

# 东吴货币市场证券投资基金 2018 年年度报告 摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十九日

## § 1 重要提示

### 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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东吴货币	
基金主代码	583001	
交易代码	583001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 5 月 11 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,120,323,676.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	东吴货币 A	东吴货币 B
下属分级基金的交易代码：	583001	583101
报告期末下属分级基金的份额总额	230,739,945.72 份	5,889,583,730.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理及量化分析，为投资者提供稳定的收益。
投资策略	本基金采取积极的投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测；在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例；在此框架之下，通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券基金，也低于混合型基金与股票型基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	贺倩
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-66060069

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
---------------------	-------------------

基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处
------------	--------------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2018 年		2017 年		2016 年	
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 A	东吴货币 B
本期 已实现 收益	2,617,957.42	317,554,382.42	4,807,249.82	368,409,522.06	2,105,998.19	112,414,478.79
本期 利润	2,617,957.42	317,554,382.42	4,807,249.82	368,409,522.06	2,105,998.19	112,414,478.79
本期 净值 收益 率	3.1155%	3.3629%	3.6862%	3.9365%	2.5027%	2.7482%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 A	东吴货币 B
期末 基金 资产 净值	230,739,945.72	5,889,583,730.56	117,388,274.69	10,187,113,414.59	437,755,089.15	5,224,568,197.30
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配按日结转份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴货币 A

阶段	份额净值 收益率	份额净值 收益率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去三个月	0.6594%	0.0035%	0.3403%	0.0000%	0.3191%	0.0035%
过去六个月	1.3051%	0.0025%	0.6805%	0.0000%	0.6246%	0.0025%
过去一年	3.1155%	0.0025%	1.3500%	0.0000%	1.7655%	0.0025%
过去三年	9.5924%	0.0023%	4.0537%	0.0000%	5.5387%	0.0023%
过去五年	17.7902%	0.0063%	6.7537%	0.0000%	11.0365%	0.0063%
自基金合同 生效起至今	30.6359%	0.0061%	11.8503%	0.0001%	18.7856%	0.0060%

东吴货币 B

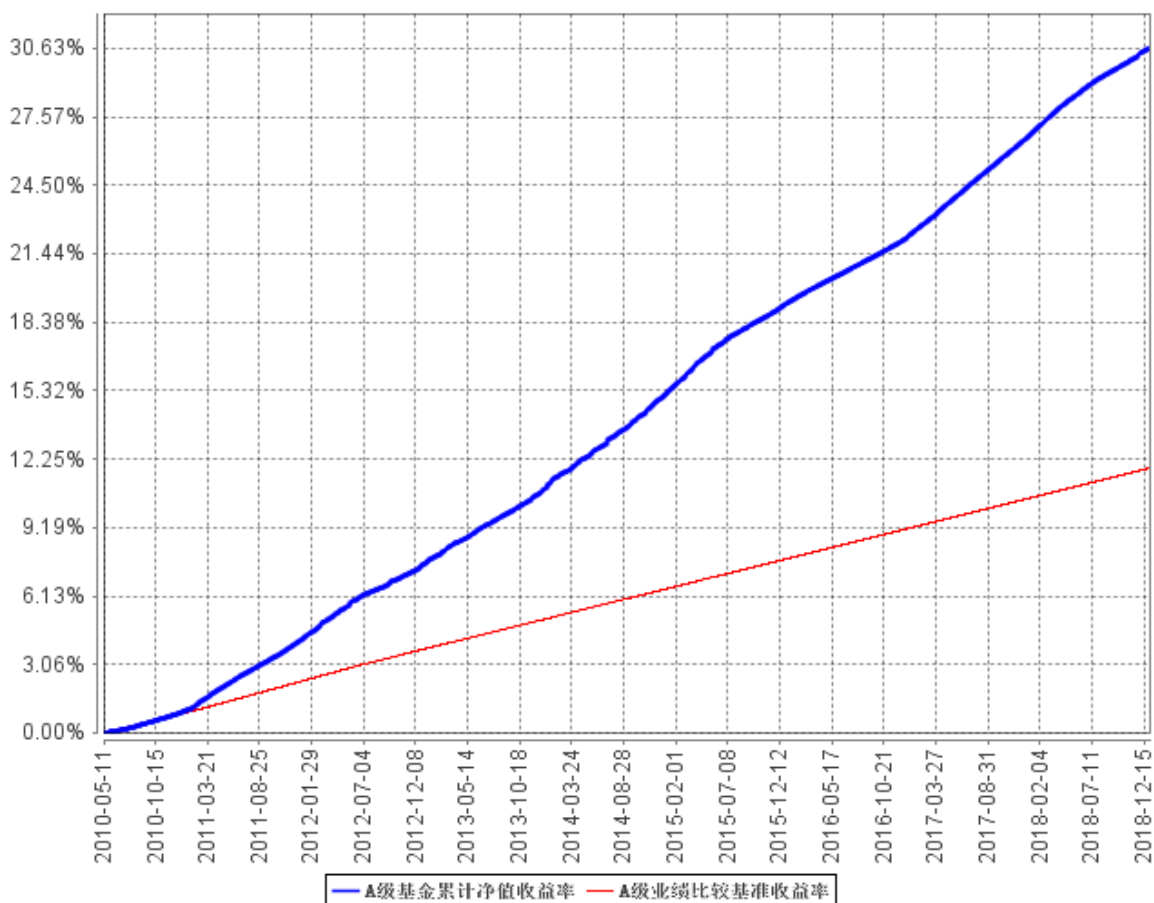
阶段	份额净值 收益率	份额净值 收益率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去三个月	0.7195%	0.0035%	0.3403%	0.0000%	0.3792%	0.0035%
过去六个月	1.4271%	0.0025%	0.6805%	0.0000%	0.7466%	0.0025%
过去一年	3.3629%	0.0025%	1.3500%	0.0000%	2.0129%	0.0025%
过去三年	10.3843%	0.0023%	4.0537%	0.0000%	6.3306%	0.0023%
过去五年	19.0323%	0.0058%	6.7537%	0.0000%	12.2786%	0.0058%
自基金合同 生效起至今	33.1763%	0.0058%	11.8503%	0.0001%	21.3260%	0.0057%

