

# 东吴增鑫宝货币市场基金

## 更新招募说明书摘要

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

### 重要提示

本基金根据 2016 年 10 月 9 日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴增鑫宝货币市场基金募集的批复》（证监基金字【2016】2292 号）的注册募集,本基金的基金合同于 2016 年 11 月 7 日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《东吴增鑫宝货币市场基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险等等。本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

基金投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并自行承担投资风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年11月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(财务数据未经审计)。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区源深路279号(200135)

办公地址：上海市浦东新区源深路279号(200135)

法定代表人：王炯

设立日期：2004年9月2日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1亿元人民币

联系人：贾云鹏

电话：（021）50509888

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

公司网址：www.scfund.com.cn

#### 1、股权结构：

持股单位	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	70%
海澜集团有限公司	30%
合计	100%

#### 2、简要情况介绍：

公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司总经理下设权益投资决策、固收投资决策、专户投资决策、风险管理、基金资产估值五个专门委员会；公司设有权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、研究策划部、集中交易室、营销管理总部、产品策略部、信息技术部、基金事务部、综合管理部、合规风控部十一个部门。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

汤勇先生，董事，工商管理 EMBA，注册会计师，中共党员。任江苏悦达时装有限公司财务会计、新能（张家港）能源有限公司计财处主任，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

王炯先生，董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理、东吴证券上海分公司总经理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长、兼资产管理部总经理、总规划师，现任东吴证券股份有限公司副总裁。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

张婉苏女士，独立董事，经济法学博士。历任担任斯洛文尼亚道迈尔机电有限责任公司苏州代表处法律顾问、南京大学法学院助教、讲师，现任南京大学法学院副教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

方志刚先生，独立董事，大学学历，民建会员。企业类会计师、中国注册会计师、澳洲注册会计师。历任上海上审会计师事务所审计员、部门经理，上海长信会计师事务所部

门经理，上海锦江国旅股份有限公司财务部经理、上海实业联合集团长城药业有限公司财务总监；上海众华沪银会计师事务所高级经理，现任瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所工作，权益合伙人，兼任长方集团股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

张剑宏先生，监事会主席，硕士。历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险管理部、合规法务部总经理、合规总监兼首席风险官，现任东吴证券股份有限公司首席风险官。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵女士，员工监事，硕士研究生，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，监察稽核部总经理，现任合规风控副总监兼合规风控部总经理，董事会秘书。

## 3、高管人员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

王炯先生，董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理、东吴证券上海分公司总经理，东吴基金管理有限公司常务副总经理，现任东吴基金管理有限公司总经理。

徐明先生，副总经理，硕士，中共党员。历任中国银行苏州分行营业部会计；苏州华纺经济贸易有限公司财务科会计；中创证券有限责任公司苏州十全街营业部副总经理；东吴证券有限责任公司胥江路证券营业部副总经理，总经理；东吴证券股份有限公司石路证券营业部总经理，太仓分公司总经理，常熟分公司总经理；东吴基金管理有限公司营销总监兼营销管理部总经理，现任东吴基金管理有限公司副总经理兼营销管理部总经理。

吕晖先生，督察长，大专，历任苏州商业大厦业务员，苏州证券公司交易员，苏州证券登记公司总经理助理，东吴证券资产管理总部副总经理，东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理，东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监、东吴基

金管理有限公司副总经理，现任东吴基金管理有限公司督察长。

#### 4、基金经理

王文华，历任中诚信证券评估有限公司信贷评级分析员、联合证券股份有限公司投行高级项目经理、中诚信证券评估有限公司债券信用评级高级分析师。2012年3月至今就职于东吴基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中，自2014年10月16日起担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理，自2016年11月7日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，自2018年4月11日起担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。

邵笛先生，1982年生，上海财经大学工商管理硕士。曾就职于上海文筑建筑咨询公司、上海永一房产咨询有限公司，自2006年9月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事证券投资研究工作，曾任交易员、研究员、基金经理助理，自2014年10月31日起任东吴货币市场证券投资基金基金经理，自2018年4月11日起担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，自2018年4月23日起担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金。

历任基金经理：

陈晨：2016年11月7日至2018年10月13日

#### 5、投资决策委员会成员

(1) 权益投资决策委员会：王炯、彭敢、程涛、杨庆定、杜毅、付琦、刘元海、戴斌、王立立。王炯任权益投资决策委员会主席，彭敢、程涛为权益投资决策委员会副主席。

(2) 固收投资决策委员会：王炯、杨庆定、付琦、周明。王炯任固收投资决策委员会主席，杨庆定、周明为固收投资决策委员会副主席。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基金托管人概况

