

# 东吴货币市场证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十七日

## § 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。本半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 8 月 22 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 6.2 利润表.....                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |

|   |           |
|---|-----------|
| 6.4 报表附注.....                               | 19        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                         | 39        |
| 7.2 债券回购融资情况.....                           | 39        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                       | 39        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....        | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                   | 40        |
| 7.6 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.....     | 41        |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....         | 41        |
| 7.8 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..... | 41        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                           | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                    | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                  | 43        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....                 | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....               | 44        |
| 8.4 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.....      | 44        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                    | <b>44</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                      | <b>45</b> |
| 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....          | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                 | 45        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....                 | 48        |
| 10.9 其他重大事件.....                            | 48        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>              | <b>50</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....    | 50        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                    | 50        |

|                         |           |
|-------------------------|-----------|
| <b>§12 备查文件目录</b> ..... | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录.....        | 51        |
| 12.2 存放地点.....          | 51        |
| 12.3 查阅方式.....          | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 东吴货币市场证券投资基金       |                    |
| 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      | 3,047,837,026.68 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 | 145,210,507.30 份   | 2,902,626,519.38 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         | 010-68121816       |
| 注册地址    |      | 上海浦东源深路 279 号             | 北京市东城区建国门内大街 69 号  |

|       |               |                              |
|-------|---------------|------------------------------|
| 办公地址  | 上海浦东源深路 279 号 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码  | 200135        | 100031                       |
| 法定代表人 | 王炯            | 周慕冰                          |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                   |
|----------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报             |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.scfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人及托管人办公处      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址          |
|--------|------------|---------------|
| 注册登记机构 | 东吴基金管理有限公司 | 上海浦东源深路 279 号 |

### § 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

| 基金级别          | 东吴货币 A                      | 东吴货币 B                      |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日) | 报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 1,067,833.82                | 70,252,326.83               |
| 本期利润          | 1,067,833.82                | 70,252,326.83               |
| 本期净值收益率       | 1.1530%                     | 1.2738%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)            |                             |
| 期末基金资产净值      | 145,210,507.30              | 2,902,626,519.38            |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                      | 1.0000                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019年6月30日)            |                             |
| 累计净值收益率       | 32.1421%                    | 34.8728%                    |

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① | 份额净值收益率标准差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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月      | 0.2183%  | 0.0033%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.1073%  | 0.0033% |
| 过去三个月      | 0.5978%  | 0.0022%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.2612%  | 0.0022% |
| 过去六个月      | 1.1530%  | 0.0017%     | 0.6695%    | 0.0000%       | 0.4835%  | 0.0017% |
| 过去一年       | 2.4731%  | 0.0022%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 1.1231%  | 0.0022% |
| 过去三年       | 9.5115%  | 0.0024%     | 4.0500%    | 0.0000%       | 5.4615%  | 0.0024% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.1421% | 0.0060%     | 12.5198%   | 0.0001%       | 19.6223% | 0.0059% |

