

东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证  
券投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 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>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 16        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 6.4 报表附注.....                               | 20        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                         | 39        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 39        |
| 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 .....     | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                    | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 40        |
| 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 .....    | 40        |
| 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 ..... | 40        |
| 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 ..... | 40        |
| 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 .....    | 40        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                    | 40        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 40        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                          | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                    | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                  | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 42        |
| 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的情况 .....     | 42        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                    | <b>43</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                      | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                       | 44        |
| 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 .....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                         | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 44        |
| 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 .....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 44        |
| 10.8 其他重大事件.....                            | 45        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>              | <b>47</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 .....    | 47        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 47        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 48        |
| 12.2 存放地点.....           | 48        |
| 12.3 查阅方式.....           | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 基金名称       | 东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称       | 东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有        |
| 基金主代码      | 016758                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                       |
| 基金合同生效日    | 2022 年 11 月 8 日              |
| 基金管理人      | 东吴基金管理有限公司                   |
| 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 | 71,111,362.91 份              |
| 基金合同存续期    | 不定期                          |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                        |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                  |
| 投资策略   | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。                            |
| 风险收益特征 | 本基金预期的风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。                            |

### 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                        | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 刘婷婷                               | 方圆                      |
|         | 联系电话 | 021-50509888-8308                 | 95559                   |
|         | 电子邮箱 | liutt@scfund.com.cn               | fangy_20@bankcomm.com   |
| 客户服务电话  |      | 021-50509666/400-821-0588         | 95559                   |
| 传真      |      | 021-50509888-8211                 | 021-62701216            |
| 注册地址    |      | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址    |      | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼           | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号       |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | 李素明    | 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      | 证券时报              |
| 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 9 楼<br>901、902 室 |

§ 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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 888, 113. 40                           |
| 本期利润          | 843, 245. 30                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0. 0092                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 0. 89%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 0. 91%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2024 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | 2, 504, 146. 78                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0. 0352                                |
| 期末基金资产净值      | 73, 615, 509. 69                       |
| 期末基金份额净值      | 1. 0352                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2024 年 6 月 30 日 )                |
| 基金份额累计净值增长率   | 3. 52%                                 |

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。

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、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，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

