,586.36	43.57
8. 其他费用	7.4.7.23	141,729.67	215,617.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-9,388,309.23	-56,726,486.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-9,388,309.23	-56,726,486.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,388,309.23	-56,726,486.74

7.3 净资产变动表

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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	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	192,492,687.53	-	-43,216,825.22	149,275,862.31

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-50,039,888.43	-	1,850,282.24	-48,189,606.19
(一)、综合收益总额	-	-	-9,388,309.23	-9,388,309.23
(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)	-50,039,888.43	-	11,238,591.47	-38,801,296.96
其中：1. 基金申购款	262,517.88	-	-67,152.63	195,365.25
2. 基金赎回款	-50,302,406.31	-	11,305,744.10	-38,996,662.21
(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	142,452,799.10	-	-41,366,542.98	101,086,256.12
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	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	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)	-41,140,252.12	-	-48,943,130.76	-90,083,382.88
(一)、综合收益总额	-	-	-56,726,486.74	-56,726,486.74

(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)	-41,140,252.12	-	7,783,355.98	-33,356,896.14
其中：1. 基金申购款	1,928,264.32	-	-204,881.55	1,723,382.77
2. 基金赎回款	-43,068,516.44	-	7,988,237.53	-35,080,278.91
(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	192,492,687.53	-	-43,216,825.22	149,275,862.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

高海明

姚眺

程孜渊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

1. 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

2. 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显

著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

1. 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2. 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

3. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

4. 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2. 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

3. 债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

4. 处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

5. 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

6. 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

7. 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

8. 公允价值变动收益系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

9. 其他收入在履行了集合计划合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本集合计划接受相关服务的期间计入当期损益。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；
2. 本集合计划收益分配方式仅现金分红一种；
3. 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
4. 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；
5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

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

1. 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
2. 本集合计划的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
3. 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于集合计划增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于集合计划增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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，本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以本集合计划的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，集合计划管理人运营集合计划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。对集合计划在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，已纳税额从集合计划管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

2. 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。

3. 个人所得税

对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

4. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	5,410,656.83	10,324,846.50
等于：本金	5,409,341.19	10,315,433.89
加：应计利息	1,315.64	9,412.61
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	5,410,656.83	10,324,846.50

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	70,348,445.42	-	69,210,448.52	-1,137,996.90	
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	70,348,445.42	-	69,210,448.52	-1,137,996.90	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	94,126,207.90	-	95,794,234.00	1,668,026.10	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,854,368.25	13,288.35	8,865,037.19	-1,002,619.41
	银行间市场	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
	合计	9,854,368.25	13,288.35	8,865,037.19	-1,002,619.41
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	103,980,576.15	13,288.35	104,659,271.19	665,406.69	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		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	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		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：报告期末及上年度末，本集合计划未持有衍生工具。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,697,363.41	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	14,697,363.41	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-8,097.53	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-8,097.53	-

7.4.7.4.2 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 12 月 31 日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-
项目	上年度末						

	2022 年 12 月 31 日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 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	整个存续期预期	整个存续期预期	

	期信用损失	信用损失(未发生信用减值)	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	-	-	-	-

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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		-	-	-	-	-	-
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 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：报告期末及上年度末，本集合计划未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 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	-	-	-	-

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-

合计	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 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 12 月 31 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	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-	-

注：报告期末及上年度末，本集合计划未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
-	-	-
合计	-	-

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	192.07
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	637,983.52	2,754,410.03
其中：交易所市场	637,983.52	2,754,410.03
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	45,000.00	201,000.00
合计	682,983.52	2,955,602.10

7.4.7.10 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12月31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	84,348.06	84,348.06
本期赎回（以“-”号填列）	-29,874,854.80	-29,874,854.80
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	80,708,508.44	80,708,508.44

东吴裕盈 B 份额

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31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）	-2,397,907.50	-2,397,907.50
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	31,812,673.54	31,812,673.54

东吴裕盈 C 份额

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	178,169.82	178,169.82
本期赎回(以“-”号填列)	-18,029,644.01	-18,029,644.01
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	29,931,617.12	29,931,617.12