名称：浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市庆春路288号

法定代表人：沈仁康

联系人：林彬

电话：0571-88269636

传真：0571-88268688

成立时间：1993年04月16日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币18,718,696,778元

存续期间：持续经营

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】91号

基金托管资格批文及文号：《关于核准浙商银行股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》；证监许可【2013】1519号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。经国家外汇管理局批准，可以经营结汇、售汇业务。

## （二）主要人员情况

沈仁康先生，浙商银行党委书记、董事长、执行董事。硕士研究生。沈先生曾任浙江省青田县委常委、副县长，县委副书记、代县长、县长；浙江省丽水市副市长，期间兼任丽水经济开发区管委会党工委书记，并同时担任浙江省丽水市委常委；浙江省丽水市委副书记，期间兼任市委政法委书记；浙江省衢州市委副书记、代市长、市长。

徐仁艳先生，浙商银行党委副书记、执行董事、行长。研究生、高级会计师、注册税务师。徐先生曾任中国人民银行浙江省分行会计处财务科副科长、科长、会计处副处长，中国人民银行杭州中心支行会计财务处副处长、处长，中国人民银行杭州中心支行党委委员、副行长。

## 二、发展概况及财务状况

浙商银行是中国银保监会批准的12家全国性股份制商业银行之一，总行设在浙江省杭州市，是唯一一家总部位于浙江的全国性股份制商业银行，2004年8月18日正式开业，2016年3月30日在香港联交所上市（股份代号：2016）。截至2017年12月31日，浙商银行已设立了213家分支机构，实现了对长三角、环渤海、珠三角以及部分中西部地区的有效覆盖。2017年4月21日，首家控股子公司一浙银租赁正式开业。2018年4月10日，首家境外分行—香港分行正式开业，国际化战略布局迈出实质性一步。

开业以来，浙商银行立足浙江，稳健发展，已成为一家基础扎实、效益优良、成长迅

速、风控完善的优质商业银行。截至2018年6月30日，浙商银行总资产1.63万亿元，客户存款余额9,059.59亿元，客户贷款及垫款净额7707.10亿元，比上年末分别增长6.21%、5.27%、18.60%；不良贷款率1.14%。在英国《银行家》（The Banker）杂志“2018年全球银行1000强（Top 1000 World Banks 2018）”榜单上，按一级资本位列第111位，较上年上升20位；按总资产位列第100位，较上年上升9位。中诚信国际给予浙商银行金融机构评级中最高等级AAA主体信用评级。

2018年上半年，本集团在“两最”总目标引领下，坚持服务实体经济，持续优化业务结构，提高各项资源运用效率，提升风险管理能力，全面推动高质量发展。2018年上半年实现净利润65.09亿元，增长16.19%，年化平均总资产收益率0.83%，年化平均权益回报率16.82%。营业收入185.96亿元，增长3.61%，其中：利息净收入126.25亿元，增长1.94%；非利息净收入59.71亿元，增长7.32%。营业费用55.72亿元，增长2.59%，成本收入比28.77%。计提预期信用损失（或资产减值损失）50.78亿元，下降2.47%。所得税费用14.37亿元，下降15.89%。

### 三、托管业务部的部门设置及员工情况

浙商银行资产托管部是总行独立的一级管理部门，根据业务条线下设业务管理中心、营销中心、运营中心、监督中心，保证了托管业务前、中、后台的完整与独立。截至2018年9月30日，资产托管部从业人员共39名。

浙商银行资产托管部遵照法律法规要求，根据业务的发展模式、运营方式以及内部控制、风险防范等各方面发展的需要，制定了一系列完善的内部管理制度，包括业务管理、操作规程、基金会计核算、清算管理、信息披露、内部稽核监控、内控与风险防范、信息系统管理、保密与档案管理、重大可疑情况报告及应急处理等制度，系统性地覆盖了托管业务开展的方方面面，能够有效地控制、防范托管业务的政策风险、操作风险和经营风险。