## 东吴货币 B

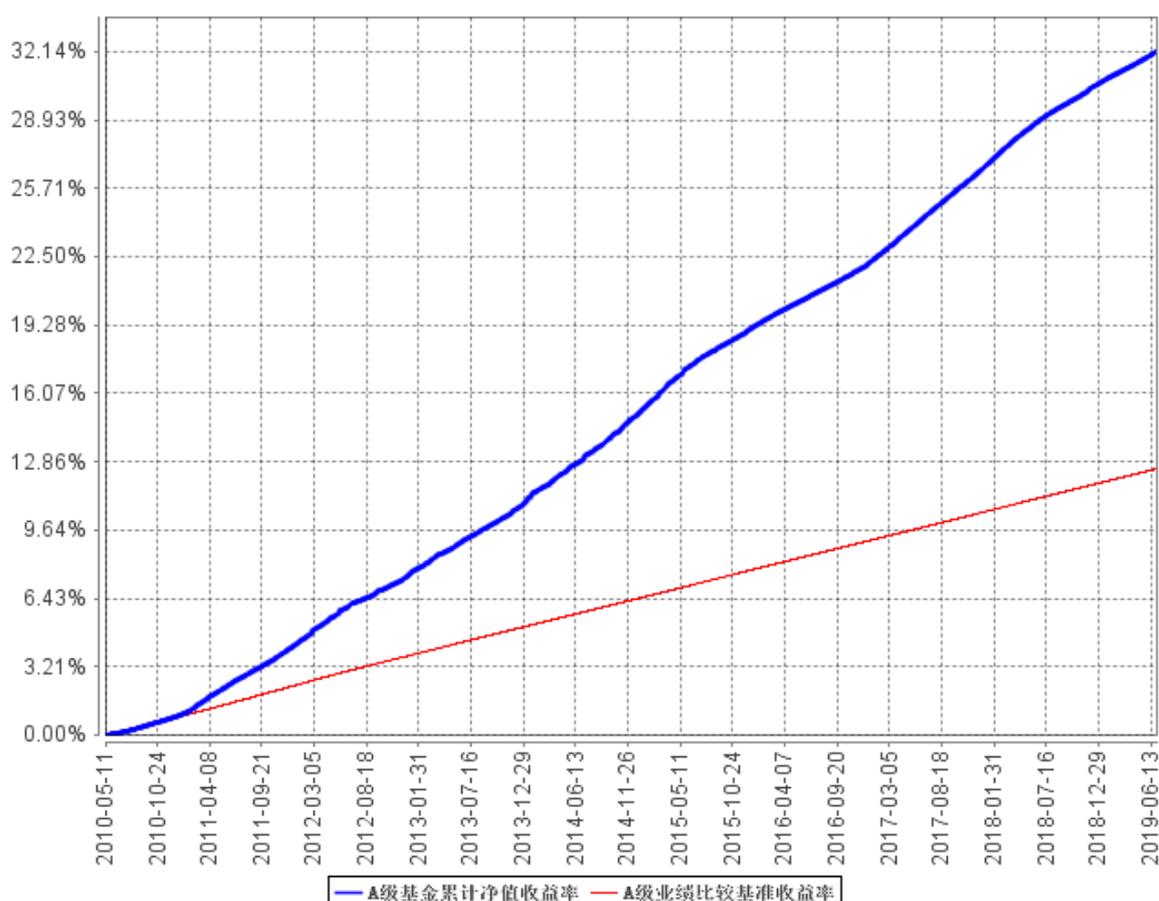
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.2377%      | 0.0033%             | 0.1110%            | 0.0000%               | 0.1267%  | 0.0033% |
| 过去三个月          | 0.6576%      | 0.0022%             | 0.3366%            | 0.0000%               | 0.3210%  | 0.0022% |
| 过去六个月          | 1.2738%      | 0.0017%             | 0.6695%            | 0.0000%               | 0.6043%  | 0.0017% |
| 过去一年           | 2.7191%      | 0.0022%             | 1.3500%            | 0.0000%               | 1.3691%  | 0.0022% |
| 过去三年           | 10.3025%     | 0.0024%             | 4.0500%            | 0.0000%               | 6.2525%  | 0.0024% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 34.8728%     | 0.0057%             | 12.5198%           | 0.0001%               | 22.3530% | 0.0056% |