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 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	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-23,261,633.07	-1,556,382.88	-24,818,015.95
本期利润	-4,312,156.06	-1,022,606.62	-5,334,762.68
本期基金份额交易产生的变动数	6,244,539.01	402,818.66	6,647,357.67
其中：基金申购款	-17,773.61	-1,331.20	-19,104.81
基金赎回款	6,262,312.62	404,149.86	6,666,462.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,329,250.12	-2,176,170.84	-23,505,420.96

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,706,176.54	-3,764,446.05	-7,470,622.59
本期利润	-1,620,047.33	-452,577.55	-2,072,624.88
本期基金份额交易产生的变动数	294,542.41	301,671.78	596,214.19
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	294,542.41	301,671.78	596,214.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,031,681.46	-3,915,351.82	-8,947,033.28

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-10,251,907.39	-676,279.29	-10,928,186.68
本期利润	-1,652,702.25	-328,219.42	-1,980,921.67
本期基金份额交易产生的变动数	3,796,461.35	198,558.26	3,995,019.61
其中：基金申购款	-44,740.33	-3,307.49	-48,047.82
基金赎回款	3,841,201.68	201,865.75	4,043,067.43
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-8,108,148.29	-805,940.45	-8,914,088.74
-----	---------------	-------------	---------------

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	103,556.57	200,462.86
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	50,019.82	81,978.51
其他	1,561.32	2,161.17
合计	155,137.71	284,602.54

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,029,587.49	-57,089,522.16
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	-7,029,587.49	-57,089,522.16

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	686,861,785.89	983,775,027.42
减：卖出股票成本总额	691,927,248.38	1,037,864,429.64
减：交易费用	1,964,125.00	3,000,119.94
买卖股票差价收入	-7,029,587.49	-57,089,522.16

7.4.7.14.3 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31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	-	-

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	9,632.44	12,097.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-968,869.89	-528,374.02
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	-959,237.45	-516,276.74

7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,039,849.07	9,554,631.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,976,220.34	10,057,811.49
减：应计利息总额	31,651.16	24,340.41
减：交易费用	847.46	853.74
买卖债券差价收入	-968,869.89	-528,374.02

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。

7.4.7.15.3 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.15.4 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.16.2 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	-	0.00
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应计利息总额	-	0.00
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.16.3 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31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	-	-

7.4.7.16.4 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31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	-	-

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.17.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.17.3 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.17.4 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

	月 31 日	月 31 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	-	-

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	-	-

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
-	-	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	764,650.33	1,922,489.10
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	764,650.33	1,922,489.10

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

1. 交易性金融资产	-1,803,403.59	-375,156.84
股票投资	-2,806,023.00	627,462.57
债券投资	1,002,619.41	-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	-	-33,944.60
合计	-1,803,403.59	-341,212.24

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	16,262.59	16,909.17
-	-	-
合计	16,262.59	16,909.17

7.4.7.22 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

银行费用	12,729.67	14,617.95
账户维护费	-36,000.00	36,000.00
合计	141,729.67	215,617.95

7.4.7.24 分部报告

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴证券股份有限公司（“东吴证券”）	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
东吴创新资本管理有限责任公司（“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（“东吴金科”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	1,355,170,294.66	100.00	1,961,032,061.05	100.00

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	21,184,172.73	100.00	29,503,254.43	100.00

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	6,432,832,000.00	100.00	9,732,400,000.00	100.00

7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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 (%)
-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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12月31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	1,290,453.17	100.00	637,983.52	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,855,569.57	100.00	2,754,410.03	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	597,772.62	986,710.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	597,772.62	986,710.40

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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	250,677.79	389,935.49

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：

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

7.4.10.2.3 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12月31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	-	-	111,735.64	111,735.64
合计	-	-	111,735.64	111,735.64
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12月31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	-	-	208,646.59	208,646.59
合计	-	-	208,646.59	208,646.59

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

7.4.10.3 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12月31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12月31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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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12月31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12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

-	-	-	-	-
---	---	---	---	---

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未参与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未参与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 12 月 31 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-
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	-	3.5400%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31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	-	-	-
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	-	2.6200%	-

