

东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 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

报告送出日期：二〇二四年四月二十二日

## § 1 重要提示

基金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。

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 2024 年 4 月 17 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 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   |
| 报告期末基金份额总额 | 4,720,169,520.27 份   |
| 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>(一) 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，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。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>(二) 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。 |
| 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              |

### § 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 1 月 1 日 — 2024 年 3 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 42,686,075.07                         |
| 2. 本期利润         | 42,686,075.07                         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0090                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,788,584,118.49                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0145                                |

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上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，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

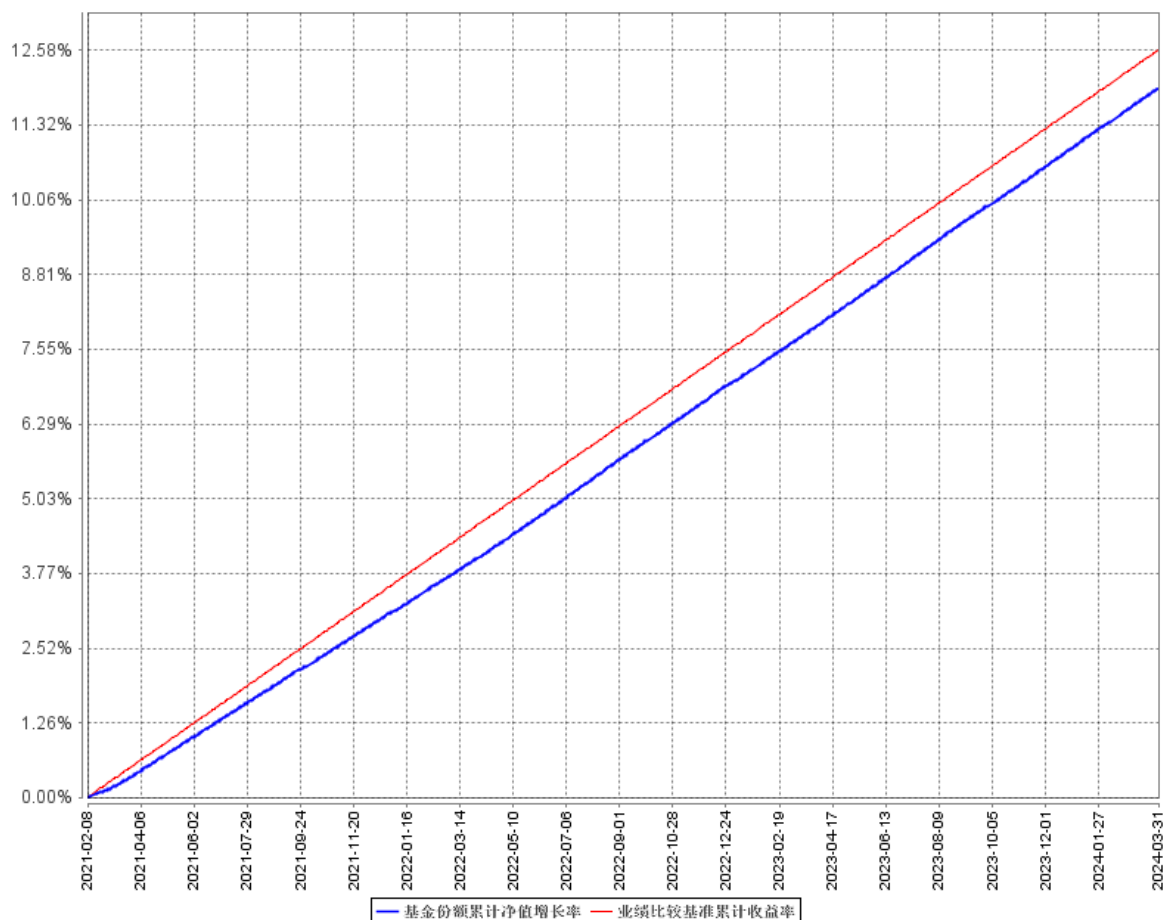
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.90%      | 0.01%         | 1.00%          | 0.02%                 | -0.10% | -0.01% |
| 过去六个月          | 1.80%      | 0.01%         | 2.01%          | 0.01%                 | -0.21% | 0.00%  |
| 过去一年           | 3.72%      | 0.01%         | 4.01%          | 0.01%                 | -0.29% | 0.00%  |
| 过去三年           | 11.50%     | 0.01%         | 12.01%         | 0.01%                 | -0.51% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.94%     | 0.01%         | 12.58%         | 0.01%                 | -0.64% | 0.00%  |

