

东吴优益债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 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 and 基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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	42
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.11 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴优益债券型证券投资基金	
基金简称	东吴优益债券	
基金主代码	005144	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 28 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	7,040,964.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东吴优益债券 A	东吴优益债券 C
下属分级基金的交易代码	005144	005145
报告期末下属分级基金的份额总额	616,106.99 份	6,424,857.03 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
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，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	东吴优益债券 A	东吴优益债券 C
本期已实现收益	6,750.59	-179,391.70
本期利润	-10,294.10	-242,370.91
加权平均基金份 额本期利润	-0.0134	-0.0268
本期加权平均净 值利润率	-1.11%	-2.27%
本期基金份额净 值增长率	-0.76%	-0.87%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	103,124.52	894,671.59
期末可供分配基 金份额利润	0.1674	0.1393
期末基金资产净 值	727,509.70	7,404,182.72
期末基金份额净 值	1.1808	1.1524
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净	25.13%	20.96%

值增长率		
------	--	--

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴优益债券 A

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	-1.31%	0.65%	1.63%	0.14%	-2.94%	0.51%
过去六个月	-0.76%	0.54%	1.32%	0.13%	-2.08%	0.41%
过去一年	0.79%	0.39%	1.69%	0.11%	-0.90%	0.28%
过去三年	10.12%	0.36%	6.96%	0.12%	3.16%	0.24%
过去五年	11.99%	0.30%	6.46%	0.12%	5.53%	0.18%
过去七年	23.98%	0.28%	11.46%	0.13%	12.52%	0.15%
自基金合同生效起至今	25.13%	0.28%	16.58%	0.13%	8.55%	0.15%

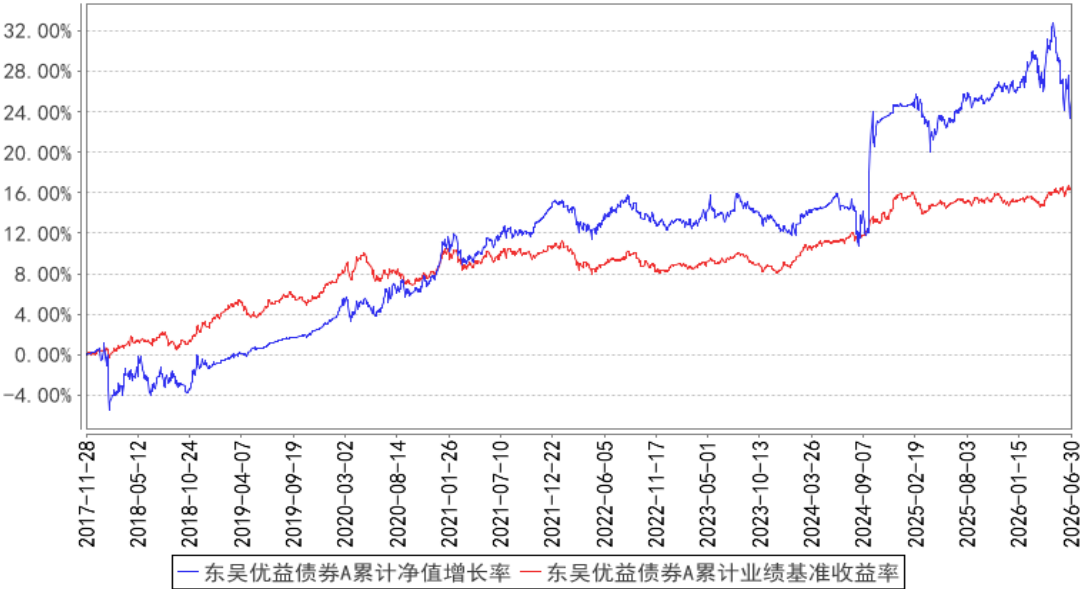
东吴优益债券 C

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	-1.37%	0.65%	1.63%	0.14%	-3.00%	0.51%
过去六个月	-0.87%	0.54%	1.32%	0.13%	-2.19%	0.41%
过去一年	0.46%	0.39%	1.69%	0.11%	-1.23%	0.28%
过去三年	9.14%	0.36%	6.96%	0.12%	2.18%	0.24%
过去五年	9.88%	0.30%	6.46%	0.12%	3.42%	0.18%
过去七年	20.54%	0.28%	11.46%	0.13%	9.08%	0.15%
自基金合同生效起	20.96%	0.28%	16.58%	0.13%	4.38%	0.15%