注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）

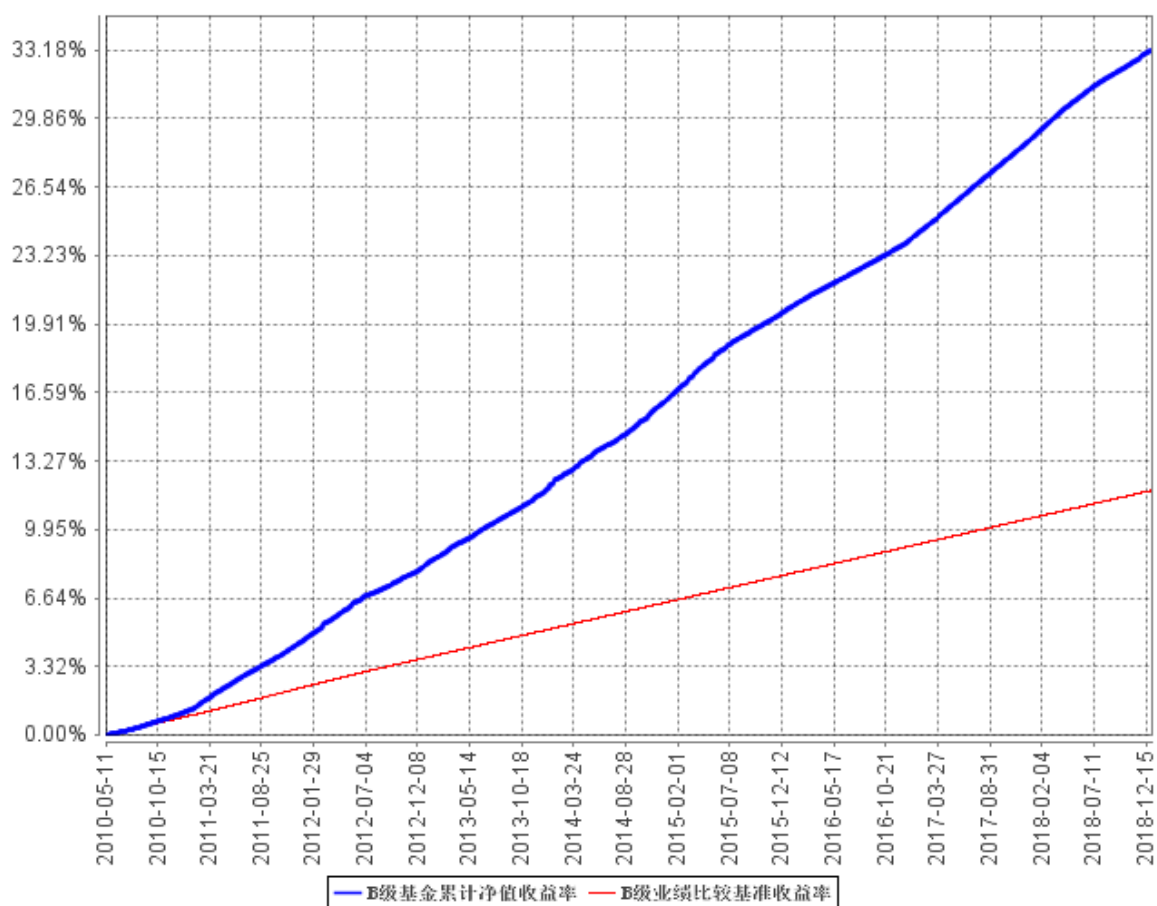
2、本基金收益分配按日结转份额。

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