### 四、证券投资基金托管业务经营情况

中国证监会、银监会于2013年11月13日核准浙商银行开办证券投资基金托管业务，批准文号：证监许可[2013]1519号。

截至2018年9月30日，浙商银行托管证券投资基金56只，规模合计1104.18亿元，且目前已经与数十家公募基金管理公司达成托管合作意向。

### 五、基金托管人内部控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## 2、内部控制组织结构

浙商银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

## 3、内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作、顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 4、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他



有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构：

（1）东吴基金管理有限公司直销中心

名称：东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

网站：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

##### （2）网上交易

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

##### 2、代销机构：

（1）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

客服电话：96528，上海地区 962528

公司网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

（2）浙商银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号

办公地址：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

客服热线：95527

公司网址：[www.czbank.com/](http://www.czbank.com/)

(3) 苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客服热线：96067

公司网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

(4) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

公司网址：<http://www.txsec.com>

(5) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

(6) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

客服热线：025-56663409

公司网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(7) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客服热线：400—821—5399

公司网址：www.noah-fund.com

(8) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

客服热线：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(9) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服热线：95021/400-1818-188

公司网址：<http://fund.eastmoney.com>

(10) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(11) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(12) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客服热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(13) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 14 层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

(14) 浙江金观诚基金销售有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：蒋雪琦

客服热线：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

(15) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

客服热线：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

(16) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服热线：95177

公司网址：www.snjijin.com

(17) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

客服热线：4008980618

公司网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(18) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层

法定代表人：王伟刚

客服热线：400-619-9059

公司网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(19) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区万通中心D座21&28层

法定代表人：蒋煜

客服热线：010-58170761

公司网址：<http://www.shengshiview.com.cn/>

(20) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

客服热线：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com>

(21) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服热线：400-678-5095

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(22) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人：于龙

联系人：张喆

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服热线：4006-802-123

公司网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

(23) 成都华羿恒信基金销售有限公司

注册地址：成都市高新区蜀锦路 88 号新中泰国际大厦 1 号楼 32F2 号

办公地址：成都市高新区蜀锦路 88 号新中泰国际大厦 1 号楼 32F2 号

法定代表人：赵壁

客服热线：028-87326832

公司网址：<http://www.huayihengxin.com>

(24) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20F

法定代表人：陈刚

客服热线：0571-86915761

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

(25) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

客服热线：400-821-0203

(26) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客服热线：400-166-6788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

(27) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

客服热线：400-821-3999

公司网址：www.hotjijin.com

(28) 北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

法定代表人：季长军

客服热线：400-188-5687

公司网址：www.buyforyou.com.cn

(29) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发  
展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服热线：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(30) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 603 单元

法定代表人：田为奇

客服热线：68889082

公司网址：www.pytz.cn

(31) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

## (32) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.com/>

## (33) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室（邮编：510308）

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

## (34) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEOWEEHOWE（张伟豪）

客服热线：400-684-0500

公司网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

## (35) 中民财富管理（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

法定代表人：弭洪军

客服热线：400-876-5716

公司网址：[www.cmiwm.com](http://www.cmiwm.com)

## (36) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、



## 14层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(37) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客户服务热线：95521/4008888666

公司网址：<http://www.gtja.com>

(38) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(39) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(40) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服热线：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(41) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

(42) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：021-23219000

公司网址：www.htsec.com

(43) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

联系人：黄莹

(44) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562

公司网址：www.xyzq.com

(45) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(46) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

法定代表人：王连志

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

(47) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客服热线：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

(48) 万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

客服热线：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

(49) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.ewww.com.cn

(50) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

公司网址：www.zxzqsd.com.cn

(51) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：0512-3339628895530

公司网址：www.dwzq.com.cn

(52) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(53) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 楼

法定代表人：丁益

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

(54) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(55) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

传真：021-53686100，021-53686200

网址：www.shzq.com

(56) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市金融一街8号国联大厦

法定代表人：姚志勇

客服电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn

(57) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层（518048）

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

(58) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

公司网址：www.hazq.com

(59) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28楼

法定代表人：蔡一兵

客服电话：95317

公司网址：www.cfzq.com

(60) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(61) 申万宏源（西部）证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼

## 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

## 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：韩志谦

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

## （62）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

## （63）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航资本大厦 35 层

法定代表人：王晓峰

客服电话：95335

公司网址：www.avicsec.com

## （64）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人：张永衡

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

## （65）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

客户服务电话：95323；4001099918

公司网站：www.cfsc.com.cn

(66) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

客服热线：4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

(67) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服热线：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