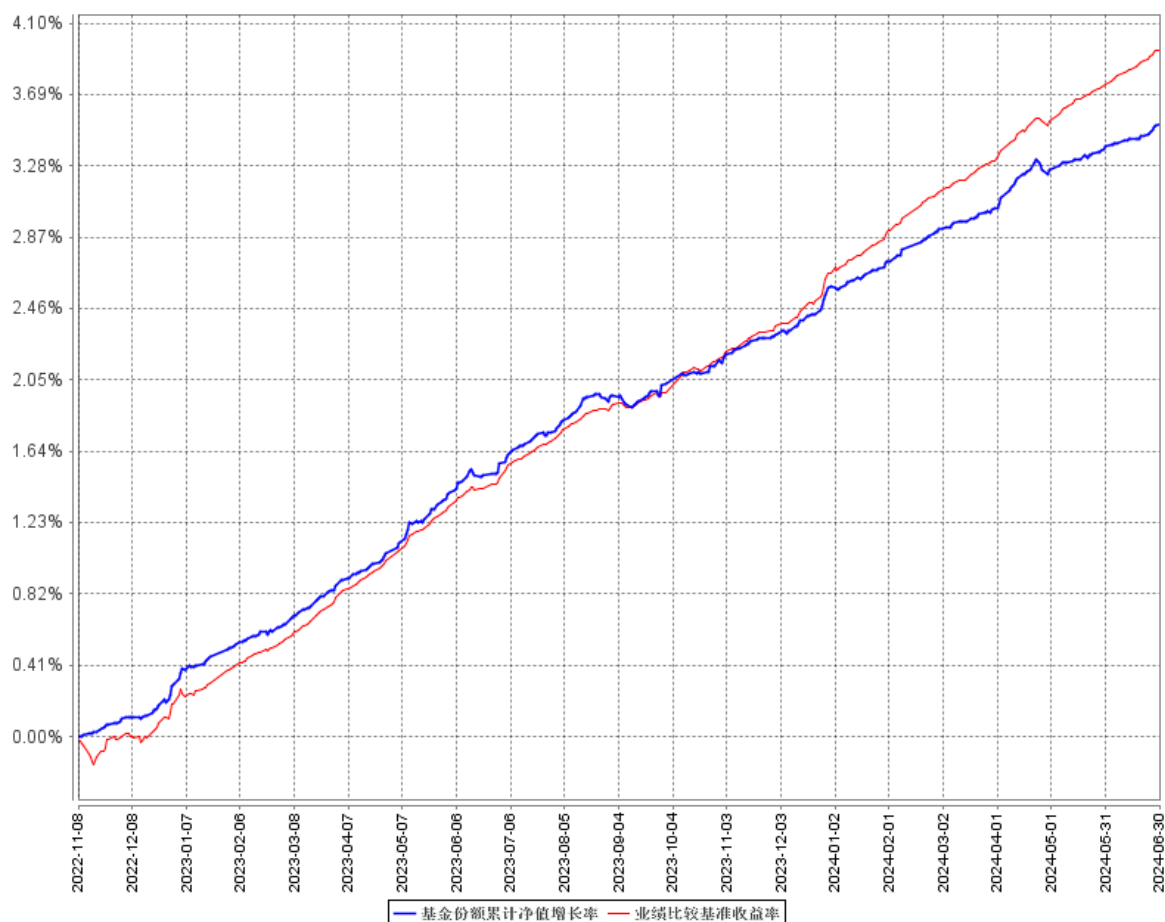
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去一个月          | 0. 13%       | 0. 01%              | 0. 19%             | 0. 01%                | -0. 06% | 0. 00% |
| 过去三个月          | 0. 47%       | 0. 01%              | 0. 62%             | 0. 01%                | -0. 15% | 0. 00% |
| 过去六个月          | 0. 91%       | 0. 01%              | 1. 25%             | 0. 01%                | -0. 34% | 0. 00% |
| 过去一年           | 1. 92%       | 0. 01%              | 2. 42%             | 0. 01%                | -0. 50% | 0. 00% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 3. 52%       | 0. 01%              | 3. 95%             | 0. 01%                | -0. 43% | 0. 00% |

注：本基金业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%。

### 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

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：本基金业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times$ 5%。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 侯慧娣 | 固收投资总监兼固定收益总部总经理、基金经理 | 2023 年 10 月 31 日 | —    | 14 年   | 侯慧娣女士, 中国国籍, 理学硕士, 具备证券投资基金从业资格。曾任职世商软件(上海)有限公司债券分析师, 国信证券研究所固定收益分析师, 德邦基金管理有限公司高级债券研究员、基金经理、固定收益部副总监, 国联安基金管理有限公司基金经理, 万家基金管理有限公司基金经理及现金管理部副总监(主持工作), 达诚基金管理有限公司总经理助理。2022 年 5 月加入东吴基金管理有限公司, 现任固收投资总监兼固定收益总部总经理、基金经理。2023 年 9 月 28 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理, 2023 年 10 月 31 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 10 月 31 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，2023 年 10 月 31 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，2023 年 10 月 31 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，2023 年 11 月 6 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。                                                                                                         |
| 王明欣 | 基金经理 | 2022 年 11 月 8 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，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。 |

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。

#### 4.1.3 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和基金合同的规定，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

2024 年上半年 GDP 同比增长 5.0%，但二季度略有走弱，PPI 同比负增速持续收敛，但 CPI 仍处于相对低位，内需动力不足。上半年出口情况好于预期，受益于对外开放进一步深入，外部交流明显好转，但对外贸易受地缘政治影响仍存压力，上半年人民币汇率表现对内部政策形成一定制约。宏观政策方面保持积极可控，货币政策延续稳中偏松的基调，通过降准和下调 LPR 利率为实体经济减轻负担。财政及产业政策方面，持续放松地产限制措施甚至部分地方政府出台支持政策，而全年 1 万亿超长期特别国债为基建投资提供了支撑。可能受限于财政纪律约束，地方投资空间受限，实际投放节奏有一定延迟。

上半年基本面和宏观政策均未超出市场预期，地产政策不断出台，但销售和投资未有明显好转，叠加一级市场债券供给偏慢，债券市场呈现上涨走势，债券收益率大幅下行，农商行及保险机构等欠配压力较大。期间虽然也受到防资金空转、提示债券风险以及限制长债配置传言等信息