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



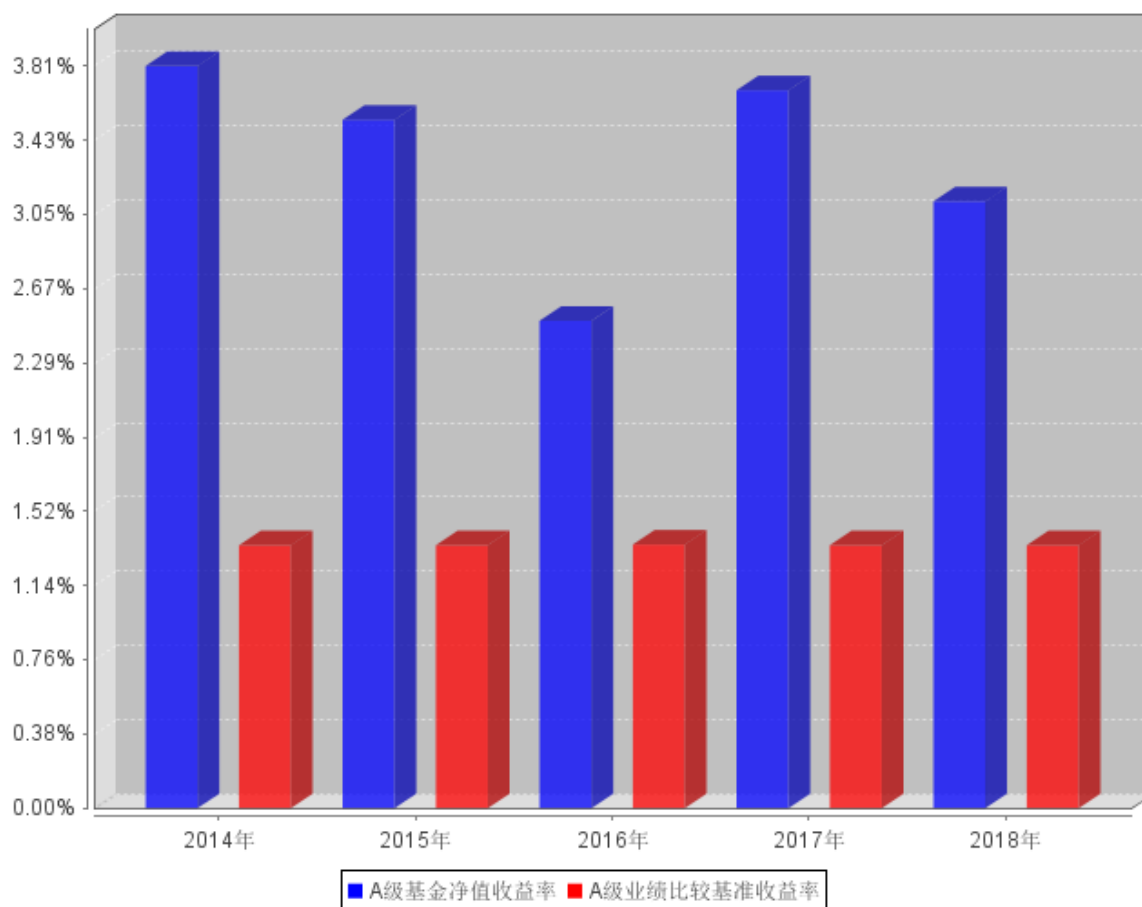
注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