注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

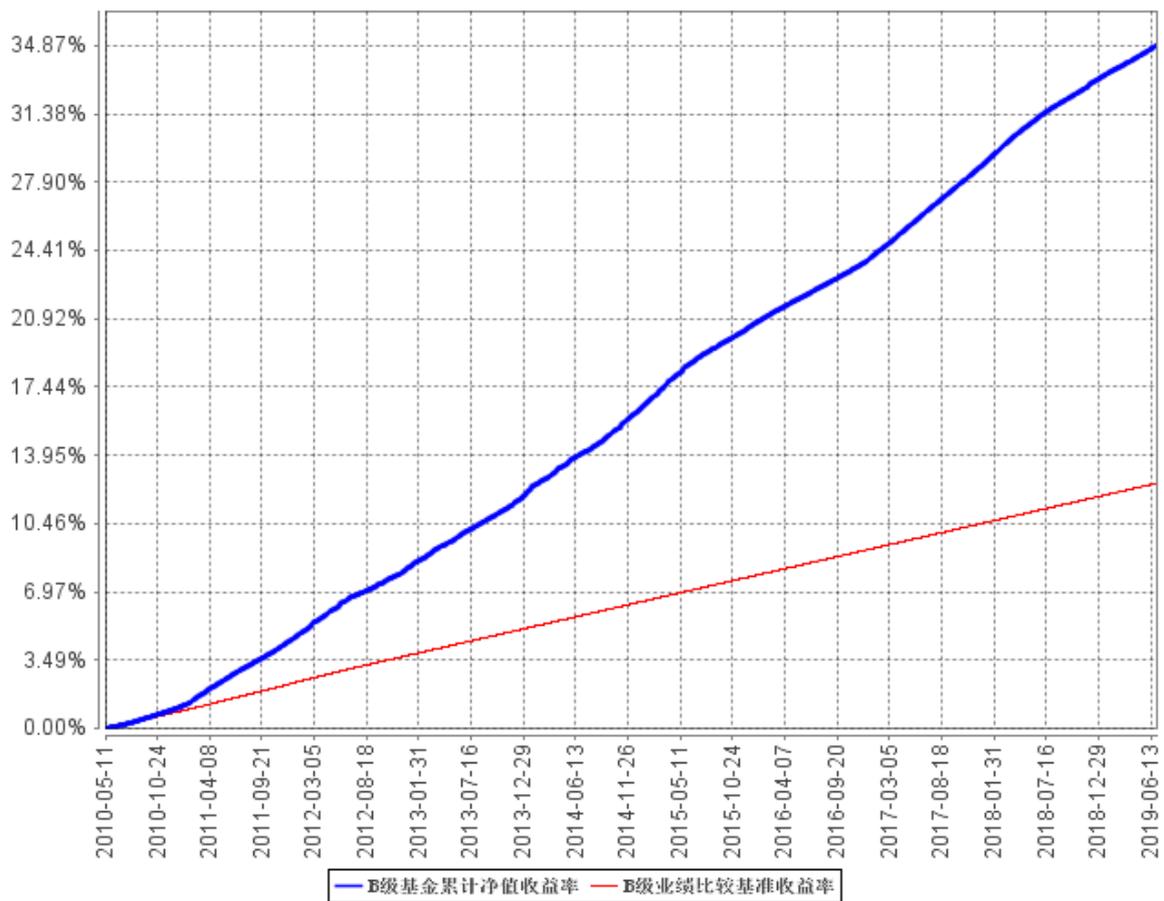
2、本基金收益分配按日结转份额。

### 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。

## § 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。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 2019 年 6 月末,公司旗下管理着 29 只公募基金,资产管理总规模 688 亿元(包括专户、专项资产管理规模),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。

#### 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，自 2019 年 4 月 1 日起担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理。   |
| 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。

#### 4.3.2 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。

### 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

1 月初，经济延续去年的下滑态势，PMI 跌破 50 的枯荣线，央行下调存款准备金率 1 个百分点，10 年期国开债收益率自 3.64% 下行至 3.47%。1 月中旬至 2 月底，10 年期国开债收益率转而上行至 3.7% 左右。一方面，国家通过减税、支持银行发行永续债等方式加大宽信用的力度，1 月份社融数据大幅超预期，另外一方面，股票市场持续上行，市场风险偏好提升。3 月，经济数据进一步下行，且社融数据回落，10 年期国开债收益率下行至最低 3.57% 附近。