7.4.10.5.2 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12月31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 12 月 31 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 (%)
东吴创新 资本管理 有限责任 公司	17,784,286.27	12.4800	17,784,286.27	9.2400
东吴（苏 州）金融 科技有限 公司	177,745.53	0.1200	177,745.53	0.0900

份额单位：份

东吴裕盈 C 份额

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 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 尊选 1 号 FOF 单一 资产管理 计划	1,015,847.22	0.7100	1,015,847.22	0.5300

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	5,410,656.83	103,556.57	10,315,433.89	200,462.86

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 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：股/ 张）	总金额

-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 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。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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：本集合计划本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 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参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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；本集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.3 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
--------	-------------------------	--------------------------

AAA	-	-
AAA 以下	-	8,865,037.19
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	8,865,037.19

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级中包含国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

7.4.13.2.5 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.6 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 12 月 31 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 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	-	-	-	-
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	-	-	-	-

注：本集合计划无重大的流动性风险。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	5,409,341.19	-	-	1,315.64	5,410,656.83
结算备付金	1,981,222.85	-	-	980.65	1,982,203.50
存出保证金	86,661.68	-	-	42.90	86,704.58
交易性金融资产	-	-	-	69,210,448.52	69,210,448.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	14,700,000.00	-	-	-2,636.59	14,697,363.41
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,886,854.59	10,886,854.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,177,225.72	-	-	80,097,005.71	102,274,231.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	313,799.43	313,799.43
应付管理人报酬	-	-	-	40,038.62	40,038.62
应付托管费	-	-	-	17,230.36	17,230.36
应付清算款	-	-	-	126,778.65	126,778.65
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	7,144.39	7,144.39
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	682,983.52	682,983.52
负债总计	-	-	-	1,187,975.31	1,187,975.31
利率敏感度缺口	22,177,225.72	-	-	78,909,030.40	101,086,256.12
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
分析	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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	-	-	-

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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
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 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 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。		
分析	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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	-	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集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发生变动时产生的价格波动风险。本集计划主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	69,210,448.52	68.47	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	69,210,448.52	68.47	95,794,234.00	64.17

7.4.13.4.3.2 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，其他影响集计划资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	

	动	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
		权益投资公允价值 减少 5%	-3,460,522.43
	权益投资公允价值 增加 5%	3,460,522.43	4,789,711.70

7.4.13.4.4 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	69,210,448.52	104,659,271.19
第二层次	-	-
第三层次	-	-

合计	69,210,448.52	104,659,271.19
----	---------------	----------------

注：2023 年 12 月 31 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 69,210,448.52 元，无第二、三层次的余额。

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：本集合计划本报告期及上年度可比同期无第三层次公允价值余额及变动情况。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末及上年度末无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划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，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 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，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	69,210,448.52	67.67
	其中：股票	69,210,448.52	67.67
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	14,697,363.41	14.37
	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	7,392,860.33	7.23
-	-	-	-
8	其他各项资产	10,973,559.17	10.73
9	合计	102,274,231.43	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,527,756.00	2.50
C	制造业	48,603,003.28	48.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,604,744.00	2.58
E	建筑业	486,990.00	0.48
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	7,649,251.24	7.57
J	金融业	913,725.00	0.90

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,039,104.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	4,050,585.00	4.01
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	1,335,290.00	1.32
S	综合	-	-
	合计	69,210,448.52	68.47

8.2.2 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。

8.3 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	688596	正帆科技	146,505	5,805,993.15	5.74
2	002324	普利特	377,332	4,961,915.80	4.91
3	300416	苏试试验	220,500	4,050,585.00	4.01
4	688036	传音控股	26,089	3,610,717.60	3.57
5	300331	苏大维格	129,300	3,229,914.00	3.20
6	301095	广立微	35,500	2,652,915.00	2.62
7	600900	长江电力	111,600	2,604,744.00	2.58
8	603650	彤程新材	77,900	2,594,070.00	2.57
9	603986	兆易创新	27,900	2,577,681.00	2.55
10	600188	兖矿能源	127,600	2,527,756.00	2.50
11	600887	伊利股份	89,600	2,396,800.00	2.37
12	688088	虹软科技	51,731	2,123,040.24	2.10
13	688208	道通科技	85,274	2,025,257.50	2.00
14	002906	华阳集团	54,200	1,910,550.00	1.89
15	600458	时代新材	170,200	1,567,542.00	1.55
16	300559	佳发教育	98,000	1,519,000.00	1.50
17	002465	海格通信	118,200	1,518,870.00	1.50
18	002947	恒铭达	44,596	1,435,099.28	1.42
19	600050	中国联通	309,200	1,354,296.00	1.34
20	301052	果麦文化	30,500	1,335,290.00	1.32
21	688311	盟升电子	25,439	1,297,643.39	1.28
22	002262	恩华药业	47,200	1,280,064.00	1.27

