# 东吴优利债券型证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东吴优利债券 |
| 基金主代码 | 026831 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2026 年 4 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 308,699,094.12 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | （一）资产配置策略<br>（二）债券投资策略<br>1、利率策略与久期管理<br>2、信用债券投资策略<br>3、类属配置策略<br>4、可转换债券/可交换债券投资策略<br>（三）股票投资策略<br>1、A 股投资策略<br>2、港股通标的股票投资策略<br>3、存托凭证投资策略<br>（四）国债期货投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%+活期存款基准利率*3% |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金，理论上其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。<br>本基金投资于港股通标的股票时，会面临港股通机制下 |

| | | |
|---|---|---|
| | 因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 东吴基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东吴优利债券 A | 东吴优利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 026831 | 026832 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 141,723,373.83 份 | 166,975,720.29 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 东吴优利债券 A | 东吴优利债券 C |
| 1.本期已实现收益 | -1,374,849.23 | -1,678,841.02 |
| 2.本期利润 | -4,346,120.43 | -5,257,831.96 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0277 | -0.0293 |
| 4.期末基金资产净值 | 136,634,774.94 | 160,845,773.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9641 | 0.9633 |

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金基金合同生效日为 2026 年 4 月 30 日，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

## 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

东吴优利债券 A

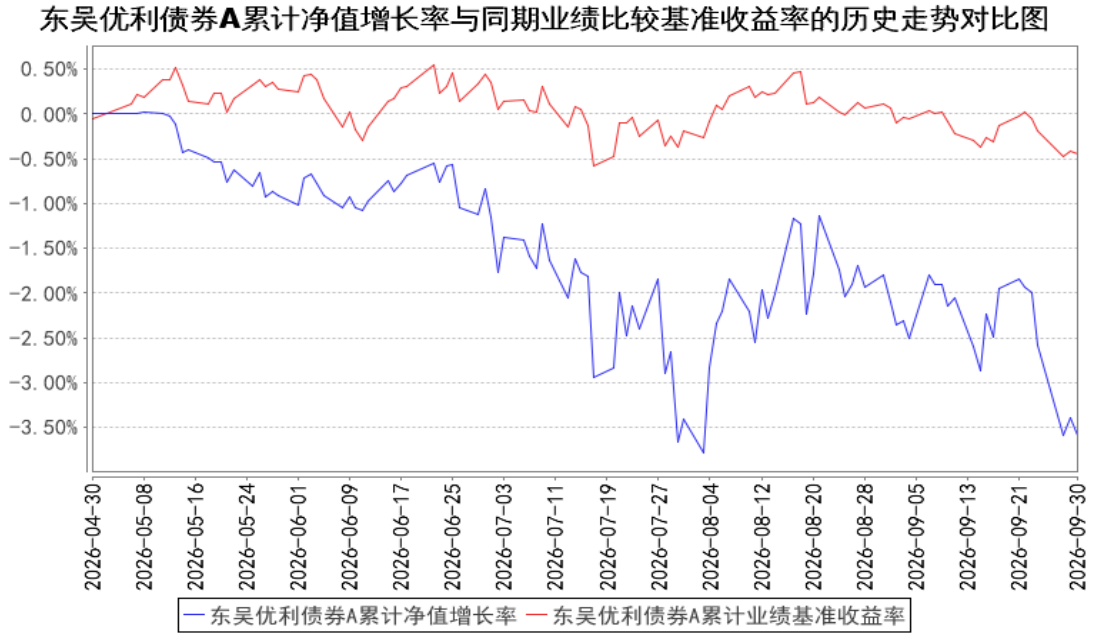
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -2.78% | 0.49% | -0.89% | 0.15% | -1.89% | 0.34% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.59% | 0.40% | -0.45% | 0.16% | -3.14% | 0.24% |