2、本基金于 2010 年 5 月 11 日成立。

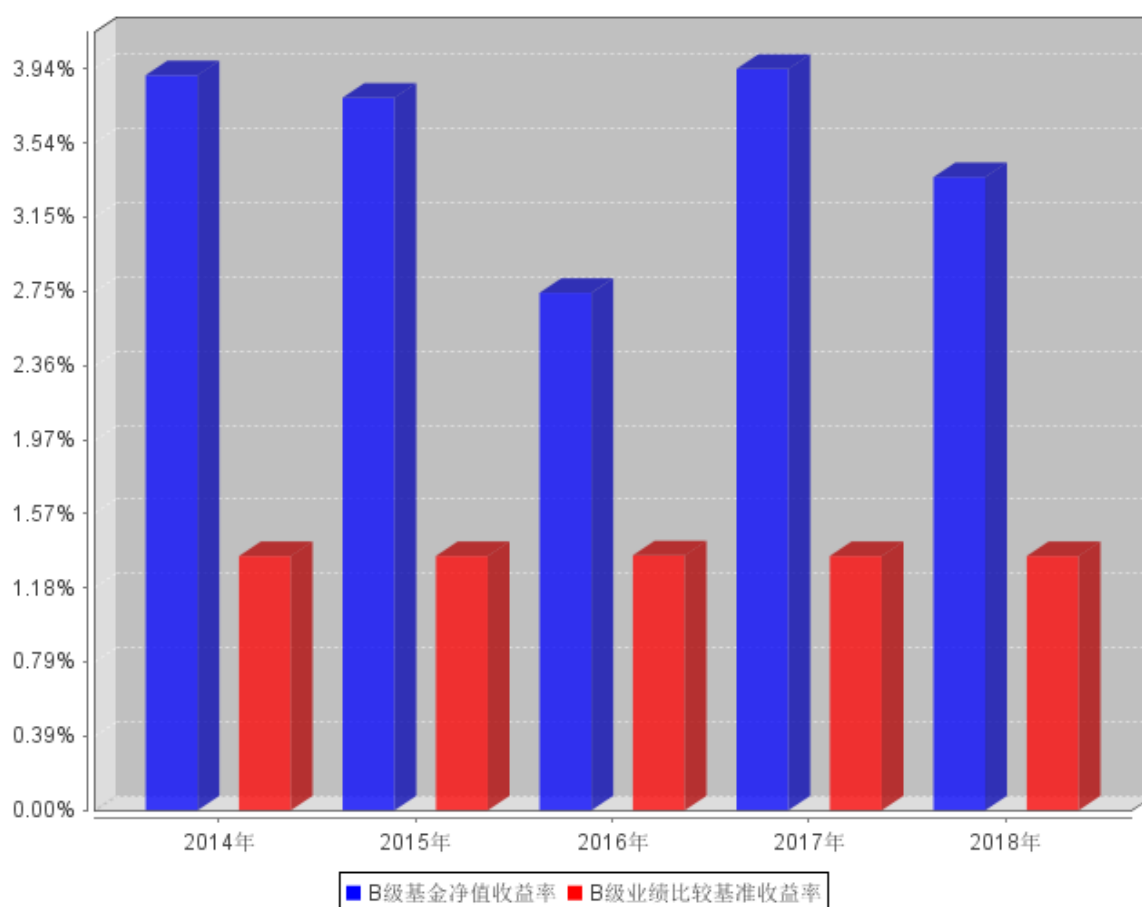


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2010 年 5 月 11 日成立。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东吴货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	2,617,957.42	-	-	2,617,957.42	
2017	4,807,249.82	-	-	4,807,249.82	
2016	2,105,998.19	-	-	2,105,998.19	
合计	9,531,205.43	-	-	9,531,205.43	

单位：人民币元

东吴货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	317,554,382.42	-	-	317,554,382.42	
2017	368,409,522.06	-	-	368,409,522.06	
2016	112,414,478.79	-	-	112,414,478.79	
合计	798,378,383.27	-	-	798,378,383.27	