23	000988	华工科技	40,700	1,211,232.00	1.20
24	688235	百济神州	8,464	1,176,834.56	1.16
25	001270	铖昌科技	18,100	1,135,051.00	1.12
26	600989	宝丰能源	71,100	1,050,147.00	1.04
27	605168	三人行	16,400	1,039,104.00	1.03
28	601689	拓普集团	13,600	999,600.00	0.99
29	002414	高德红外	131,800	962,140.00	0.95
30	600557	康缘药业	46,700	958,284.00	0.95
31	601688	华泰证券	65,500	913,725.00	0.90
32	300408	三环集团	30,000	883,500.00	0.87
33	300762	上海瀚讯	57,800	871,624.00	0.86
34	003021	兆威机电	8,700	817,713.00	0.81
35	300115	长盈精密	54,400	720,800.00	0.71
36	002138	顺络电子	23,600	637,436.00	0.63
37	603605	珀莱雅	5,000	497,000.00	0.49
38	601868	中国能建	231,900	486,990.00	0.48
39	603501	韦尔股份	4,400	469,524.00	0.46

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600079	人福医药	22,475,113.00	15.06
2	600021	上海电力	20,038,750.00	13.42
3	600011	华能国际	14,914,510.34	9.99
4	600050	中国联通	14,381,653.00	9.63
5	601991	大唐发电	14,171,988.00	9.49
6	601868	中国能建	13,273,683.00	8.89
7	600019	宝钢股份	11,992,400.00	8.03
8	300316	晶盛机电	11,460,984.64	7.68
9	000786	北新建材	10,776,473.00	7.22
10	600557	康缘药业	10,127,717.00	6.78
11	002865	钧达股份	10,048,492.99	6.73
12	002475	立讯精密	9,997,640.00	6.70
13	688036	传音控股	9,992,236.79	6.69
14	000589	贵州轮胎	9,878,792.40	6.62
15	002324	普利特	9,664,977.92	6.47
16	688088	虹软科技	9,432,647.80	6.32
17	002129	TCL 中环	9,346,855.00	6.26
18	603986	兆易创新	9,074,692.96	6.08
19	300760	迈瑞医疗	8,979,018.00	6.02
20	003021	兆威机电	8,964,171.00	6.01
21	000938	紫光股份	8,839,491.00	5.92