(68) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

客服电话：4008209898

公司网址：www.cnhbstock.com

(69) 金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107

法定代表人：夏予柱

客服热线：400-8557333

公司网址：www.jhjfund.com

3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

**(二) 注册登记机构：东吴基金管理有限公司**

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

网站：www.scfund.com.cn

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所有限责任公司

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

## 四、基金的名称

本基金名称：东吴增鑫宝货币市场基金

## 五、基金的类型

本基金类型：货币市场型基金



## 六、基金的投资目标

在严格控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

## 八、基金的投资策略

本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。

### （一）资产配置策略

本基金将通过对宏观经济发展态势、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析，形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上，本基金将根据不同类别资产的收益率水平（不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性），结合各类资产的流动性特征（成交活跃度、发行规模）和风险特征（信用等级、波动性），决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。

### （二）利率品种的投资策略

本基金对利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，结合利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化，据此确定组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，选择合适的期限结构配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

### （三）信用品种的投资策略

本基金根据基金管理人的“内部信用评级体系”，从市场上公开发行的信用债券中筛

选投资备选券，形成信用债券投资备选库。从信用债券投资备选库中，本基金管理人结合本基金的投资与配置需要，通过分析比较到期收益率、剩余期限、流动性等特征，挑选适当的信用债券进行投资。

#### （四）资产支持证券投资策略

本基金将综合运用定性方法和定量方法，基本面分析和数量化模型相结合，对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析，并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

#### （五）债券回购投资策略

在有效控制风险的前提下，本基金将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。同时，密切关注央行公开市场操作、季节因素、日历效应、IPO 发行等因素导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。

#### （六）其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪衍生产品等其他金融工具的动向。当监管机构允许基金参与其他金融工具的投资，本基金将按照届时生效的法律法规，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

## 九、业绩比较基准

中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

## 十、风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

## 十一、基金投资组合报告

东吴增鑫宝货币市场基金(以下简称“本基金”)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。

本基金的托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日(未经审计)。

#### 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	固定收益投资	3,143,545,208.01	21.51
	其中:债券	3,048,545,208.01	20.86
	资产支持证券	95,000,000.00	0.65
2	买入返售金融资产	5,125,844,608.78	35.08
	其中:买断式回购的买入返 售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	6,294,624,862.93	43.07
4	其他资产	49,623,809.26	0.34
5	合计	14,613,638,488.98	100.00

#### 2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.23	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

### 3、基金投资组合平均剩余期限

#### 3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

本基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过 120 天，如有超过应当在 10 个交易日内调整。

#### 3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	43.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	20.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	15.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	8.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天 (含)	11.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.71	-

注：本基金合同约定本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。

#### 4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	707,676,731.29	4.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	328,247,732.13	2.25
	其中：政策性金融债	328,247,732.13	2.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	880,556,206.58	6.03
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,132,064,538.01	7.75
8	其他	-	-
9	合计	3,048,545,208.01	20.87
10	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	-	-

#### 6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111808219	18 中信银行 CD219	3,000,000	298,152,776.93	2.04
2	189940	18 贴现国债 40	2,900,000	288,981,150.09	1.98
3	011801585	18 宝钢 SCP007	2,000,000	200,020,983.97	1.37
4	071800037	18 中信 CP008	2,000,000	200,000,000.00	1.37
5	189936	18 贴现国债 36	2,000,000	199,410,947.76	1.37
6	111811255	18 平安银行 CD255	2,000,000	198,973,186.91	1.36
7	111804036	18 中国银行 CD036	2,000,000	196,947,183.87	1.35
8	011801198	18 大唐发电 SCP003	1,300,000	130,299,378.59	0.89

9	011801304	18 东航股 SCP006	1,000,000	100,124,468.58	0.69
10	170211	17 国开 11	1,000,000	100,076,932.08	0.69

## 7、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0499%
报告期内偏离度的最低值	0.0137%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0299%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149617	18 京保 3A	700,000	70,000,000.00	0.48
2	149553	宁远 04A1	250,000	25,000,000.00	0.17

## 9、投资组合报告附注

## 9.1

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

## 9.2

18 中信银行 CD219（代码：111808219）的发行主体“中信银行股份有限公司”于 2017 年 11 月 24 日因违规经营被外汇管理局处以罚款并责令改正；