3 月底 4 月初，PMI 数据超预期上行至 50.5，中微观数据显示经济在逐步回暖，同时货币市场价格走高，引发市场对央行货币政策边际趋紧的猜测。债券市场调整，10 年期国开债收益率最高上行至 3.88% 左右。4 月末，央行加大公开市场力度，并开展定向中期借贷便利，货币市场价格回落。4 月和 5 月，PMI 逐步回落至 50.1 和 49.40，工业增加值当月同比也大幅下滑至 5.4% 和 5%，经济增速下滑的压力逐步显现，10 年期国开债收益率逐步下行，6 月末至 3.6% 附近。

本基金资产配置：以存款和 CD 为主。

#### 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 1.1530%，本报告期东吴货币 B 的基金份额净值收益率为 1.2738%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国际方面来看，美国、欧洲等主要经济体经济增速下滑压力加大，美联储降息预期提升。外部经济环境不利于国内经济增长。国内方面，无论企业债务还是居民债务都处于高位，以民营企业为代表的企业主体违约不断，债券、信托、资管计划等违约风险加大。包商银行的债务处理引发了市场对商业银行债务违约的担忧。受债务约束等因素影响，制造业投资和基建投资增速都维持在低位。PMI 从业人员指数自今年以来持续下滑，对消费增长也带来不利的影响。为了促进经济增长，政府采取减税、支持中小微企业等措施，社会融资增速存量同比增长 10.92%。未来经济增速能否企稳，尚需要观察。

另外一方面，铁矿石、焦炭等价格持续上涨，南华工业品指数维持在高位。猪瘟等因素导致猪肉价格走高，6 月 CPI 同比增长 2.7%。未来通货膨胀的压力仍然值得关注。

#### 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、每日支付”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本报告期东吴货币 A 级基金应分配收益 1,067,833.82 元，实际分配收益 1,067,833.82 元；东吴货币 B 级基金应分配收益 70,252,326.83 元，实际分配收益 70,252,326.83 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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 托管人对本半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半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：东吴货币市场证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 350,724,975.99                 | 3,144,261,674.17                 |
| 结算备付金           |            | 1,388,730.00                   | 36,392,480.01                    |
| 存出保证金           |            | 4,652.05                       | 97,057.91                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,113,794,534.79               | 2,075,976,061.28                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 2,113,794,534.79               | 2,040,976,061.28                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | 35,000,000.00                    |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 803,539,661.31                 | 982,481,633.73                   |
| 应收证券清算款         |            | -                              | 672,750.00                       |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 16,968,818.73                  | 22,287,186.81                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 3,146,217.11                   | 63,466,365.00                    |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 3,289,567,589.98               | 6,325,635,208.91                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 239,999,680.00                 | 199,984,500.02                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 99.40                          | 298.80                           |
| 应付管理人报酬         |            | 1,080,840.85                   | 3,693,793.95                     |
| 应付托管费           |            | 327,527.52                     | 1,119,331.51                     |
| 应付销售服务费         |            | 49,782.46                      | 161,957.96                       |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 65,985.18                      | 115,260.34                       |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费          |          | 61,480.36        | 32,521.68        |
| 应付利息          |          | 32,867.95        | 104,387.48       |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 112,299.58       | 99,480.89        |
| 负债合计          |          | 241,730,563.30   | 205,311,532.63   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 3,047,837,026.68 | 6,120,323,676.28 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -                | -                |
| 所有者权益合计       |          | 3,047,837,026.68 | 6,120,323,676.28 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 3,289,567,589.98 | 6,325,635,208.91 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,047,837,026.68 份。其中东吴货币 A 级的基金份额为 145,210,507.30 份，东吴货币 B 级的基金份额为 2,902,626,519.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2019年1月1日至2019<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018<br>年6月30日 |
|-----------------------|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 85,617,426.83                  | 221,813,480.12                      |
| 1.利息收入                |            | 84,271,620.21                  | 222,506,036.05                      |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 31,187,467.43                  | 69,375,817.58                       |
| 债券利息收入                |            | 32,886,379.02                  | 96,506,746.45                       |
| 资产支持证券利息收入            |            | 501,468.30                     | 95,970.19                           |
| 买入返售金融资产收入            |            | 19,696,305.46                  | 56,527,501.83                       |
| 其他利息收入                |            | -                              | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 1,345,806.62                   | -692,555.93                         |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -                              | -                                   |
| 基金投资收益                |            | -                              | -                                   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 1,345,806.62                   | -692,555.93                         |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.2 | -                              | -                                   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14   | -                              | -                                   |
| 股利收益                  | 6.4.7.15   | -                              | -                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16   | -                              | -                                   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                              | -                                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | -                              | -                                   |