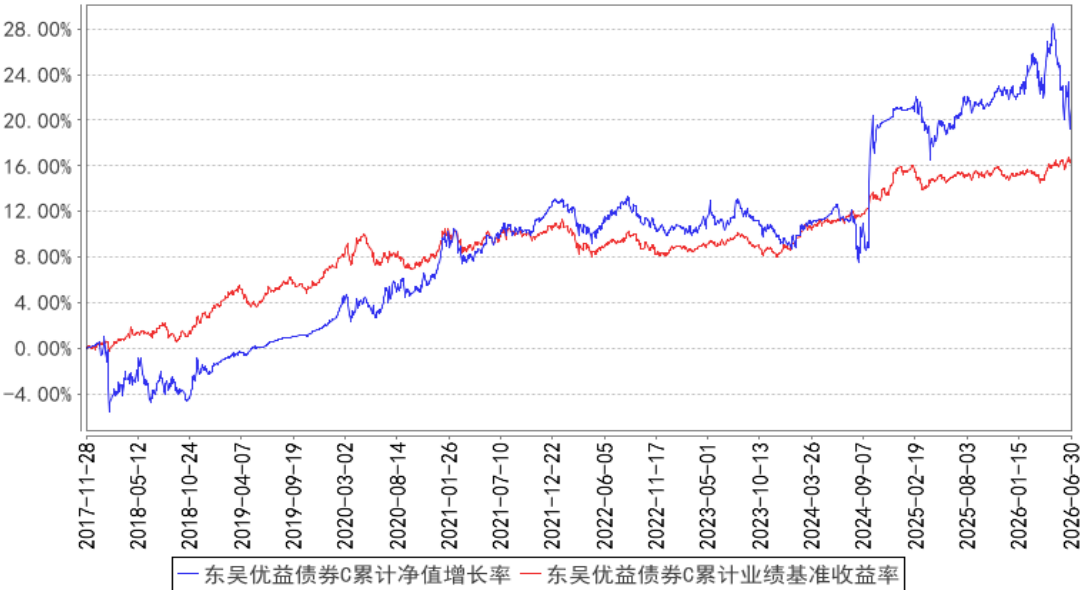
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

东吴优益债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴优益债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
周健	基金经理	2022 年 12 月 30 日	-	19 年	周健先生，中国国籍，南开大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职海通证券股份有限公司研究所金融工程分析师。2011 年 5 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2012 年 10 月 27 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月 11 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 3 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月 16 日至 2022 年 8 月 17 日担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至 2022 年 12 月 30 日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至 2023 年 5 月 24 日担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金（原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF））基金经理，2012 年 5 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理，2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 30 日至今担任东吴优益债券型证券投资基金基金

					经理，2024 年 6 月 18 日至今担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 7 月 15 日至今担任东吴裕盈平衡混合型证券投资基金基金经理。
杜澄楷	固定收益总部副总经理（主持工作）兼固收投资部总经理、基金经理	2024 年 4 月 10 日	-	17 年	杜澄楷先生，中国国籍，厦门大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职红塔证券股份有限公司研究员、金融工程师、投资经理、投资主管；东吴证券股份有限公司债券投资部。2023 年 8 月加入东吴基金管理有限公司，现任固定收益总部副总经理（主持工作）兼固收投资部总经理、基金经理。2023 年 10 月 26 日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 4 月 10 日至今担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2024 年 8 月 1 日至今担任东吴恒益纯债债券型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月 30 日至今担任东吴优利债券型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 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

2026 年上半年，债券市场整体震荡分化。年初春季躁动，债市在股债跷跷板下快速上行，随后权益降温、央行降息，债市修复下行。2 月末外部冲突引发避险情绪，收益率快速下行，但封锁霍尔木兹海峡推升油价，通胀预期下收益率回升，30Y 国债上行约 15BP。二季度震荡下行，4 月经济数据超预期后收益率继续下降，5 月央行强调流动性充裕，6 月 PMI 重返扩张区间、央行回笼流动性，债市回归震荡。上半年政府债券供给偏慢，机构配置资金充裕，票息资产缺乏，信用债整体表现强于利率债，信用利差持续压缩，利率曲线走陡。（数据来源：wind）