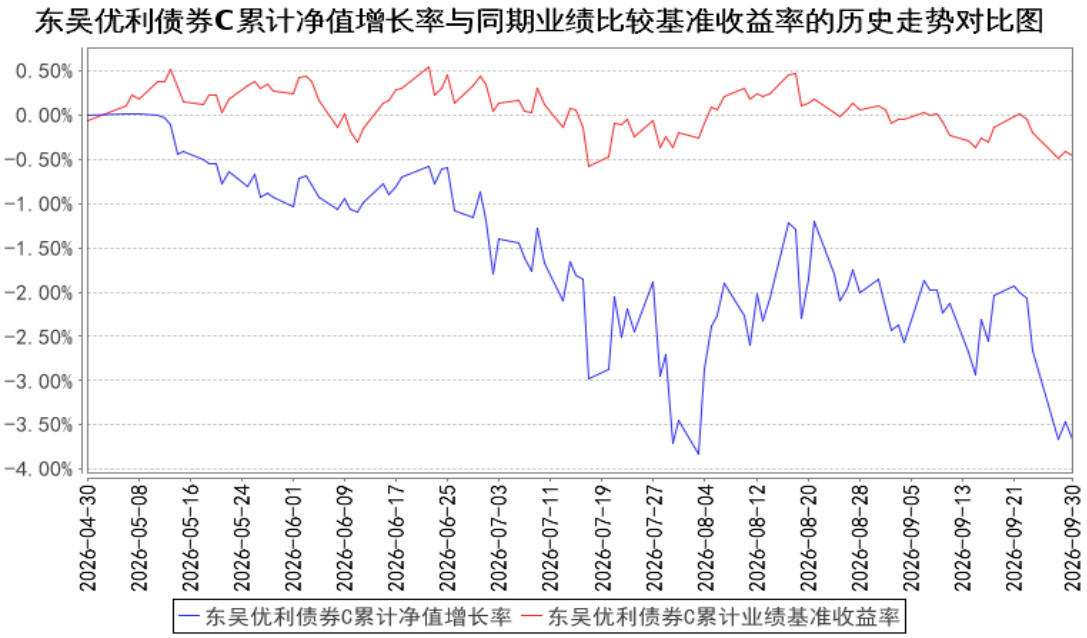
东吴优利债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -2.83% | 0.49% | -0.89% | 0.15% | -1.94% | 0.34% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.67% | 0.40% | -0.45% | 0.16% | -3.22% | 0.24% |

注：本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较






注：1、本基金基金合同生效日为 2026 年 4 月 30 日，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | 2026 年 4 月 30 日 | - | 18 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。 |
| 刘瑞 | 权益投资总部总经理、基金 | 2026 年 5 月 26 日 | - | 14 年 | 刘瑞先生，中国国籍，美国哥伦比亚大学计算机科学与技术硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职国泰君安期货投资经 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 经理 | | | | 理助理；上海陆宝投资管理有限公司投资经理；嘉实基金管理有限公司策略研究员。2018 年 1 月加入东吴基金管理有限公司，现任权益投资总部总经理、基金经理。2018 年 11 月 20 日至 2020 年 12 月 16 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，2018 年 11 月 20 日至 2020 年 12 月 16 日担任东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 29 日至 2022 年 12 月 30 日担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 3 月 8 日至今担任东吴新产业精选股票型证券投资基金(原东吴新产业精选混合型证券投资基金）基金经理，2023 年 12 月 25 日至今担任东吴兴享成长混合型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月 25 日至今担任东吴兴弘一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2026 年 5 月 26 日至今担任东吴优利债券型证券投资基金基金经理，2026 年 8 月 25 日至今担任东吴瑞欣债券型证券投资基金。 |

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。

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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|---|---|---|---|---|
| 刘瑞 | 公募基金 | 5 | 2,496,908,387.75 | 2018 年 3 月 8 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 1,570,374,912.11 | 2026 年 2 月 27 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 6 | 4,067,283,299.86 | - |

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，债券市场整体呈现震荡走强态势，收益率低位运行、曲线平坦化。7 月初，受部分经济数据阶段性企稳及机构止盈影响，10 年期国债收益率在 1.74%附近中枢窄幅波动，月末在机构做多期货、宽货币预期推动下有所下行。8 月，国内消费和投资修复节奏放缓、实体经济融资需求偏弱，“资产荒”格局延续，叠加央行货币政策维持适度宽松、流动性总体合理充裕，10 年期国债收益率先行下破 1.70%，随后始终保持在低位运行。9 月，在基本面偏弱、宽松预期与政府债供给压力显现、资金面阶段性收敛、外部利率约束等多重因素拉锯下，10 年期国债收益率中枢进一步下移至 1.68%附近小幅震荡（数据来源为 Wind）。三季度长短端收益率走势显著分化，短端受资金面和银行负债端压力制约有所上行，长端震荡下行，期限利差明显收窄、曲线平坦化。信用债方面，三季度收益率整体下行、信用利差压缩至历史相对低位，长端及中低等级品种调整后估值吸引力提升，城投债整体平稳、区域表现分化，科创债延续扩容，摊余成本法债基与理财扩容带来增量配置资金。