的干扰而出现短期调整，之后在银行手工补息被叫停后，债市需求缺口进一步放大，债券收益率再度下行。信用债方面，风险主要集中在房地产债，而其他类各期限各等级债券收益率均有大幅下行，低等级和中长期表现尤为突出。受需求推动，上半年 10 年及以上超长信用债发行放量，市场走势表现比较突出。上半年的资金面保持平稳宽松，波动率维持在相对低位，和往年不同，季末、缴税期等时点的回购利率也鲜有大的起伏，政策呵护意图明显。

本基金在报告期内，密切跟踪市场并及时对组合结构进行调整。在保证组合流动性的前提下，根据流动性季节性规律进行杠杆套息策略，力争增厚组合收益。同时致力于跟踪同业存单指数，防范市场波动风险，在各项指标合规的前提下努力为基金持有人获取合理收益。

#### 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 1.0352 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.91%，业绩比较基准收益率为 1.25%。

#### 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，经济总量或将保持平稳修复状态，GDP 增速有望实现 5%左右的目标，出口需要稳定巩固，内需有待提振信心。发展新质生产力，推动经济高质量发展，全面建成高水平社会主义市场经济体制是主要目标，预计有望进一步深化改革开放，以制度建设为主，推进财税体制改革，理顺中央地方关系。同时，有望陆续出台更多稳增长、稳需求、稳地产相关政策，但强刺激政策的可能性或不高。预计财政可能加大发力，加快专项债发行节奏，并拓宽专项债使用范围，适当降低对项目收益要求等。而货币政策框架或将持续优化，通过降准降息及其他结构化工具，保持货币政策相对宽松，实现为实体经济发展提供保障并有所侧重的作用。因此，在基本面明显改善、市场风险偏好提升之前，市场流动性或将延续相对宽松的局面。

在目前低利率环境下，存单在收益率和流动性方面均具有相对优势，但也要关注可能引发市场波动的因素。一是房地产的拖累影响边际收窄，且在稳增长政策落地预期下，基本面进一步下行的空间可能有限；二是利率曲线重构，央行买卖国债操作可能产生不确定性影响；三是随着债券供给增加，中小银行回归主业，机构欠配压力有望边际缓解；四是债券利率处于历史相对低位，短期波动风险可能增加。

#### 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、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）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

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，东吴基金管理有限公司在东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 234,588.95                     | 578,025.35                       |
| 结算备付金         |            | 5,081.88                       | -                                |
| 存出保证金         |            | 782.36                         | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 93,014,069.32                  | 136,266,208.30                   |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 93,014,069.32                  | 136,266,208.30                   |
| 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          |            | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 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         |            | 3,514,860.05                   | 1,843,085.00                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 96,769,382.56                  | 138,687,318.65                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 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     |            | 23,005,046.57                  | 6,100,971.98                     |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 13,913.34                      | 17,264.13                        |

|             |         |               |                |
|-------------|---------|---------------|----------------|
| 应付托管费       |         | 3,478.33      | 4,316.05       |
| 应付销售服务费     |         | 13,913.34     | 17,264.13      |
| 应付投资顾问费     |         | -             | -              |
| 应交税费        |         | 1,939.01      | 795.84         |
| 应付利润        |         | -             | -              |
| 递延所得税负债     |         | -             | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 115,582.28    | 194,365.81     |
| 负债合计        |         | 23,153,872.87 | 6,334,977.94   |
| <b>净资产：</b> |         |               |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 71,111,362.91 | 129,007,508.43 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 2,504,146.78  | 3,344,832.28   |
| 净资产合计       |         | 73,615,509.69 | 132,352,340.71 |
| 负债和净资产总计    |         | 96,769,382.56 | 138,687,318.65 |