18 平安银行 CD255（代码：111811255）的发行主体“平安银行股份有限公司”于 2018 年 8 月 1 日、2018 年 3 月 16 日因涉嫌违反法律法规被央行处以罚款并责令改正，于 2018 年 7 月 10 日因未依法履行职责被天津银监局处以罚款，于 2018 年 2 月 12 日因违法经营被大连银监局处以罚款；

本基金投资 18 中信银行 CD219、18 平安银行 CD255 的投资决策程序符合公司制度的规定，且相关发行主体的处罚事项并未对其企业经营和投资价值产生实质性影响。

除此之外，报告期内本基金投资的前十名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。

### 9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	49,623,709.26
4	应收申购款	100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	49,623,809.26

### 9.4 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。

## 十二、基金的业绩

本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，也不保证最低收益。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。

### (1) 东吴增鑫宝货币基金历史时间段净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较

#### 东吴增鑫宝 A

时间	净值收益率①	净值收益率标准差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
2016. 11. 07-2016. 12. 31	0. 4175%	0. 0028%	0. 2034%	0. 0000%	0. 2141%	0. 0028%
2017. 01. 01-2017. 12. 31	3. 9306%	0. 0008%	1. 3500%	0. 0000%	2. 5806%	0. 0008%
2018. 01. 01-2018. 09. 30	2. 5916%	0. 0016%	1. 0097%	0. 0000%	1. 5819%	0. 0016%
2016. 11. 07-2018. 09. 30	7. 0692%	0. 0017%	2. 5632%	0. 0000%	4. 5060%	0. 0017%

注：1、比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

#### 东吴增鑫宝B

时间	净值收 益率①	净值收益率 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
2016. 11. 07-2016. 12. 31	0. 4524%	0. 0028%	0. 2034%	0. 0000%	0. 2490%	0. 0028%
2017. 01. 01-2017. 12. 31	4. 1810%	0. 0008%	1. 3500%	0. 0000%	2. 8310%	0. 0008%
2018. 01. 01-2018. 09. 30	2. 7757%	0. 0016%	1. 0097%	0. 0000%	1. 7660%	0. 0016%
2016. 11. 07-2018. 09. 30	7. 5571%	0. 0017%	2. 5632%	0. 0000%	4. 9939%	0. 0017%

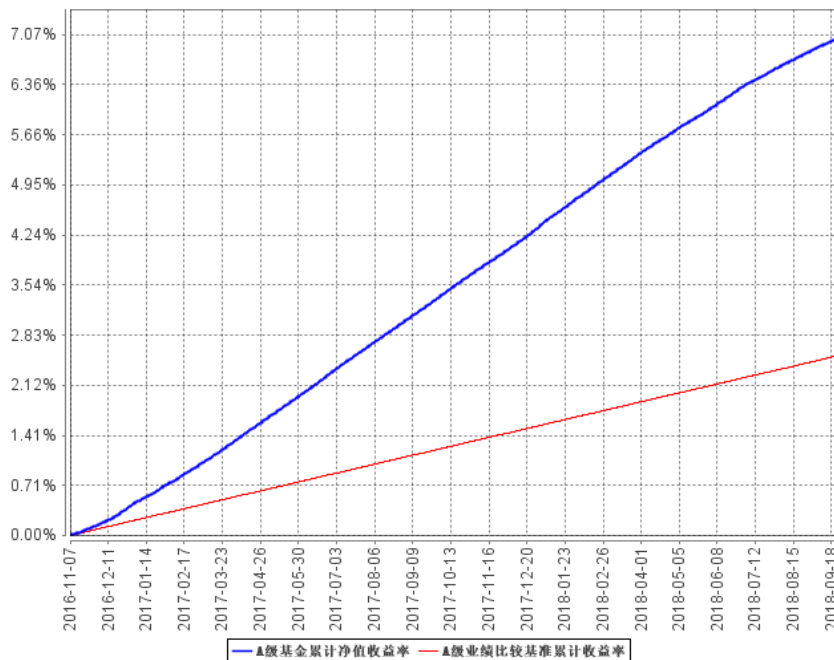
注：1、比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