权益市场上半年震荡上行。今年春季躁动前置，自 12 月中下旬至 1 月中上旬，A 股走出 16 连阳，随后权益降温市场急跌。美联储主席提名，美元反弹，权益进入震荡。2 月末外部冲突，权益在两会预期下展现韧性，表现强于日韩欧洲。冲突焦灼引发通胀预期，权益震荡调整。二季度震荡上行，4 月经济数据超预期市场走强，5 月北向资金流入推动回升，6 月 PMI 重返扩张但贸易谈判放缓、政策预期增强，风险偏好收敛，外围波动加剧，权益震荡调整。整体表现趋稳，热点板块持续躁动，市场情绪修复。

本报告期内，本产品以长期收益为首要目标，通过投资范围内投资品种的风险收益比，借助投资品种风格的轮动灵活调整组合，致力优化风险收益结构。以固定收益类产品作为基础的底仓，构建安全垫，并适时进行权益仓位的灵活调整配置，采用股债两个大类品种的负相关性对冲力争减低组合收益率的波动性，由通过权益仓位在风险可控的基础上努力追求超过固定收益类产品的收益率。对组合的债券配置主要是通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整投资组合，严控投资组合信用风险，控制组合债券久期，持续优化组合债券配置，通过信用挖掘在防范风险的前提下努力提升组合静态收益，力求获得与风险匹配的投资收益。方法上是通过信用阿尔法增强策略及久期动态平衡策略构建基准收益安全垫。权益仓位以红利、科技及周期作为主要的配置方向，整体以均衡配置为主。

上半年，本产品根据市场情况及时调整股、债比例及具体持仓标的，致力保持持仓的分散性和产品的高流动性。一季度权益市场行情演绎比较极致，节奏特征突出，市场逻辑变化明显，我

们根据市场情况及时调整股、债比例及具体持仓标的，债券以票息为主加适当波段，股票持仓以行业景气度高、公司质地好的标的为主，适当轮动。二季度根据市场变化灵活调整组合配置，债券方面随着资金波动进入区间震荡，产品根据申赎情况对组合进行部分调仓；权益方面在市场震荡上行过程中适时调整权益仓位，努力把握市场机会，在热点板块中寻找配置机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴优益债券 A 的基金份额净值为 1.1808 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.76%，同期业绩比较基准收益率为 1.32%；截至本报告期末东吴优益债券 C 的基金份额净值为 1.1524 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.87%，同期业绩比较基准收益率为 1.32%。

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 2026 年下半年，从宏观角度观察，经济或呈现“K 型”复苏特征，新旧动能转换可能仍处于换挡期。消费对经济的拉动作用或持续有效，地产市场可能处于止跌回稳阶段，出口在关税延期下有望持续增长。通胀指标或将延续低位震荡，呈现名义低通胀、实际高利率的特征，基本面弱复苏可能持续。当前制造业 PMI 重返扩张区间，显示经济活力有所恢复，但需关注后续持续性。

未来债市整体可能仍长期处于低利率、低利差、高波动的环境，后续利率震荡特征或比较明显。操作思路或需从趋势转向结构，票息策略和品种选择可能更为关键，对波段及轮动操作要更加注重。下半年需关注政府债券供给节奏、央行货币政策取向、经济数据变化等因素对债市的影响。信用债方面，在票息资产缺乏的环境下，信用利差压缩空间或有限，需关注信用风险事件可能对市场的冲击。

经济增长有望逐步回稳，结构失衡的状况或有所改善。权益市场在无风险利率低位运行、基本面边际改善、估值在业绩盈利兑现支撑之下，有望带动资本市场上行的积极因素逐渐释放。具体来看，2026 年下半年权益市场结构性的投资机会有望增加，包括红利资产、科技创新、出口出海链、周期性资源类等，或有望继续均衡向上。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、督察长、分管固定收益总部和专户投资总部的公司副总经理、投研部门（包括但不限于权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、