## § 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源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。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、专户业务以及子公司业务协同发展,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。

截至 2018 年年末,公司整体资产管理规模近 587.35 亿元,其中公募基金 232.14 亿元,专户业务 310.24 亿元,子公司 44.97 亿元;旗下管理着 29 只公募基金,69 只存续专户资产管理计划,24 项存续专项资产管理计划(子公司),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。

自 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,进一步引入了量化投资策略,并在业内率先成立了绝对收益部,谋求穿越牛熊的长期业绩回报。

经过多年积累和布局,公司的公募业务已形成三大投研“特色”:1.权益投资坚持自下而上精选优质成长股,把握中国经济转型升级机遇;2.绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念,借助量化模型进行择时和选股;3.固定收益以稳健为本,兼顾流动性与收益率,为大类资产配置提供基础性工具。

海通证券固定收益类资产业绩排行榜的最新数据显示,截至 2018 年年末,东吴旗下的固定收益类基金以 12.59%的最近三年的净值增长率,位列 81 家入选基金公司的第六位。

近年来,公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩,斩获了诸多奖项,比如 2018 东方财富风云榜连续三年稳回报基金\*东吴增利债券基金(东方财富网)、第十五届“金基金”奖债券基金奖\*东吴增利债券基金(《上海证券报》)、2017 年度三年持续回报普通债券型明星基金\*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2017 年度最受欢迎新发基金\*东吴双三角股票型基金(东方财富风云榜)、2016 年度积极债券型明星基金\*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金

\*东吴鼎利债券基金 LOF（东方财富风云榜）等。

#### 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		
邵笛	基金经理	2014 年 10 月 31 日	-	12 年	邵笛，硕士，上海财经大学工商管理专业。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。
王文华	基金经理	2018 年 4 月 11 日	-	12 年	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资银行高级项目经理、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。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期为对外公告之日。

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。

#### 4.2 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，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事

中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的交易进行了相关分析，未发现异常情况。

#### 4.3.3 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。

### 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

2018 年 GDP 同比增长 6.6%，全年呈现前高后低走势，前阶段金融严监管影响向实体经济扩散，后阶段中美贸易摩擦对经济和市场预期负面影响更大。在此背景下，货币政策保持中性，监管尺度有所放松。虽然美联储完成了年内四次加息，但我国央行依然根据实际情况，通过多次降准、TMLF 等措施为市场提供了宽裕的流动性支持，而 CPI、PPI 等保持在相对低位也为此提供了条件。

在此背景下，利率债走出了单边上涨行情，仅在三季度受 CPI、地方债加快发行等因素出现调整，10 年期国开债收益率下行达 150bp，3 个月 shibor 利率最多下行 190bp，存款利率再度回到 3%时代。信用债市场表现则有所不同，财务状况不佳的中小型企业信用风险不断爆发，央行也针对性的通过货币政策微调、放行 CRMW 等方式推动市场宽信用，实际效果仍需等待时间。

报告期内，本基金严格做好风险控制，合规操作，规避资质差的债券品种，在可控范围内根据市场变化合理积极配置资产，做好流动性安排，保持基金平稳健康运行，为投资者获取合理投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期东吴货币 A 的基金份额净值收益率为 3.1155%，本报告期东吴货币 B 的基金份额净值收益率为 3.3629%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

### 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 2019 年，美联储加息预期有所弱化，中美贸易摩擦出现缓和迹象，外部直接压力好于 2018 年，但国内的投资消费增速均有所回落，通胀压力可控，预期却可能会有变化，预计财政政策和货币政策继续保持宽松，市场流动性短期不会出现明显收紧局面，需配合国内外形势变化跟踪观察。

#### 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、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，成员由分管运营副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、绝对收益部、固定收益部、专户投资部）负责人、合规风控部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。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；公司副总经理、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；公司现没有进行任何定价服务的约定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关约定，本基金的收益分配采用“每日分配、按月支付”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。本报告期东吴货币 A 级基金应分配收益 2,617,957.42 元，实际分配收益 2,617,957.42 元；东吴货币 B 级基金应分配收益 317,554,382.42 元，实际分配收益 317,554,382.42 元。