报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0352 元，基金份额总额 71,111,362.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                       | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 |
|---------------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>            |          | 1,325,467.69                             | 4,261,719.01                                  |
| 1.利息收入                    |          | 14,918.33                                | 120,454.46                                    |
| 其中：存款利息收入                 | 6.4.7.9  | 2,240.74                                 | 6,705.70                                      |
| 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                |          | 12,677.59                                | 113,748.76                                    |
| 其他利息收入                    |          | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）          |          | 1,355,417.46                             | 4,955,297.83                                  |
| 其中：股票投资收益                 | 6.4.7.10 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                    |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.11 | 1,355,417.46                             | 4,955,297.83                                  |
| 资产支持证券投资收益                | 6.4.7.12 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益                   |          | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                    | 6.4.7.13 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                      | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的金融资<br>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“-”<br>号填列） | 6.4.7.15 | -44,868.10                               | -814,033.28                                   |

|                            |            |            |              |
|----------------------------|------------|------------|--------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -          | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.16   | -          | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 482,222.39 | 974,362.64   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 94,828.00  | 256,976.08   |
| 其中：暂估管理人报酬（若有）             |            | -          | -            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 23,707.00  | 64,244.02    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 94,828.00  | 256,976.08   |
| 4. 投资顾问费                   |            | -          | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 169,464.50 | 271,866.24   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 169,464.50 | 271,866.24   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.17   | -          | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 982.43     | 4,964.05     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18   | 98,412.46  | 119,336.17   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 843,245.30 | 3,287,356.37 |
| 减：所得税费用                    |            | -          | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 843,245.30 | 3,287,356.37 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -          | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 843,245.30 | 3,287,356.37 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |              |                |
|--------------------------|---------------------------------------|--------------|----------------|
|                          | 实收基金                                  | 未分配利润        | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                | 129,007,508.43                        | 3,344,832.28 | 132,352,340.71 |
| 加：会计政策变更                 | -                                     | -            | -              |
| 前期差错更正                   | -                                     | -            | -              |
| 其他                       | -                                     | -            | -              |
| 二、本期期初净资产                | 129,007,508.43                        | 3,344,832.28 | 132,352,340.71 |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列） | -57,896,145.52                        | -840,685.50  | -58,736,831.02 |

|                                                      |                                            |                |                  |
|------------------------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|------------------|
| (一)、综合收益总额                                           | -                                          | 843,245.30     | 843,245.30       |
| (二)、本期基金份额<br>交易产生的净资产变<br>动数(净资产减少以“-”<br>号填列)      | -57,896,145.52                             | -1,683,930.80  | -59,580,076.32   |
| 其中：1.基金申购款                                           | 701,277,579.78                             | 21,171,211.50  | 722,448,791.28   |
| 2.基金赎回款                                              | -759,173,725.30                            | -22,855,142.30 | -782,028,867.60  |
| (三)、本期向基金份<br>额持有人分配利润产<br>生的净资产变动(净资<br>产减少以“-”号填列) | -                                          | -              | -                |
| (四)、其他综合收益<br>结转留存收益                                 | -                                          | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                            | 71,111,362.91                              | 2,504,146.78   | 73,615,509.69    |
| 项目                                                   | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                |                  |
|                                                      | 实收基金                                       | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                            | 1,021,787,312.25                           | 3,016,772.90   | 1,024,804,085.15 |
| 加：会计政策变更                                             | -                                          | -              | -                |
| 前期差错更正                                               | -                                          | -              | -                |
| 其他                                                   | -                                          | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                                            | 1,021,787,312.25                           | 3,016,772.90   | 1,024,804,085.15 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                             | -866,861,213.42                            | -592,162.96    | -867,453,376.38  |
| (一)、综合收益总额                                           | -                                          | 3,287,356.37   | 3,287,356.37     |
| (二)、本期基金份额<br>交易产生的净资产变<br>动数(净资产减少以“-”<br>号填列)      | -866,861,213.42                            | -3,879,519.33  | -870,740,732.75  |

|                                          |                       |                   |                       |
|------------------------------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| 其中：1.基金申购款                               | 1, 257, 237, 643. 11  | 9, 247, 236. 04   | 1, 266, 484, 879. 15  |
| 2.基金赎回款                                  | -2, 124, 098, 856. 53 | -13, 126, 755. 37 | -2, 137, 225, 611. 90 |
| （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                                | 154, 926, 098. 83     | 2, 424, 609. 94   | 157, 350, 708. 77     |