权益研究部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，公司总经理担任基金资产估值委员会主席，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

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

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人已上报中国证监会并采取适当措施。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的情形。

本报告期内，本基金于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等各类固定费用由基金管理人承担。

§ 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

本报告期内，基金托管人在东吴优益债券型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遵规守信、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优益债券型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优益债券型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：东吴优益债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	58,604.59	31,185.24
结算备付金		232,917.71	69,001.61
存出保证金		11,711.76	4,630.06
交易性金融资产	6.4.7.2	8,917,704.42	4,788,355.40
其中：股票投资		2,260,409.00	173,539.00
基金投资		-	-
债券投资		6,657,295.42	4,614,816.40
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	-	-13.70
应收清算款		101,797.47	-
应收股利		-	-
应收申购款		83,824.15	12,779.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		9,406,560.10	4,905,937.76
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
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		981,000.00	-
应付清算款		2,856.57	1,854.21
应付赎回款		279,349.17	41,478.27

应付管理人报酬		3,146.16	5,111.46
应付托管费		786.55	1,277.85
应付销售服务费		1,447.64	723.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		255.75	435.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	6,025.84	5,941.26
负债合计		1,274,867.68	56,821.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,040,964.02	4,152,458.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,090,728.40	696,657.73
净资产合计		8,131,692.42	4,849,116.17
负债和净资产总计		9,406,560.10	4,905,937.76

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 7,040,964.02 份，其中东吴优益债券 A 的基金份额净值 1.1808 元，基金份额总额 616,106.99 份；东吴优益债券 C 的基金份额净值 1.1524 元，基金份额总额 6,424,857.03 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴优益债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-205,496.36	-308,517.61
1. 利息收入		2,994.76	40,540.12
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,583.06	3,347.93
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		411.70	37,192.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-135,590.95	-441,964.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-242,545.15	-762,187.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	80,609.03	304,423.04
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			

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	26,345.17	15,800.00
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）	6.4.7.15	-80,023.90	89,413.98
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	7,123.73	3,492.91
减：二、营业总支出		47,168.65	132,249.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,879.11	80,752.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,469.82	20,188.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,020.38	18,688.99
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		9,563.86	10,822.34
其中：卖出回购金融资产支出		9,563.86	10,822.34
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		195.48	163.99
8. 其他费用	6.4.7.18	40.00	1,633.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-252,665.01	-440,767.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-252,665.01	-440,767.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-252,665.01	-440,767.55

6.3 净资产变动表

会计主体：东吴优益债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,152,458.44	-	696,657.73	4,849,116.17

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,152,458.44	-	696,657.73	4,849,116.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,888,505.58	-	394,070.67	3,282,576.25
(一)、综合收益总额	-	-	-252,665.01	-252,665.01
(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)	2,888,505.58	-	646,735.68	3,535,241.26
其中：1. 基金申购款	33,834,050.64	-	6,634,537.58	40,468,588.22
2. 基金赎回款	-30,945,545.06	-	-5,987,801.90	-36,933,346.96
(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	7,040,964.02	-	1,090,728.40	8,131,692.42
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	65,365,875.76	-	10,431,380.77	75,797,256.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	65,365,875.76	-	10,431,380.77	75,797,256.53

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-43,563,096.97	-	-6,778,432.71	-50,341,529.68
(一)、综合收益总额	-	-	-440,767.55	-440,767.55
(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)	-43,563,096.97	-	-6,337,665.16	-49,900,762.13
其中：1. 基金申购款	8,747,529.01	-	1,343,594.16	10,091,123.17
2. 基金赎回款	-52,310,625.98	-	-7,681,259.32	-59,991,885.30
(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	21,802,778.79	-	3,652,948.06	25,455,726.85

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

李素明

骆银

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴优益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1515 号文《关于准予东吴优益债券型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，《东吴优益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）于 2017 年 11 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 409,477,237.82 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。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、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、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于人民币 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2026 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的

国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	58,604.59
等于：本金	58,597.35
加：应计利息	7.24
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	58,604.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,383,319.58	-	2,260,409.00	-122,910.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,604,153.45	44,185.42	6,657,295.42	8,956.55
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,604,153.45	44,185.42	6,657,295.42	8,956.55
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,987,473.03	44,185.42	8,917,704.42	-113,954.03