|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 列)                         |            |               |                |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 14,297,266.18 | 25,292,815.37  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 9,344,963.69  | 16,845,095.98  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,831,807.17  | 5,104,574.53   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 393,872.06    | 607,061.23     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18   | 679.55        | 60.30          |
| 5. 利息支出                    |            | 1,541,763.16  | 2,537,841.68   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,541,763.16  | 2,537,841.68   |
| 6. 税金及附加                   |            | 26,354.41     | 52,839.67      |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 157,826.14    | 145,341.98     |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 71,320,160.65 | 196,520,664.75 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 71,320,160.65 | 196,520,664.75 |

### 6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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)                        | 6,120,323,676.28                      | -              | 6,120,323,676.28   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                     | 71,320,160.65  | 71,320,160.65      |
| 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)      | -3,072,486,649.60                     | -              | -3,072,486,649.60  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 10,475,565,956.79                     | -              | 10,475,565,956.79  |
| 2. 基金赎回款                               | -13,548,052,606.39                    | -              | -13,548,052,606.39 |
| 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) | -                                     | -71,320,160.65 | -71,320,160.65     |

|  |                                 |                 |                    |
|--|---------------------------------|-----------------|--------------------|
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 3,047,837,026.68                | -               | 3,047,837,026.68   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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)               | -                               | 196,520,664.75  | 196,520,664.75     |
| 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)      | -3,254,204,833.87               | -               | -3,254,204,833.87  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 29,598,947,770.59               | -               | 29,598,947,770.59  |
| 2. 基金赎回款                               | -32,853,152,604.46              | -               | -32,853,152,604.46 |
| 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) | -                               | -196,520,664.75 | -196,520,664.75    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 7,050,296,855.41                | -               | 7,050,296,855.41   |

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：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>王炯</u> | <u>徐明</u> | <u>吴婷</u> |
| 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）。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“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 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。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1. 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 724,975.99             |
| 定期存款           | 350,000,000.00         |
| 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    | 350,000,000.00         |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 350,724,975.99         |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |                  |                  |              |         |
|--------|------------------------|------------------|------------------|--------------|---------|
|        | 摊余成本                   | 影子定价             | 偏离金额             | 偏离度          |         |
| 债券     | 交易所市场                  | 6,996,258.81     | 7,000,700.00     | 4,441.19     | 0.0001% |
|        | 银行间市场                  | 2,106,798,275.98 | 2,111,845,000.00 | 5,046,724.02 | 0.1656% |
|        | 合计                     | 2,113,794,534.79 | 2,118,845,700.00 | 5,051,165.21 | 0.1657% |
| 资产支持证券 | -                      | -                | -                | -            |         |
| 合计     | 2,113,794,534.79       | 2,118,845,700.00 | 5,051,165.21     | 0.1657%      |         |

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2019年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 803,539,661.31    | -         |
| 合计    | 803,539,661.31    | -         |