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

东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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[2022]1950 号文《关于准予东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》的核准，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 2022 年 11 月 08 日正式生效，首次设立募集规模为 1, 630, 483, 656. 33 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于标的指数成份券及其备选成份券以外的具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分等）、非金融企业债务融资工具（中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具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。本基金不投资股票等权益资产，也不投资可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金业绩比较基准：中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 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、应用指南、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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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)及地方教育费附加。

## 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>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 234,588.95             |
| 等于：本金          | 234,517.24             |
| 加：应计利息         | 71.71                  |
| 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             | 234,588.95             |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |            |               |           |
|---------------|-------|------------------------|------------|---------------|-----------|
|               |       | 成本                     | 应计利息       | 公允价值          | 公允价值变动    |
| 股票            |       | -                      | -          | -             | -         |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -          | -             | -         |
| 债券            | 交易所市场 | 5,017,885.72           | 78,452.06  | 5,090,952.06  | -5,385.72 |
|               | 银行间市场 | 87,335,054.13          | 545,467.26 | 87,923,117.26 | 42,595.87 |
|               | 合计    | 92,352,939.85          | 623,919.32 | 93,014,069.32 | 37,210.15 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -          | -             | -         |
| 基金            |       | -                      | -          | -             | -         |
| 其他            |       | -                      | -          | -             | -         |
| 合计            |       | 92,352,939.85          | 623,919.32 | 93,014,069.32 | 37,210.15 |

**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 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 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      | 26,769.82              |
| 其中：交易所市场    | —                      |
| 银行间市场       | 26,769.82              |
| 应付利息        | —                      |
| 应付审计费       | 20,140.12              |
| 应付信息披露费     | 59,672.34              |
| 应付账户维护费     | 9,000.00               |
| 合计          | 115,582.28             |

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 129,007,508.43                        | 129,007,508.43  |
| 本期申购          | 701,277,579.78                        | 701,277,579.78  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -759,173,725.30                       | -759,173,725.30 |
| 本期末           | 71,111,362.91                         | 71,111,362.91   |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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           | 3,601,702.27   | -256,869.99   | 3,344,832.28   |
| 本期期初           | 3,601,702.27   | -256,869.99   | 3,344,832.28   |
| 本期利润           | 888,113.40     | -44,868.10    | 843,245.30     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,796,975.87  | 113,045.07    | -1,683,930.80  |
| 其中：基金申购款       | 22,808,926.06  | -1,637,714.56 | 21,171,211.50  |
| 基金赎回款          | -24,605,901.93 | 1,750,759.63  | -22,855,142.30 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 2,692,839.80   | -188,693.02   | 2,504,146.78   |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,170.50                              |
| 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 | 67.70                                 |
| 其他        | 2.54                                  |
| 合计        | 2,240.74                              |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,199,693.07               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 155,724.39                 |
| 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             | 1,355,417.46 |

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 762,649,693.35             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 753,807,085.30             |
| 减：应计利息总额               | 8,660,207.91               |
| 减：交易费用                 | 26,675.75                  |
| 买卖债券差价收入               | 155,724.39                 |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 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。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 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。

##### 6.4.7.13.2 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。

#### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -44,868.10                 |
| ——股票投资     | —                          |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| ——债券投资                     | -44,868.10 |
| ——资产支持证券投资                 | -          |
| ——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<br>增值税 | -          |
| 合计                         | -44,868.10 |

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 20,140.12                             |
| 信息披露费   | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 账户维护费   | 18,000.00                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 98,412.46                             |

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 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构        |
| 东吴证券股份有限公司 | 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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                  |
|------------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东吴证券股份有限公司 | 15,052,830.00              | 100.00%          | -                               | -                |

**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>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 94,828.00                      | 256,976.08                      |

|                      |           |            |
|----------------------|-----------|------------|
| 其中：应支付销售机构的<br>客户维护费 | 30,654.63 | 96,568.22  |
| 应支付基金管理<br>人的净管理费    | 64,173.37 | 160,407.86 |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目                 | 本期                   | 上年度可比期间              |
|--------------------|----------------------|----------------------|
|                    | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的<br>托管费 | 23,707.00            | 64,244.02            |