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30.14
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	5,995.70
其中：交易所市场	5,995.70
银行间市场	-
应付利息	-
合计	6,025.84

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴优益债券 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	803,593.96	803,593.96
本期申购	518,756.03	518,756.03
本期赎回（以“-”号填列）	-706,243.00	-706,243.00
本期末	616,106.99	616,106.99

东吴优益债券 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,348,864.48	3,348,864.48
本期申购	33,315,294.61	33,315,294.61
本期赎回（以“-”号填列）	-30,239,302.06	-30,239,302.06
本期末	6,424,857.03	6,424,857.03

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

东吴优益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,097.89	16,520.91	152,618.80
本期期初	136,097.89	16,520.91	152,618.80
本期利润	6,750.59	-17,044.69	-10,294.10
本期基金份额交易产生的变动数	-39,723.96	8,801.97	-30,921.99
其中：基金申购款	108,961.93	4,332.42	113,294.35
基金赎回款	-148,685.89	4,469.55	-144,216.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	103,124.52	8,278.19	111,402.71

东吴优益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	476,624.91	67,414.02	544,038.93
本期期初	476,624.91	67,414.02	544,038.93
本期利润	-179,391.70	-62,979.21	-242,370.91

本期基金份额交易产生的变动数	597,438.38	80,219.29	677,657.67
其中：基金申购款	5,671,408.45	849,834.78	6,521,243.23
基金赎回款	-5,073,970.07	-769,615.49	-5,843,585.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	894,671.59	84,654.10	979,325.69

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,214.74
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	353.40
其他	14.92
合计	2,583.06

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-242,545.15
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	-242,545.15

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,246,517.60
减：卖出股票成本总额	10,472,383.52
减：交易费用	16,679.23
买卖股票差价收入	-242,545.15

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	61,133.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	19,475.11

券到期兑付) 差价收入	
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	80,609.03

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,203,051.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,046,366.91
减：应计利息总额	137,203.56
减：交易费用	5.73
买卖债券差价收入	19,475.11

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

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	26,345.17
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	26,345.17

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-80,023.90
股票投资	-121,747.91
债券投资	41,724.01
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	-
合计	-80,023.90

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,735.03
基金转换费收入	388.70
合计	7,123.73

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划费	40.00
合计	40.00

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、关联关系

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、基金销售机构
东吴证券股份有限公司（“东吴证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	22,927,519.03	100.00	14,046,335.00	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	54,086,359.68	100.00	91,770,894.48	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	131,184,000.00	100.00	271,777,000.00	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30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	10,085.68	100.00	5,995.70	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30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	6,192.76	100.00	2,655.94	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。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,879.11	80,752.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,991.91	10,235.33
应支付基金管理人的净管理费	12,887.20	70,517.20

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,469.82	20,188.14

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴优益债券 A	东吴优益债券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	4,130.44	4,130.44
东吴基金管理有限公司	-	10.43	10.43
东吴证券	-	42.91	42.91
合计	-	4,183.78	4,183.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴优益债券 A	东吴优益债券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	22.94	22.94
东吴证券	-	-	-
东吴基金管理有限公司	-	7,967.99	7,967.99
合计	-	7,990.93	7,990.93

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.2%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额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，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	58,604.59	2,214.74	37,717.32	2,182.63

注：本基金的银行存款由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

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分固定费用，如审计费。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、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、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资目标为在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。

基于该投资目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	907,838.93	1,907,841.83
合计	907,838.93	1,907,841.83

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	141,014.52
未评级	5,749,456.49	2,565,960.05