#### 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遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。



## § 6 审计报告

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了安永华明(2019)审字第 60469066\_B07 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,144,261,674.17	2,485,683,178.80
结算备付金	36,392,480.01	-
存出保证金	97,057.91	3,365.78
交易性金融资产	2,075,976,061.28	4,165,007,398.44
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,040,976,061.28	4,165,007,398.44
资产支持证券投资	35,000,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	982,481,633.73	3,806,147,303.91
应收证券清算款	672,750.00	-
应收利息	22,287,186.81	41,024,946.63
应收股利	-	-
应收申购款	63,466,365.00	9,555,939.54
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,325,635,208.91	10,507,422,133.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 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	-	-
卖出回购金融资产款	199,984,500.02	199,625,400.18
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	298.80	3,967.36
应付管理人报酬	3,693,793.95	2,243,781.55
应付托管费	1,119,331.51	679,933.82
应付销售服务费	161,957.96	89,887.22
应付交易费用	115,260.34	105,690.50
应交税费	32,521.68	-
应付利息	104,387.48	68,750.55
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	99,480.89	103,032.64
负债合计	205,311,532.63	202,920,443.82
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6,120,323,676.28	10,304,501,689.28
未分配利润	-	-
所有者权益合计	6,120,323,676.28	10,304,501,689.28
负债和所有者权益总计	6,325,635,208.91	10,507,422,133.10

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,120,323,676.28 份，其中 A 类基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 230,739,945.72 份；B 类基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 5,889,583,730.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	366,467,235.00	420,861,656.60
1.利息收入	362,683,806.65	416,025,899.41
其中：存款利息收入	101,907,606.00	244,119,820.23
债券利息收入	160,236,659.27	84,743,753.70
资产支持证券利息收入	1,038,152.43	-
买入返售金融资产收入	99,501,388.95	87,162,325.48
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,783,428.35	4,835,757.19
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-

债券投资收益	3,783,428.35	4,835,757.19
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>46,294,895.16</b>	<b>47,644,884.72</b>
1. 管理人报酬	31,384,243.03	31,880,363.92
2. 托管费	9,510,376.63	9,660,716.39
3. 销售服务费	1,158,946.52	1,285,465.30
4. 交易费用	60.30	2,783.14
5. 利息支出	3,852,779.59	4,440,654.72
其中：卖出回购金融资产支出	3,852,779.59	4,440,654.72
6. 税金及附加	94,432.72	-
7. 其他费用	294,056.37	374,901.25
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>320,172,339.84</b>	<b>373,216,771.88</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>320,172,339.84</b>	<b>373,216,771.88</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,304,501,689.28	-	10,304,501,689.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	320,172,339.84	320,172,339.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填)	-4,184,178,013.00	-	-4,184,178,013.00

列)			
其中：1.基金申购款	64,807,718,108.39	-	64,807,718,108.39
2.基金赎回款	-68,991,896,121.39	-	-68,991,896,121.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-320,172,339.84	-320,172,339.84
五、期末所有者权益（基金净值）	6,120,323,676.28	-	6,120,323,676.28
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,662,323,286.45	-	5,662,323,286.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	373,216,771.88	373,216,771.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,642,178,402.83	-	4,642,178,402.83
其中：1.基金申购款	71,577,616,006.07	-	71,577,616,006.07
2.基金赎回款	-66,935,437,603.24	-	-66,935,437,603.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-373,216,771.88	-373,216,771.88
五、期末所有者权益（基金净值）	10,304,501,689.28	-	10,304,501,689.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王炯

徐明

吴婷

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴货币市场证券投资基金（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[2010]415号《关于同意东吴货币市场证券投资基金募集的批复》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 2010 年 5 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 4,433,355,798.66 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为现金，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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、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。

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

#### 7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资、资产支持证券等。

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金持有的金融工具的估值方法具体如下：

##### (1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

##### (2) 债券投资

本基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### (3) 回购协议

1) 本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

##### (4) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。

当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

3)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用自有资金予以弥补；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4)债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的



费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；
- (4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；
- (5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。若投资者赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资者赎回基金款中扣除；
- (6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；
- (7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品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暂行条例（2011 年修订）》、《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。

### 7.4.7 关联方关系

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、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海澜集团有限公司	基金管理人的股东

注：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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 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。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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
东吴证券股份有限 公司	1,860,460,382.00	100.00%	19,855,800.00	56.47%