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。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 本期                              |
|-------------------|---------------------------------|
|                   | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 交通银行股份有限公司        | 7,499.46                        |
| 东吴基金管理有限公司        | 4.33                            |
| 东吴证券股份有限公司        | 27,617.98                       |
| 合计                | 35,121.77                       |

| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 上年度可比期间                         |
|-------------------|---------------------------------|
|                   | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 交通银行股份有限公司        | 18,321.71                       |
| 东吴基金管理有限公司        | 9.92                            |
| 东吴证券股份有限公司        | 203,826.55                      |
| 合计                | 222,158.18                      |

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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   |
| 交通银行股份有限公司 | 234,588.95                            | 2,170.50 | 145,824.63                                 | 3,760.29 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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

本基金本报告期未发生其它关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 23,005,046.57 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       |
|-----------|---------------|----------------|--------|--------|--------------|
| 112499037 | 24 成都银行 CD101 | 2024 年 7 月 1 日 | 98.24  | 70,000 | 6,876,919.29 |
| 112408130 | 24 中信银行 CD130 | 2024 年 7 月 1 日 | 98.51  | 80,000 | 7,880,744.55 |
| 112481544 | 24 杭州银行 CD133 | 2024 年 7 月 1 日 | 98.07  | 67,000 | 6,570,523.70 |
| 112403058 | 24 农业银行 CD058 | 2024 年 7 月 1 日 | 98.51  | 28,000 | 2,758,260.59 |

|    |  |  |  |         |               |
|----|--|--|--|---------|---------------|
| 合计 |  |  |  | 245,000 | 24,086,448.13 |
|----|--|--|--|---------|---------------|

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 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 2024 年 06 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

本基金为混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于标的指数成份券及其备选成份券以外的具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分等）、非金融企业债务融资工具（中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具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。本基金不投资股票等权益资产，也不投资可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。

在正常市场情况下，基金管理人力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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约责任，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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                      | —                        |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 13,150,813.97          | 13,153,100.00            |
| 合计     | 13,150,813.97          | 13,153,100.00            |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券。

##### 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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                      | —                        |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 63,441,866.57          | 114,945,918.30           |
| 合计     | 63,441,866.57          | 114,945,918.30           |

#### 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>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 5,281,344.26           | —                        |
| AAA 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 11,140,044.52          | 8,167,190.00             |
| 合计     | 16,421,388.78          | 8,167,190.00             |

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可随时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。本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的基金管理人定期对本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 年 6 月<br>30 日 | 1 个月以内        | 1-3 个月       | 3 个月-1 年      | 1-5 年         | 5 年<br>以上 | 不计息          | 合计            |
|---------------------------|---------------|--------------|---------------|---------------|-----------|--------------|---------------|
| 资产                        |               |              |               |               |           |              |               |
| 货币资金                      | 234,588.95    | -            | -             | -             | -         | -            | 234,588.95    |
| 结算备付金                     | 5,081.88      | -            | -             | -             | -         | -            | 5,081.88      |
| 存出保证金                     | 782.36        | -            | -             | -             | -         | -            | 782.36        |
| 交易性金融资产                   | -             | 3,025,831.23 | 78,698,002.32 | 11,290,235.77 | -         | -            | 93,014,069.32 |
| 衍生金融资产                    | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 买入返售金融资产                  | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 应收清算款                     | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 应收股利                      | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 应收申购款                     | -             | -            | -             | -             | -         | 3,514,860.05 | 3,514,860.05  |
| 其他资产                      | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 资产总计                      | 240,453.19    | 3,025,831.23 | 78,698,002.32 | 11,290,235.77 | -         | 3,514,860.05 | 96,769,382.56 |
| 负债                        |               |              |               |               |           |              |               |
| 卖出回购金融资产款                 | 23,005,046.57 | -            | -             | -             | -         | -            | 23,005,046.57 |
| 应付清算款                     | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 应付赎回款                     | -             | -            | -             | -             | -         | -            | -             |
| 应付管理人报酬                   | -             | -            | -             | -             | -         | 13,913.34    | 13,913.34     |
| 应付托管费                     | -             | -            | -             | -             | -         | 3,478.33     | 3,478.33      |
| 应付销售服务费                   | -             | -            | -             | -             | -         | 13,913.34    | 13,913.34     |