合计	5,749,456.49	2,706,974.57
----	--------------	--------------

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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	58,604.59	-	-	-	58,604.59
结算备付金	232,917.71	-	-	-	232,917.71
存出保证金	11,711.76	-	-	-	11,711.76
交易性金融资产	907,838.93	5,749,456.49	-	2,260,409.00	8,917,704.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	101,797.47	101,797.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	83,824.15	83,824.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,211,072.99	5,749,456.49	-	2,446,030.62	9,406,560.10
负债					
卖出回购金融资产款	981,000.00	-	-	-	981,000.00
应付清算款	-	-	-	2,856.57	2,856.57
应付赎回款	-	-	-	279,349.17	279,349.17
应付管理人报酬	-	-	-	3,146.16	3,146.16
应付托管费	-	-	-	786.55	786.55
应付销售服务费	-	-	-	1,447.64	1,447.64
应交税费	-	-	-	255.75	255.75
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,025.84	6,025.84
负债总计	981,000.00	-	-	293,867.68	1,274,867.68
利率敏感度缺口	230,072.99	5,749,456.49	-	2,152,162.94	8,131,692.42
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	31,185.24	-	-	-	31,185.24
结算备付金	69,001.61	-	-	-	69,001.61
存出保证金	4,630.06	-	-	-	4,630.06
交易性金融资产	1,907,841.83	1,345,670.13	1,361,304.44	173,539.00	4,788,355.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-13.70	-	-	-	-13.70
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	12,779.15	12,779.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,012,645.04	1,345,670.13	1,361,304.44	186,318.15	4,905,937.76

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,854.21	1,854.21
应付赎回款	-	-	-	41,478.27	41,478.27
应付管理人报酬	-	-	-	5,111.46	5,111.46
应付托管费	-	-	-	1,277.85	1,277.85
应付销售服务费	-	-	-	723.53	723.53
应交税费	-	-	-	435.01	435.01
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,941.26	5,941.26
负债总计	-	-	-	56,821.59	56,821.59
利率敏感度缺口	2,012,645.04	1,345,670.13	1,361,304.44	129,496.56	4,849,116.17

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	26,895.51	88,921.12
	基准利率增加 25 个基点	-26,692.29	-84,358.78

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

本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，并通过投资组合的分散化降低其他价格风险。上年度末，本基金持有的交易性权益投资公允价值占基金资产净值的比例小于 10%，因此上年度末除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基

金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	2,260,409.00	27.80	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	2,260,409.00	27.80	—	—

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1%	-227,687.39	—
	2. 业绩基准下跌 5%	-1,138,436.94	—

	3. 业绩基准下跌 10%	-2, 276, 873. 88	-
--	------------------	------------------	---

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 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到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2, 260, 409. 00	314, 553. 52
第二层次	6, 657, 295. 42	4, 473, 801. 88
第三层次	-	-
合计	8, 917, 704. 42	4, 788, 355. 40

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31

日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表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	2,260,409.00	24.03
	其中：股票	2,260,409.00	24.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,657,295.42	70.77
	其中：债券	6,657,295.42	70.77
	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	291,522.30	3.10
8	其他各项资产	197,333.38	2.10
9	合计	9,406,560.10	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

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	505,494.00	6.22
C	制造业	1,606,459.00	19.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,456.00	1.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,260,409.00	27.80

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港股通股票。

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

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	603993	洛阳钼业	17,200	301,860.00	3.71
2	603659	璞泰来	7,200	208,296.00	2.56
3	601899	紫金矿业	8,100	203,634.00	2.50
4	002407	多氟多	3,500	175,805.00	2.16
5	300750	宁德时代	400	157,204.00	1.93
6	002709	天赐材料	3,000	154,290.00	1.90
7	688521	芯原股份	400	148,456.00	1.83
8	002460	赣锋锂业	2,000	130,800.00	1.61
9	603119	浙江荣泰	1,950	129,363.00	1.59
10	603179	新泉股份	2,100	104,265.00	1.28
11	000700	模塑科技	7,000	103,320.00	1.27
12	002240	盛新锂能	2,000	89,660.00	1.10
13	601689	拓普集团	1,500	84,630.00	1.04
14	600309	万华化学	1,200	82,092.00	1.01
15	002812	恩捷股份	1,000	66,910.00	0.82
16	000333	美的集团	400	30,212.00	0.37
17	000792	盐湖股份	900	27,171.00	0.33
18	600989	宝丰能源	900	18,297.00	0.23
19	600096	云天化	500	15,200.00	0.19
20	600690	海尔智家	500	10,205.00	0.13
21	600426	华鲁恒升	300	7,176.00	0.09
22	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.07
23	002756	永兴材料	100	5,664.00	0.07