22	601318	中国平安	8,784,271.00	5.88
23	688596	正帆科技	8,648,992.19	5.79
24	688025	杰普特	8,433,210.26	5.65
25	002436	兴森科技	8,337,731.00	5.59
26	002049	紫光国微	7,226,720.00	4.84
27	002714	牧原股份	6,693,947.00	4.48
28	688110	东芯股份	6,484,850.22	4.34
29	600132	重庆啤酒	6,321,785.00	4.23
30	300750	宁德时代	6,102,866.00	4.09
31	601166	兴业银行	6,021,591.00	4.03
32	301052	果麦文化	5,498,614.00	3.68
33	002050	三花智控	5,486,398.00	3.68
34	301393	昊帆生物	5,335,963.78	3.57
35	688208	道通科技	5,283,497.35	3.54
36	688311	盟升电子	5,135,613.17	3.44
37	000983	山西焦煤	5,090,828.00	3.41
38	002116	中国海诚	5,068,560.00	3.40
39	002011	盾安环境	5,067,992.00	3.40
40	600030	中信证券	4,894,836.00	3.28
41	300559	佳发教育	4,842,341.00	3.24
42	300416	苏试试验	4,841,596.00	3.24
43	300682	朗新集团	4,628,610.00	3.10
44	002120	韵达股份	4,562,369.00	3.06
45	601888	中国中免	4,421,966.00	2.96
46	300687	赛意信息	4,393,791.00	2.94
47	300680	隆盛科技	4,325,830.00	2.90
48	688235	百济神州	4,163,060.18	2.79
49	002291	遥望科技	4,040,804.43	2.71
50	301095	广立微	3,996,176.00	2.68
51	300331	苏大维格	3,958,292.00	2.65
52	002268	电科网安	3,878,700.00	2.60
53	300820	英杰电气	3,876,044.00	2.60
54	600458	时代新材	3,859,803.00	2.59
55	002179	中航光电	3,843,422.00	2.57
56	600478	科力远	3,842,544.00	2.57
57	603688	石英股份	3,839,457.00	2.57
58	300274	阳光电源	3,735,423.00	2.50
59	002906	华阳集团	3,577,473.00	2.40
60	600498	烽火通信	3,502,640.00	2.35
61	600459	贵研铂业	3,398,755.96	2.28
62	300408	三环集团	3,394,659.00	2.27
63	002463	沪电股份	3,374,510.00	2.26
64	600188	兖矿能源	3,225,729.00	2.16

65	601208	东材科技	3,173,638.00	2.13
66	601877	正泰电器	3,118,831.00	2.09
67	600418	江淮汽车	3,102,809.00	2.08
68	300502	新易盛	3,055,500.00	2.05
69	600499	科达制造	3,006,818.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	22,925,136.03	15.36
2	600021	上海电力	20,610,050.18	13.81
3	600011	华能国际	16,214,492.13	10.86
4	300316	晶盛机电	16,199,177.50	10.85
5	002129	TCL 中环	15,610,214.25	10.46
6	002324	普利特	15,145,502.00	10.15
7	601991	大唐发电	14,499,847.00	9.71
8	000786	北新建材	13,426,391.18	8.99
9	300760	迈瑞医疗	12,840,147.00	8.60
10	601868	中国能建	12,519,462.00	8.39
11	600030	中信证券	12,224,252.25	8.19
12	600019	宝钢股份	12,160,901.00	8.15
13	600050	中国联通	11,824,714.00	7.92
14	002268	电科网安	10,796,915.20	7.23
15	002475	立讯精密	10,608,403.00	7.11
16	000589	贵州轮胎	10,217,276.40	6.84
17	002865	钧达股份	10,006,621.32	6.70
18	600557	康缘药业	9,824,540.00	6.58
19	000983	山西焦煤	9,498,956.00	6.36
20	688025	杰普特	9,424,323.82	6.31
21	000938	紫光股份	9,102,722.00	6.10
22	601318	中国平安	8,722,444.00	5.84
23	003021	兆威机电	8,499,604.00	5.69
24	002291	遥望科技	8,257,833.00	5.53
25	002436	兴森科技	8,245,290.00	5.52
26	688036	传音控股	7,773,761.27	5.21
27	688088	虹软科技	7,363,444.91	4.93
28	002179	中航光电	7,190,645.43	4.82
29	002049	紫光国微	6,535,152.72	4.38
30	688110	东芯股份	6,337,132.91	4.25
31	601166	兴业银行	6,023,596.00	4.04
32	600132	重庆啤酒	5,883,593.00	3.94
33	300750	宁德时代	5,875,060.84	3.94
34	002714	牧原股份	5,836,015.00	3.91