权益市场在经历了上半年的火热行情后，三季度迎来一轮阶段性调整。前期持续领跑的科技成长板块显著承压，资金从高景气、高估值方向逐步向红利、价值等相对低位方向寻找机会，市场交易热度出现退潮，日均成交额逐月缩量、两融余额自阶段高位回落，风险偏好整体收缩。从指数看，三季度主要指数震荡下行，科创 50、创业板指分别大幅回调，而大盘权重指数相对抗跌，上证指数、上证 50 跌幅相对较小。结构上看，科技成长在估值与交易拥挤度较高的背景下或成为资金兑现收益的方向，电子、通信等行业大幅调整；与此同时，红利、价值等防御性板块表现活

跃，煤炭、石油石化、银行、医药生物以及地产、消费等前期偏弱方向三季度表现较为突出，市场从高度集中的科技主线转向更广泛的风格再平衡与行业轮动。

三季度，可转债市场在权益回调与自身高估值约束下整体走弱、估值持续消化。期间权益市场随海外流动性收紧预期和风险偏好回落而震荡下行，转债在正股下跌与前期高溢价的共同作用下，估值压缩幅度一度大于正股，债底保护作用未能充分发挥。从估值看，三季度转债百元平价溢价率明显回落，全市场价格中位数降至 130 元附近关键支撑位，整体仍处历史相对偏高区间，估值压力持续消化。结构上，中高评级、高价转债相对偏弱，偏债、低价品种相对抗跌，科技相关弹性个券波动放大；供给端新券发行节奏有所提速，一定程度上缓解了供需偏紧格局。整体来看，转债市场呈现估值压缩、成交缩量、结构性机会并存的特征。

本报告期内，本产品以追求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，借助资产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，致力采用股债两个大类品种的负相关性对冲来减低组合收益率的波动性，通过权益仓位在风险可控的基础上追求超过固定收益类产品的收益率。对固定收益类资产组合的底仓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，控制组合久期，持续优化组合配置，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。

在操作上，三季度本产品根据市场变化灵活调整组合配置。债券方面，考虑到收益率整体处于历史相对低位、曲线平坦化且波动加大，产品在控制久期和杠杆的基础上，适度参与超长端及中高等级品种的相对价值机会，并结合申赎情况和资金面变化对持仓进行了灵活调仓。

回顾 2026 年三季度，国内权益市场的波动与海外市场类似，相比上半年有所放大，期间，以 AI 为代表的科技成长方向股价调整幅度较大。我们的产品在科技成长方向配置较多，业绩表现在三季度也因此受到拖累。

回顾三季度，实际上，我们可以观察到一个事实，海外市场代表科技创新的纳斯达克指数在 7 月份调整后又创了历史新高，其中的 AI 芯片设计和晶圆制造龙头公司股价也都在同期创了历史新高。不仅美股，台湾加权指数也在 AI 相关公司股价的强势驱动下创了历史新高，日经 225 指数成分中的 AI 相关公司股价表现也大体较为强势。

在上述背景下，我们倾向于认为，国内以 AI 为代表的科技龙头公司在此期间股价显著弱于海外的原因或许是偏向于筹码因素，而非产业基本面因素。上半年在科技成长大幅跑赢价值风格的背景下，大量资金涌入成长方向，尤其是 6 月份。这批资金在 7 月成长方向的调整后，一直期待

能有所反弹，正是在这种一致预期之下，在缺乏增量资金的背景下，反弹迟迟未到。

向后展望，我们倾向于认为，以十年期美债收益率为代表的无风险收益率短期上行较快的时候可能已经见到了，这可能有利于为权益资产提供一个较为友好的窗口期。同时，我们关注到，海外的 AI 模型能力迭代速度并未放缓、以 MUSE 为代表的 AI 应用在不断迭代拓展、AI 供应链头部公司给出的未来中远期指引在不断上修，AI 的产业趋势可能并没有弱化。