(2) 自基金合同生效以来基金累计净值收益率及其与同期业绩基准收益率变动的比较

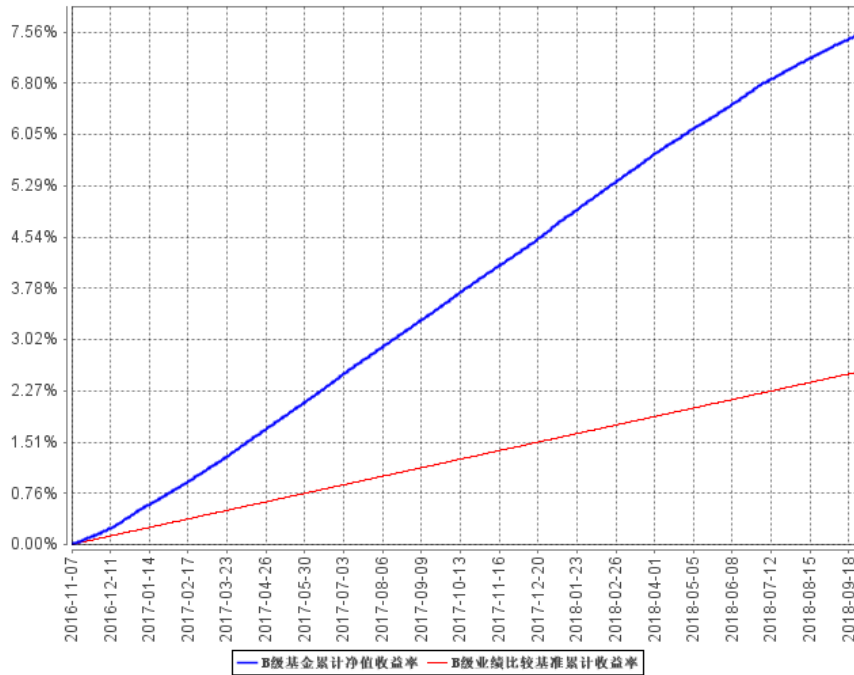
(2016年11月7日至2018年9月30日)

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

### 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 1、基金转换业务的适用范围

本基金已开通与本基金管理人旗下基金：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(基金代码：580001)、东吴价值成长双动力混合型证券投资基金(基金代码：580002)、东吴行业轮动混合型证券投资基金(基金代码：580003)、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金(基金代码：580005)、东吴新经济混合型证券投资基金(基金代码：580006)、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：580007)、东吴新产业精选混合型证券投资基金(基金代码：580008)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金(基金代码：585001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A(基金代码：582001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C(基金代码：582201)、东吴增利债券型证券投资基金 A(基金代码：582002)、东吴增利债券型证券投资基金 C(基金代码：582202)、东吴货币市场证券投资基金 A(基金代码：583001)、东吴货币市场证券投资基金 B(基金代码：583101)、东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：582003)、东吴多策略灵活配置混合

型证券投资基金(基金代码: 580009)、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 000531)、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 A(基金代码: 001323)、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 001322)、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002159)、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002270)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金 A(基金代码: 000958)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金 C(基金代码: 000959)、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002561)、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002919)、东吴优益债券型证券投资基金 A(基金代码: 005144)、东吴优益债券型证券投资基金 C(基金代码: 005145)、东吴双三角股票型证券投资基金 A(基金代码: 005209)、东吴双三角股票型证券投资基金 C(基金代码: 005210)、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金 A(基金代码: 005573)、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金 C(基金代码: 005574)的基金转换业务。

基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务, 并将另行公告。

## 2、开通转换的销售机构

投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务:

宁波银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问(北京)有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、北京钱景基金销售有限公司、成都华羿恒信基金销售有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海攀赢基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、奕丰基金销售有限公司、中民财富管理(上海)有限公司、中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信证券(山东)

有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、申万宏源（西部）证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、金惠家保险代理有限公司。根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

## 十四、费用概览

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费；

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

- 2、基金托管人的托管费；

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 级降级为 A 级的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类基金份额条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。A、B 两类基金份额销售服务费的计算方法相同，具体如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金登记机构，由给基金登记机构代付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求, 本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新, 并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新, 主要更新的内容如下:

- 1、在“重要提示”中，对相关内容进行了更新。
- 2、在“三、基金管理人”中，对相关内容进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”中，对相关内容进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”中，对相关内容进行了更新。
- 5、在“九、基金份额的申购与赎回”中，对相关内容进行了更新。
- 6、在“十、基金的投资”中，对相关内容进行了更新。
- 7、在“十一、基金的业绩”中，对相关内容进行了更新。
- 8、在“二十一、基金托管协议的内容摘要”中，对相关内容进行了更新。
- 9、在“二十三、其他应披露事项”中，对相关内容进行了更新。

### 十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2018年12月21日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一八年十二月二十一日