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东吴证券股份有限 公司	46,594,367,000.00	89.70%	-	-

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	31,384,243.03
其中：支付销售机构的 客户维护费	399,903.51	881,558.39

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的托管费	9,510,376.63	9,660,716.39
----------------	--------------	--------------

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 7.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴货币 A	东吴货币 B	合计
东吴基金管理有限公司	38,154.87	896,732.36	934,887.23
中国农业银行股份有限公司	37,367.72	1,848.21	39,215.93
东吴证券股份有限公司	2,624.17	5.37	2,629.54
合计	78,146.76	898,585.94	976,732.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴货币 A	东吴货币 B	合计
东吴基金管理有限公司	47,934.90	931,881.01	979,815.91
中国农业银行股份有限公司	77,162.71	1,009.47	78,172.18
东吴证券股份有限公司	11,140.54	0.00	11,140.54
合计	136,238.15	932,890.48	1,069,128.63

注：本基金 A 级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 级基金份额持有人的费率。B 级基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 级升级为 B 级的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 级条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 级基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为每日该类基金份额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，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金注册登记机构，由基金注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行股份有限公司	10,090,858.73	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行股份有限公司	846,310,152.58	99,225,476.92	-	-	584,978,000.00	42,649.46

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	东吴货币 A	东吴货币 B
基金合同生效日（2010 年 5 月 11 日）持有的基金份额	0.00	-
期初持有的基金份额	0.00	-
期间申购/买入总份额	1,000.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,000.00	-

期末持有的基金份额	0.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	-

项目	上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	东吴货币 A	东吴货币 B
基金合同生效日 ( 2010 年 5 月 11 日 ) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,261,674.17	24,377.70	683,178.80	81,691.07

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2018 年度获得的利息收入为人民币 375,885.33 元（2017 年度：人民币 92,303.39 元），2018 年末结算备付金余额为人民币 36,392,480.01 元（2017 年末无结算备付金余额）。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 199,984,500.02 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
189949	18 贴现国债 49	2019 年 1 月 4 日	99.84	515,000	51,415,350.18
120208	12 国开 08	2019 年 1 月 4 日	99.97	1,000,000	99,966,558.32
160415	16 农发 15	2019 年 1 月 4 日	100.09	500,000	50,047,275.64
合计				2,015,000	201,429,184.14

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

###### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具



不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### **7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具**

##### **7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值**

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中属于第二层次的余额为人民币 2,075,976,061.28 元，无属于第一层次和第三层次的余额。（于 2017 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 4,165,007,398.44 元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

##### **7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### **7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额**

本基金持有的交易性金融资产第三层次公允价值本期未发生变动。

#### **7.4.10.2 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### **7.4.10.3 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### **7.4.10.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	固定收益投资	2,075,976,061.28	32.82
	其中：债券	2,040,976,061.28	32.27
	资产支持证券	35,000,000.00	0.55
2	买入返售金融资产	982,481,633.73	15.53
	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	3,180,654,154.18	50.28
4	其他各项资产	86,523,359.72	1.37
5	合计	6,325,635,208.91	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	1.49	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	199,984,500.02	3.27
	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

报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的 20%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	65
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

### 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。

### 8.3.2 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	22.93	3.27
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.95	-
2	30 天(含)—60 天	20.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	46.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	5.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	6.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.95	3.27

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。

### 8.4 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。

### 8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	109,847,335.86	1.79
2	央行票据	-	-

3	金融债券	609,741,201.18	9.96
	其中：政策性金融债	509,484,892.20	8.32
4	企业债券	27,168,833.00	0.44
5	企业短期融资券	469,847,966.59	7.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	824,370,724.65	13.47
8	其他	-	-
9	合计	2,040,976,061.28	33.35
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	119,639,636.48	1.95

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111821372	18 渤海银行 CD372	3,000,000	298,275,591.59	4.87
2	011802221	18 华能 SCP012	2,000,000	199,907,221.03	3.27
3	111812093	18 北京银行 CD093	2,000,000	198,110,166.51	3.24
4	071800048	18 光大证券 CP002	1,500,000	150,000,000.00	2.45
5	180404	18 农发 04	1,200,000	120,041,891.99	1.96
6	1622003	16 招银租赁债 01	1,000,000	100,256,308.98	1.64
7	120208	12 国开 08	1,000,000	99,966,558.32	1.63
8	011802284	18 华能 SCP013	1,000,000	99,940,573.97	1.63
9	189949	18 贴现国债 49	1,000,000	99,835,631.41	1.63
10	111814035	18 江苏银行 CD035	1,000,000	99,486,295.81	1.62