35	603986	兆易创新	5,765,585.76	3.86
36	301393	昊帆生物	5,494,495.82	3.68
37	002050	三花智控	5,453,489.00	3.65
38	002352	顺丰控股	5,423,315.00	3.63
39	002120	韵达股份	5,196,764.00	3.48
40	002011	盾安环境	5,141,469.00	3.44
41	300087	荃银高科	5,024,025.00	3.37
42	600316	洪都航空	4,918,954.80	3.30
43	603345	安井食品	4,915,970.00	3.29
44	002116	中国海诚	4,913,224.00	3.29
45	600905	三峡能源	4,872,518.00	3.26
46	300687	赛意信息	4,602,259.00	3.08
47	601778	晶科科技	4,567,207.00	3.06
48	300747	锐科激光	4,447,217.00	2.98
49	300408	三环集团	4,435,488.00	2.97
50	300680	隆盛科技	4,432,546.40	2.97
51	300682	朗新集团	4,285,384.00	2.87
52	601888	中国中免	4,155,990.68	2.78
53	600887	伊利股份	4,057,431.00	2.72
54	688311	盟升电子	4,029,494.97	2.70
55	600478	科力远	3,844,178.00	2.58
56	603688	石英股份	3,823,850.00	2.56
57	301052	果麦文化	3,814,024.00	2.56
58	300559	佳发教育	3,456,601.00	2.32
59	600498	烽火通信	3,429,880.00	2.30
60	300820	英杰电气	3,377,203.00	2.26
61	600418	江淮汽车	3,340,331.00	2.24
62	002463	沪电股份	3,336,419.00	2.24
63	300274	阳光电源	3,268,928.00	2.19
64	688596	正帆科技	3,229,679.36	2.16
65	600459	贵研铂业	3,210,807.91	2.15
66	300142	沃森生物	3,207,421.00	2.15
67	601208	东材科技	3,188,859.00	2.14
68	601985	中国核电	3,036,495.00	2.03
69	600309	万华化学	3,017,910.00	2.02

8.4.3 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	668,149,485.90
卖出股票收入（成交）总额	686,861,785.89

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。

8.5 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：报告期末，本集合计划未持有债券投资。

8.6 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 (%)
-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：报告期末，本集合计划未持有资产支持证券投资。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

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

注：报告期末，本集合计划未持有贵金属资产。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

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

注：报告期末，本集合计划未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末，本集合计划未持有股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划报告期内未进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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报告期内未超出集合计划合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	86,704.58
2	应收清算款	10,886,854.59
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	10,973,559.17

8.12.4 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（%）
-	-	-	-	-

注：报告期末，本集合计划未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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：报告期末，本集合计划前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	912	88,496.17	2,551,121.98	3.16	78,157,386.46	96.84
东吴裕盈 B 份额	130	244,712.87	23,002,309.19	72.31	8,810,364.35	27.69
东吴裕盈 C 份额	356	84,077.58	1,015,847.22	3.39	28,915,769.90	96.61
合计	1,398	101,897.57	26,569,278.39	18.65	115,883,520.71	81.35

9.2 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	0.0700
	东吴裕盈 B 份额	285,248.27	0.2000
	东吴裕盈 C 份额	-	-
	合计	385,993.79	0.2700

9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	东吴裕盈 A 份额	10~50
	东吴裕盈 B 份额	0~10
	东吴裕盈 C 份额	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴裕盈 A 份额	-
	东吴裕盈 B 份额	10~50
	东吴裕盈 C 份额	-
	合计	-

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	合计	-

§ 10 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	84,348.06	-	178,169.82
减：本报告期基金总赎回份额	29,874,854.80	2,397,907.50	18,029,644.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	80,708,508.44	31,812,673.54	29,931,617.12

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内，集合计划管理人、托管人未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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	-

注：本报告期内本集合计划管理人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.6.2 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	-

注：本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东吴证券	3	1,355,170,294.66	100.00	1,290,453.17	100.00	-
-	-	-	-	-	-	-

11.7.2 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	21,184,172.73	100.00	6,432,832.00	100.00	-	-
-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
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	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
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	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
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投资经理变更公告	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报	2023 年 7 月 13 日
5	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(更新)	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 13 日
6	东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划(A 份额) 基金产品资料概要更新	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 13 日
7	东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划(A 份额) 基金产品资料概要更新	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 13 日
8	东吴裕盈一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划(A 份额) 基金产品资料概要更新	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 13 日
9	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 2 季度报告	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 20 日
10	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	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 30 日
11	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	管理人官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

注：报告期内单一投资者持有基金份额比例无达到或超过 20%的情况。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2024 年 3 月 29 日