注：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%。

### 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

基金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



注：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%。

## § 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 |        |  |
| 王明欣 | 基金经理 | 2022年5月9日   | -    | 6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 |

|    |      |                 |   |      |   |
|----|------|-----------------|---|------|---|
|    |      |                 |   |      | <p>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。</p>                               |
| 邵笛 | 基金经理 | 2022 年 12 月 2 日 | - | 17 年 | <p>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。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</p> |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 金经理，2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日及 2022 年 12 月 2 日至今担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，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 5 月 9 日至今担任东吴优益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。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金本报告期末无基金经理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合规守信情况的说明

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、法规，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 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，加强了对所管理的不同投资组合间交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

#### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年一季度经济基本面延续此前的修复态势，总需求尚未明显好转，地产投资与销售同比数据大幅回落。进入 3 月后，各项数据有所好转，3 月制造业 PMI 在时隔 5 个月后重回 50% 上方，好于预期。在各类地产放松政策出台后，商品房销售面积同比数据边际好转。随着外部经济体的补库周期开启，以及市场竞争力提升，我国出口表现出现好转迹象。3 月份的国务院政府工作报告要求“强化宏观政策逆周期和跨周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，加强政策工具创新和协调配合”，预计特别国债发行、降低实体融资成本以及其他积极财政政策有望陆续落实。

一季度前期偏弱的基本面以及市场风险偏好回落，为债市提供了有利的条件。债券收益率在 1-2 月份全面下行，尤其以长久期品种涨幅更大。根据中债数据，一季度 10 年期国债和 30 年期国债收益率分别下行 26bp 和 36bp，债券收益率曲线进一步平坦化。进入 3 月后，超长债供给预期、防资金空转及其他各类政策预期引发债市出现调整，此后央行“存款准备金率仍有下降空间”的表述，叠加 2 月相关数据未见好转，提供了支撑，债市做多情绪再起，市场进入震荡期。一季度央行公开市场操作更加精准有效，通过降准、OMO 和 MLF 等操作提供流动性，市场资金面保持平稳充裕，资金利率波动区间大幅收窄。鉴于到稳汇率和防资金空转的需要，资金利率维持在一定区间范围内，未向下打开空间。

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。

### 4.5 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 1.0145 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.90%，业绩

比较基准收益率为 1.00%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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            | 6,491,059,312.28 | 100.00       |
|    | 其中：债券             | 6,491,059,312.28 | 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      | 32,814.64        | 0.00         |
| 8  | 其他资产              | -                | -            |
| 9  | 合计                | 6,491,092,126.92 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。



#### 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      | 摊余成本（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 6,491,059,312.28 | 135.55       |
|    | 其中：政策性金融债 | 6,491,059,312.28 | 135.55       |
| 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        | 6,491,059,312.28 | 135.55       |

#### 5.5 报告期末按摊余成本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）      | 摊余成本（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 160418 | 16 农发 18 | 31,700,000 | 3,286,111,194.19 | 68.62        |
| 2  | 160210 | 16 国开 10 | 23,200,000 | 2,381,333,400.97 | 49.73        |
| 3  | 210203 | 21 国开 03 | 4,500,000  | 450,389,944.87   | 9.41         |
| 4  | 200315 | 20 进出 15 | 1,800,000  | 182,771,327.37   | 3.82         |
| 5  | 018063 | 进出 2101  | 800,000    | 80,032,404.69    | 1.67         |

#### 5.6 报告期末按摊余成本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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 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受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券中“16 农发 18（证券代码：160418）、21 农发 03（证券代码：210403）、20 进出 15（证券代码：200315）、进出 2101（证券代码：018063）”的发行主体具有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对上述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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.10.3 其他资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

### 5.10.4 报告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。

### 5.10.5 报告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。

### 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，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

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 4,720,169,520.27 |
| 报告期期间基金总申购份额              | -                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                |
| 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               | 4,720,169,520.27 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

## § 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

基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

## § 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

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准东吴瑞盈 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指定报刊上各项公告的原稿。

### 9.2 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。

### 9.3 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

2024 年 4 月 22 日