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

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	000157	中联重科	641,710.00	13.23
2	600096	云天化	595,760.00	12.29
3	300750	宁德时代	539,452.00	11.12
4	002379	宏桥控股	514,138.00	10.60
5	002812	恩捷股份	514,077.00	10.60
6	600426	华鲁恒升	482,387.00	9.95
7	300308	中际旭创	446,897.00	9.22
8	301358	湖南裕能	444,705.00	9.17
9	603993	洛阳钼业	421,824.00	8.70
10	600176	中国巨石	392,528.00	8.09
11	002709	天赐材料	371,940.00	7.67
12	603659	璞泰来	370,327.00	7.64
13	000333	美的集团	345,833.00	7.13
14	002756	永兴材料	334,536.00	6.90
15	300502	新易盛	278,864.00	5.75
16	601899	紫金矿业	278,559.00	5.74
17	300274	阳光电源	235,864.00	4.86
18	600309	万华化学	228,442.00	4.71
19	000700	模塑科技	228,340.00	4.71
20	600989	宝丰能源	226,112.00	4.66
21	600690	海尔智家	225,254.00	4.65
22	002738	中矿资源	217,760.00	4.49
23	600406	国电南瑞	215,700.00	4.45
24	002938	鹏鼎控股	212,397.00	4.38
25	002335	科华数据	210,120.00	4.33
26	002271	东方雨虹	202,560.00	4.18
27	603186	华正新材	195,742.00	4.04
28	603119	浙江荣泰	176,500.00	3.64
29	002460	赣锋锂业	168,610.00	3.48
30	600584	长电科技	162,754.00	3.36
31	603259	药明康德	142,791.00	2.94
32	688411	海博思创	136,827.75	2.82
33	600268	国电南自	133,040.00	2.74
34	600761	安徽合力	128,961.00	2.66
35	002407	多氟多	124,020.00	2.56
36	002837	英维克	120,810.00	2.49
37	688353	华盛锂电	117,580.00	2.42
38	000636	风华高科	116,052.00	2.39

39	600141	兴发集团	115,010.00	2.37
40	002772	众兴菌业	113,922.00	2.35
41	300731	科创新源	110,066.00	2.27
42	688521	芯原股份	105,596.00	2.18
43	300014	亿纬锂能	103,271.00	2.13
44	603179	新泉股份	100,494.00	2.07
45	002240	盛新锂能	99,054.00	2.04
46	000683	博源化工	98,680.00	2.04

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

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	300308	中际旭创	629,280.00	12.98
2	000157	中联重科	545,756.00	11.25
3	600176	中国巨石	525,668.00	10.84
4	002812	恩捷股份	471,497.00	9.72
5	301358	湖南裕能	467,178.00	9.63
6	600096	云天化	452,720.00	9.34
7	002379	宏桥控股	450,938.00	9.30
8	300750	宁德时代	435,280.00	8.98
9	600426	华鲁恒升	373,110.00	7.69
10	300502	新易盛	371,199.00	7.65
11	000333	美的集团	354,049.00	7.30
12	002756	永兴材料	306,225.00	6.32
13	002709	天赐材料	251,506.00	5.19
14	002938	鹏鼎控股	243,400.00	5.02
15	600690	海尔智家	215,075.00	4.44
16	600406	国电南瑞	200,912.00	4.14
17	603186	华正新材	198,345.00	4.09
18	002738	中矿资源	189,947.00	3.92
19	300274	阳光电源	189,770.00	3.91
20	002335	科华数据	174,600.00	3.60
21	600989	宝丰能源	155,794.00	3.21
22	002271	东方雨虹	152,760.00	3.15
23	603259	药明康德	150,735.00	3.11
24	600584	长电科技	149,578.00	3.08
25	603659	璞泰来	144,150.00	2.97
26	002837	英维克	127,792.00	2.64
27	600268	国电南自	122,880.00	2.53
28	688411	海博思创	118,350.00	2.44

29	000700	模塑科技	116,300.00	2.40
30	002772	众兴菌业	114,286.00	2.36
31	300731	科创新源	112,665.00	2.32
32	600309	万华化学	111,430.00	2.30
33	600141	兴发集团	111,090.00	2.29
34	300014	亿纬锂能	108,570.00	2.24
35	600761	安徽合力	105,060.00	2.17