|                          |               |               |                |               |       |               |                |
|--------------------------|---------------|---------------|----------------|---------------|-------|---------------|----------------|
| 应交税费                     | -             | -             | -              | -             | -     | 1,939.01      | 1,939.01       |
| 应付利润                     | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 其他负债                     | -             | -             | -              | -             | -     | 115,582.28    | 115,582.28     |
| 负债总计                     | 23,005,046.57 | -             | -              | -             | -     | 148,826.30    | 23,153,872.87  |
| 利率敏感度缺口                  | 22,764,593.38 | 3,025,831.23  | 78,698,002.32  | 11,290,235.77 | -     | -3,366,033.75 | 73,615,509.69  |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 个月以内        | 1-3 个月        | 3 个月-1 年       | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息           | 合计             |
| 资产                       |               |               |                |               |       |               |                |
| 货币资金                     | 578,025.35    | -             | -              | -             | -     | -             | 578,025.35     |
| 结算备付金                    | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 存出保证金                    | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 交易性金融资产                  | -             | 27,115,163.15 | 109,151,045.15 | -             | -     | -             | 136,266,208.30 |
| 衍生金融资产                   | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 买入返售金融资产                 | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 应收清算款                    | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 应收股利                     | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 应收申购款                    | -             | -             | -              | -             | -     | 1,843,085.00  | 1,843,085.00   |
| 其他资产                     | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 资产总计                     | 578,025.35    | 27,115,163.15 | 109,151,045.15 | -             | -     | 1,843,085.00  | 138,687,318.65 |
| 负债                       |               |               |                |               |       |               |                |
| 卖出回购金融资产款                | 6,100,971.98  | -             | -              | -             | -     | -             | 6,100,971.98   |
| 应付清算款                    | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 应付赎回款                    | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 应付管理人报酬                  | -             | -             | -              | -             | -     | 17,264.13     | 17,264.13      |
| 应付托管费                    | -             | -             | -              | -             | -     | 4,316.05      | 4,316.05       |
| 应付销售服务费                  | -             | -             | -              | -             | -     | 17,264.13     | 17,264.13      |
| 应交税费                     | -             | -             | -              | -             | -     | 795.84        | 795.84         |
| 应付利润                     | -             | -             | -              | -             | -     | -             | -              |
| 其他负债                     | -             | -             | -              | -             | -     | 194,365.81    | 194,365.81     |
| 负债总计                     | 6,100,971.98  | -             | -              | -             | -     | 234,005.96    | 6,334,977.94   |
| 利率敏感度缺口                  | -5,522,946.63 | 27,115,163.15 | 109,151,045.15 | -             | -     | -1,609,079.04 | 132,352,340.71 |

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

|    |                                               |                             |                        |
|----|-----------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 |                             |                        |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。        |                             |                        |
|    | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。              |                             |                        |
| 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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 基准利率减少 25 个基点                                 | 169,544.29                  | 126,537.19             |
|    | 基准利率增加 25 个基点                                 | -168,859.06                 | -126,275.87            |

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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。于 2024 年 6 月 30 日，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、买入返售金融资产及卖出回购资产，因此无重大市场价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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。

#### 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

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 93,014,069.32          | 136,266,208.30           |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 93,014,069.32          | 136,266,208.30           |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金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。

##### 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，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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

## § 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            | 93,014,069.32 | 96.12         |
|    | 其中：债券             | 93,014,069.32 | 96.12         |
|    | 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      | 239,670.83    | 0.25          |
| 8  | 其他各项资产            | 3,515,642.41  | 3.63          |
| 9  | 合计                | 96,769,382.56 | 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投资股票。

#### 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投资股票。

#### 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      | 5,090,952.06  | 6.92         |
| 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   | 13,191,014.92 | 17.92        |
| 6  | 中期票据      | 11,290,235.77 | 15.34        |
| 7  | 可转债（可交换债） | —             | —            |
| 8  | 同业存单      | 63,441,866.57 | 86.18        |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 93,014,069.32 | 126.35       |

## 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  | 112417056 | 24 光大银行 CD056 | 80,000 | 7,886,018.52 | 10.71        |
| 2  | 112408130 | 24 中信银行 CD130 | 80,000 | 7,880,744.55 | 10.71        |
| 2  | 112420104 | 24 广发银行 CD104 | 80,000 | 7,880,744.55 | 10.71        |
| 3  | 112415185 | 24 民生银行 CD185 | 80,000 | 7,866,292.69 | 10.69        |
| 4  | 112403058 | 24 农业银行 CD058 | 75,000 | 7,388,198.01 | 10.04        |
| 5  | 112499037 | 24 成都银行 CD101 | 70,000 | 6,876,919.29 | 9.34         |