基于上述分析，本报告期内，我们维持了在以 AI 为代表的科技成长方向相对较高的仓位水平，我们倾向于认为，在经过较长时间和幅度的充分调整后，当前行业头部公司的性价比或许已经较大幅度提升。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴优利债券 A 的基金份额净值为 0.9641 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.89%；截至本报告期末东吴优利债券 C 的基金份额净值为 0.9633 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.83%，同期业绩比较基准收益率为-0.89%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 48,144,141.53 | 15.02 |
| | 其中：股票 | 48,144,141.53 | 15.02 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 248,638,719.36 | 77.58 |
| | 其中：债券 | 248,638,719.36 | 77.58 |
| | 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 | 20,584,623.58 | 6.42 |
| 8 | 其他资产 | 3,108,359.23 | 0.97 |
| 9 | 合计 | 320,475,843.70 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,927,710.09 元，占净值比例

0.98%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,001,290.00 | 1.01 |
| C | 制造业 | 39,357,771.44 | 13.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 2,857,370.00 | 0.96 |
| 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 | 45,216,431.44 | 15.20 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 基础材料 | 12,172.40 | 0.00 |
| 消费者非必需品 | - | - |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | 2,915,537.69 | 0.98 |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | - | - |

| | | |
|---|---|---|
| 合计 | 2,927,710.09 | 0.98 |

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002475 | 立讯精密 | 176,291 | 8,714,064.13 | 2.93 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 9,500 | 7,680,180.00 | 2.58 |
| 3 | 688825 | 长鑫科技 | 102,703 | 5,627,097.37 | 1.89 |
| 4 | 300502 | 新易盛 | 13,900 | 5,407,100.00 | 1.82 |
| 5 | 688012 | 中微公司 | 16,905 | 5,385,087.75 | 1.81 |
| 6 | 688808 | 联讯仪器 | 2,113 | 3,268,029.19 | 1.10 |
| 7 | 002384 | 东山精密 | 18,500 | 3,096,900.00 | 1.04 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 99,800 | 2,973,042.00 | 1.00 |
| 9 | 00981 | 中芯国际 | 56,000 | 2,915,537.69 | 0.98 |
| 10 | 300033 | 同花顺 | 14,500 | 2,857,370.00 | 0.96 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 53,901,690.04 | 18.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 184,496,332.60 | 62.02 |
| | 其中：政策性金融债 | 143,737,687.67 | 48.32 |
| 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 | 10,240,696.72 | 3.44 |
| 10 | 合计 | 248,638,719.36 | 83.58 |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 240203 | 24 国开 03 | 800,000 | 82,770,082.19 | 27.82 |
| 2 | 240208 | 24 国开 08 | 400,000 | 40,615,890.41 | 13.65 |
| 3 | 019832 | 26 国债 06 | 232,000 | 23,377,909.04 | 7.86 |
| 4 | 220208 | 22 国开 08 | 200,000 | 20,351,715.07 | 6.84 |
| 5 | 232680035 | 26 成都农商行二级资本债 01 | 200,000 | 20,085,989.04 | 6.75 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金通过研究债券市场和国债期货市场运行特征，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的收益性、流动性及风险性特征情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | 19,951.58 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | - |

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。本基金运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，同时利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合整体风险的目的。

## 5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券中“26 成都农商行二级资本债 01（证券代码：232680035），23 农行二级资本债 01A（证券代码：232380004），25 农行二级资本债 01B(BC)（证券代码：232580017）”的发行主体在报告编制日前一年内受到监管部门的处罚。

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。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | 80,482.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,027,877.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,108,359.23 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东吴优利债券 A | 东吴优利债券 C |
| --- | --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 191,103,156.34 | 230,402,908.87 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,481.34 | 165,408.72 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 49,384,263.85 | 63,592,597.30 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 141,723,373.83 | 166,975,720.29 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴优利债券型证券投资基金设立的文件；

2、《东吴优利债券型证券投资基金基金合同》；

3、《东吴优利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、报告期内东吴优利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。

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：http：//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666/400-821-0588

**东吴基金管理有限公司**

2026 年 10 月 27 日