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	12,681,001.43
卖出股票收入（成交）总额	10,246,517.60

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	6,657,295.42	81.87
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	6,657,295.42	81.87

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	019832	26 国债 06	26,000	2,612,524.16	32.13
2	019797	25 国债 24	25,000	2,523,443.84	31.03
3	019786	25 国债 14	6,000	613,488.49	7.54
4	019792	25 国债 19	5,000	505,246.16	6.21
5	019827	26 国债 01	4,000	402,592.77	4.95

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.11.3 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	11,711.76
2	应收清算款	101,797.47
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	83,824.15
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	197,333.38

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
东吴优益债券 A	156	3,949.40	0.00	0.00	616,106.99	100.00
东吴优益债券 C	1,216	5,283.60	41,918.34	0.65	6,382,938.69	99.35
合计	1,372	5,131.90	41,918.34	0.60	6,999,045.68	99.40

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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	东吴优益债券 A	94,535.93	15.3441
	东吴优益债券 C	1,121.02	0.0174
	合计	95,656.95	1.3586

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东吴优益债券 A	0~10
	东吴优益债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴优益债券 A	0~10
	东吴优益债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴优益债券 A	东吴优益债券 C
基金合同生效日 (2017 年 11 月 28 日) 基金份额总额	61,255,499.28	348,221,738.54
本报告期期初基金份额总额	803,593.96	3,348,864.48
本报告期基金总申购份额	518,756.03	33,315,294.61
减：本报告期基金总赎回份额	706,243.00	30,239,302.06
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	616,106.99	6,424,857.03

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人发生以下人事变动：

2026 年 2 月 3 日经东吴基金管理有限公司第五届董事会第三次会议审议通过，聘任葛锋先生为东吴基金管理有限公司常务副总经理，聘任夏志凡先生为东吴基金管理有限公司副总经理，李杰先生不再担任东吴基金管理有限公司副总经理职务。

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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	22,927,519.03	100.00	10,085.68	100.00	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、证券公司的选择标准：

- (1) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 在交易、研究业务方面最近二年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为受到行政处罚或者刑事处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (6) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足代理基金进行证券交易的需要；
- (7) 有固定的研究机构和专业的研究人员，有较强的研究能力，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务。

2、证券公司的选择程序：

- (1) 管理人根据以上标准进行评估后甄选证券公司，并开展尽职调查。
- (2) 进入内部评估流程，经投资决策委员会审批后将所选证券公司纳入白名单。
- (3) 对于白名单内符合条件的证券公司，管理人与其签定协议。

3、报告期内证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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

10.7.2 基金租用或者通过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	54,086,359.68	100.00	131,184,000.00	100.00	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳腾元基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 1 月 14 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 1 月 16 日
3	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2026 年 1 月 22 日

		报、公司网站、中证信息网站	
4	东吴优益债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2026 年 1 月 22 日
5	东吴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2026 年 2 月 14 日
6	东吴基金管理有限公司关于参加华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、中证信息网站	2026 年 2 月 25 日
7	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 3 月 27 日
8	东吴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	公司网站、中证信息网站	2026 年 3 月 31 日
9	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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、中证信息网站	2026 年 3 月 31 日
10	东吴优益债券型证券投资基金 2025 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2026 年 3 月 31 日
11	东吴基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 4 月 22 日
12	东吴优益债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2026 年 4 月 22 日
13	2025 年度东吴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站、中证信息网站	2026 年 4 月 30 日
14	东吴基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	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	2026 年 5 月 22 日
15	东吴基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	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	2026 年 6 月 1 日
16	东吴基金管理有限公司关于终止深圳	中国证券报、上海证券	2026 年 6 月 16 日

	市金海九州基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
17	东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金转换业务补差费用计算方法的公告	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	2026 年 6 月 22 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	20260310-20260415	0.00	8,397,010.66	8,397,010.66	0.00	0.00
	2	20260310-20260416	0.00	8,397,010.66	8,397,010.66	0.00	0.00
个人	1	20260101-20260211	868,130.91	0.00	868,130.91	0.00	0.00

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、中国证监会批准东吴优益债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴优益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴优益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、报告期内东吴优益债券型证券投资基金在中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666/400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日