##### 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 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 232.76            |
| 应收定期存款利息   | 744,124.87        |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 624.90            |
| 应收债券利息     | 15,732,404.84     |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | 491,429.26        |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 2.10              |
| 合计         | 16,968,818.73     |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 65,985.18         |
| 合计          | 65,985.18         |

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 0.60              |
| 应付汇划费       | 600.00            |
| 应付审计费       | 44,630.98         |
| 应付信息披露费     | 58,214.16         |
| 应付中债账户维护费   | 4,426.92          |
| 应付上清所账户维护费  | 4,426.92          |
| 合计          | 112,299.58        |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 东吴货币 A        |                            |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                 |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 230,739,945.72             | 230,739,945.72  |
| 本期申购          | 219,223,563.07             | 219,223,563.07  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -304,753,001.49            | -304,753,001.49 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -               |
| 本期申购          | -                          | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -               |
| 本期末           | 145,210,507.30             | 145,210,507.30  |

金额单位：人民币元

| 东吴货币 B        |                            |                    |
|---------------|----------------------------|--------------------|
| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                    |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额               |
| 上年度末          | 5,889,583,730.56           | 5,889,583,730.56   |
| 本期申购          | 10,256,342,393.72          | 10,256,342,393.72  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -13,243,299,604.90         | -13,243,299,604.90 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -                  |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -                  |
| 本期申购          | -                          | -                  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -                  |

|     |                  |                  |
|-----|------------------|------------------|
| 本期末 | 2,902,626,519.38 | 2,902,626,519.38 |
|-----|------------------|------------------|

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 东吴货币 A         |               |       |               |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 1,067,833.82  | -     | 1,067,833.82  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -     | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -     | -             |
| 基金赎回款          | -             | -     | -             |
| 本期已分配利润        | -1,067,833.82 | -     | -1,067,833.82 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

单位：人民币元

| 东吴货币 B         |                |       |                |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 70,252,326.83  | -     | 70,252,326.83  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -70,252,326.83 | -     | -70,252,326.83 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 18,917.13                  |
| 定期存款利息收入  | 31,118,121.14              |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 49,566.01                  |
| 其他        | 863.15                     |
| 合计        | 31,187,467.43              |

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 7,199,095,534.70           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 7,127,514,598.05           |
| 减：应收利息总额               | 70,235,130.03              |
| 买卖债券差价收入               | 1,345,806.62               |

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 36,122,200.00              |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 35,000,000.00              |
| 减：应收利息总额       | 1,122,200.00               |
| 资产支持证券投资收益     | 0.00                       |

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.14.2 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。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.17 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | -                                     |
| 银行间市场交易费用 | 679.55                                |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 679.55                                |

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用   | 44,630.98                             |
| 信息披露费  | 58,214.16                             |
| 银行汇划费用 | 36,527.16                             |
| 其他费用   | 300.00                                |
| 账户维护费  | 18,153.84                             |
| 合计     | 157,826.14                            |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称        | 与本基金的关系             |
|--------------|---------------------|
| 东吴基金管理有限公司   | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 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     |

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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 |
| 东吴证券股份有限公司 | -                          | -            | 542,669,784.29                  | 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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 | 4,693,078,000.00           | 100.00%        | 17,879,928,000.00               | 76.97%         |

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30 |
|----|-------------------------|--------------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------------|

|                 | 30 日         | 日             |
|-----------------|--------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 9,344,963.69 | 16,845,095.98 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 561,853.16   | 65,720.07     |

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,831,807.17                    | 5,104,574.53                    |

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。

#### 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                              |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
|                | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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     | 11,557.79                       | 235,400.33 | 246,958.12 |

|                |                                 |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
| 中国农业银行股份有限公司   | 15,740.09                       | 430.14     | 16,170.23  |
| 东吴证券股份有限公司     | 613.29                          | 0.00       | 613.29     |
| 合计             | 27,911.17                       | 235,830.47 | 263,741.64 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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     | 22,004.37                       | 497,620.75 | 519,625.12 |
| 中国农业银行股份有限公司   | 14,668.51                       | 0.00       | 14,668.51  |
| 东吴证券股份有限公司     | 1,786.10                        | 5.37       | 1,791.47   |
| 合计             | 38,458.98                       | 497,626.12 | 536,085.10 |