### 8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2100%
报告期内偏离度的最低值	-0.0038%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1036%

**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。

**8.8 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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	149553	宁远 04A1(总价)	250,000	25,000,000.00	0.41
2	156288	宁远 07A1(总价)	100,000	10,000,000.00	0.16

**8.9 投资组合报告附注****8.9.1 基金计价方法说明**

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。

**8.9.2 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**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**8.9.3 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	97,057.91
2	应收证券清算款	672,750.00
3	应收利息	22,287,186.81
4	应收申购款	63,466,365.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	86,523,359.72
---	----	---------------

#### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
东吴货币 A	16,374	14,091.85	7,970,923.82	3.45%	222,769,021.90	96.55%
东吴货币 B	75	78,527,783.07	5,595,464,085.17	95.01%	294,119,645.39	4.99%
合计	16,449	372,078.77	5,603,435,008.99	91.55%	516,888,667.29	8.45%

注：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。

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	1,000,000,000.00	16.34%
2	其他机构	648,162,321.71	10.59%
3	其他机构	549,742,688.17	8.98%
4	其他机构	501,388,995.67	8.19%
5	保险类机构	500,485,983.19	8.18%
6	其他机构	250,000,000.00	4.08%
7	银行类机构	202,777,991.28	3.31%
8	银行类机构	200,160,486.82	3.27%
9	券商类机构	150,000,000.00	2.45%
10	其他机构	144,384,871.56	2.36%

### 9.3 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	东吴货币 A	94,191.93	0.0015%

持有本基金	东吴货币 B	-	-
	合计	94,191.93	0.0015%

#### 9.4 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。



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	东吴货币 A	东吴货币 B
基金合同生效日（2010 年 5 月 11 日）基金份额总额	1,474,241,686.52	2,959,332,679.75
本报告期期初基金份额总额	117,388,274.69	10,187,113,414.59
本报告期期间基金总申购份额	518,384,873.50	64,289,333,234.89
减:本报告期期间基金总赎回份额	405,033,202.47	68,586,862,918.92
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	230,739,945.72	5,889,583,730.56

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、份额级别调整和转换入份额，基金总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

本基金本报告期内管理人发生的重大人事变动如下：

本基金管理人于 2018 年 4 月 3 日发布公告,徐军女士不再担任公司督察长职务,由吕晖先生担任公司督察长职务,同时吕晖先生不再担任公司副总经理职务。本基金管理人于 2018 年 8 月 16 日发布公告,由徐明先生担任公司副总经理职务。本基金管理人于 2018 年 8 月 31 日发布公告,由马震亚先生担任公司董事长职务,同时范力先生不再担任公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本基金本报告期内托管人发生的重大人事变动如下：

本报告期内,本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)上海分所,该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今,本报告期内支付审计费 90000 元。

### 11.6 管理人、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,基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,上海证监局对公司采取责令改正的决定。公司高度重视,按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程,针对性的制定、落实整改措施,并将及时向监管部门提交整改报告。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
华泰联合	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
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

本报告期本基金新增交易单元 4 个，分别为申港证券、方正证券、川财证券和光大证券交易单元；退租交易单元 4 个，分别为为金元证券、国金证券、安信证券和中金公司交易单元。

## 11.7.2 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
华泰联合	-	-	5,349,000,000.00	10.30%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

申港证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,860,460,382.00	100.00%	46,594,367,000.00	89.70%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%（含）以上的情况。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180608 -	0.00	1,017,736,902.94	1,017,736,902.94	0.00	0.00%
		20180613					
	2	20180103 -	3,003,391,767.47	42,343,771.16	3,045,735,538.63	0.00	0.00%
		20180110					
	3	20180126 -	3,003,391,767.47	42,343,771.16	3,045,735,538.63	0.00	0.00%
		20180411					
	4	20180425 -	3,003,391,767.47	42,343,771.16	3,045,735,538.63	0.00	0.00%
		20180607					
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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日