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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除“24 光大银行 CD056（证券代码：112417056）、24 广发银行 CD104（112420104）、24 中信银行 CD130（证券代码：112408130）、24 民生银行 CD185（证券代码：112415185）、24 农业银行 CD058（证券代码：112403058）”外，其他证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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 | 782.36       |
| 2  | 应收清算款 | —            |
| 3  | 应收股利  | —            |
| 4  | 应收利息  | —            |
| 5  | 应收申购款 | 3,514,860.05 |
| 6  | 其他应收款 | —            |
| 7  | 待摊费用  | —            |
| 8  | 其他    | —            |
| 9  | 合计    | 3,515,642.41 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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，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<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 1,698        | 41,879.48     | 24,231,399.11 | 34.08%     | 46,879,963.80 | 65.92%     |

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 | 160.83    | 0.0002%  |

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的情况

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                      |
|----------------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（ 2022 年 11 月 8 日 ）基金份额总额 | 1, 630, 483, 656. 33 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 129, 007, 508. 43    |
| 本报告期基金总申购份额                      | 701, 277, 579. 78    |
| 减:本报告期基金总赎回份额                    | 759, 173, 725. 30    |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）         | -                    |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 71, 111, 362. 91     |

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：  
2024 年 4 月 24 日经东吴基金管理有限公司第三十一次股东会审议通过，聘任郭淳同志为东吴基金管理有限公司监事，王菁因工作调整不再担任监事职务。  
本报告期内，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

本基金本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

本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

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天衡会计师事务所（特殊普通合伙）。

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 |    |
| 东吴证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

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形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期交易单元无变更。

### 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 |
| 东吴证券 | 15,052,830.00 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |

### 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 | 2024 年 1 月 17 日 |
| 2  | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 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 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 3  | 东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2023 年第 4 季度报告               | 公司网站、中证信息网站                       | 2024 年 1 月 22 日 |
| 4  | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司同业易管家平台为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站      | 2024 年 2 月 5 日  |
| 5  | 东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告                             | 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 | 2024 年 2 月 7 日  |
| 6  | 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 | 2024 年 3 月 6 日  |
| 7  | 东吴基金管理有限公司关于参加长江证券股份有限公司费率优惠                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证                | 2024 年 3 月 8 日  |

|    |                                                           |                                       |                 |
|----|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|
|    | 的公告                                                       | 券日报、公司网站、<br>中证信息网站                   |                 |
| 8  | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏银行股份有限公司“华夏 e 家”同业平台为代销机构并开通转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、<br>中证信息网站 | 2024 年 3 月 19 日 |
| 9  | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 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、公司网站、<br>中证信息网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 10 | 东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2023 年年度报告                   | 公司网站、中证信息<br>网站                       | 2024 年 3 月 29 日 |
| 11 | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 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、<br>中证信息网站 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 12 | 东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年第 1 季度报告               | 公司网站、中证信息<br>网站                       | 2024 年 4 月 22 日 |
| 13 | 东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司申购补差费率优惠的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、<br>中证信息网站 | 2024 年 5 月 21 日 |
| 14 | 东吴基金管理有限公司旗下基金产品资料概要更新的提示性公告                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、<br>中证信息网站 | 2024 年 6 月 20 日 |
| 15 | 东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金更新基金产品资料概要                    | 公司网站、中证信息<br>网站                       | 2024 年 6 月 20 日 |
| 16 | 东吴基金管理有限公司关于参加东方证券股份有限公司费率优惠的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、<br>中证信息网站 | 2024 年 6 月 25 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

| 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    | 1              | 20240104-20240104        | 19,557,033.25 | 0.00 | 19,557,033.25 | 0.00       | 0.00% |
| 个人    | -              | -                        | -             | -    | -             | -          | -     |

#### 产品特有风险

#### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

#### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

#### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 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、中国证监会核准东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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、报告期内东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 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

2024 年 8 月 30 日