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。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30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                    | 120,335,771.00 | -    | -     | -    | 429,200,000.00 | 60,961.10 |
| 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                |      |       |      |                |           |
| 银行间市场交                          | 债券交易金额         |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |

| 易的<br>各关联方名称 | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额 | 利息支出 |
|--------------|------|------|----------|----------|------|------|
| -            | -    | -    | -        | -        | -    | -    |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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<br>名称        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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   |
| 中国农业银行<br>股份有限公司 | 724,975.99                 | 18,917.13 | 608,267.93                      | 7,045.94 |

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 东吴货币A

| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配<br>合计 | 备注 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,067,833.82 | -                 | -            | 1,067,833.82 | -  |

##### 东吴货币B

| 已按再投资形式转实收基金  | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|---------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 70,252,326.83 | -                 | -            | 70,252,326.83 | -  |

## 6.4.12 期末（2019 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/增发证券而流通受限证券。

### 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 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 239,999,680.00 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         |
|--------|------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 199924 | 19 贴现国债 24 | 2019 年 7 月 1 日 | 98.91  | 500,000   | 49,456,981.59  |
| 130213 | 13 国开 13   | 2019 年 7 月 1 日 | 99.94  | 300,000   | 29,983,243.64  |
| 130217 | 13 国开 17   | 2019 年 7 月 1 日 | 99.80  | 210,000   | 20,957,876.60  |
| 130235 | 13 国开 35   | 2019 年 7 月 1 日 | 99.79  | 900,000   | 89,806,845.83  |
| 160313 | 16 进出 13   | 2019 年 7 月 1 日 | 100.13 | 500,000   | 50,063,867.77  |
| 合计     |            |                |        | 2,410,000 | 240,268,815.43 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。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。

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金结合宏观与微观、定性与定量分析，根据国内外宏观经济形势及经济金融政策趋势等因素的分析，对货币市场基金允许投资的金融工具，从收益率、流动性、风险、久期等角度入手，辅以敏感性分析及金融工程技术，进行综合分析，在严格控制风险的前提下，采取积极主动的投

资金管理，满足投资者对于高流动性和低风险投资的需求。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款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。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

- 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；
- 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：
  - i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；
  - ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。
- 3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。
- 4) 本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个交易日内对其予以全部减持。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 420,237,732.94         | 150,000,000.00           |

|        |                  |                |
|--------|------------------|----------------|
| A-1 以下 | -                | -              |
| 未评级    | 857,831,446.40   | 539,725,489.99 |
| 合计     | 1,278,069,179.34 | 689,725,489.99 |

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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | 35,000,000.00       |
| 合计     | -                 | 35,000,000.00       |

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 407,700,431.22    | 824,370,724.65      |
| 合计     | 407,700,431.22    | 824,370,724.65      |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 178,125,059.64    | 127,425,141.98      |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 249,899,864.59    | 399,454,704.66      |
| 合计     | 428,024,924.23    | 526,879,846.64      |

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》、《货币市场基金监督管理办法》、《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。

本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市。本基金所持有的买入返售金融资产期限在一个月以内，因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月30<br>日 | 1个月以内        | 1-3个月          | 3个月-1年         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计             |
|-----------------------|--------------|----------------|----------------|------|------|-----|----------------|
| 资产                    |              |                |                |      |      |     |                |
| 银行存款                  | 724,975.99   | 200,000,000.00 | 150,000,000.00 | -    | -    | -   | 350,724,975.99 |
| 清算备付金                 | 1,388,730.00 | -              | -              | -    | -    | -   | 1,388,730.00   |

|                          |                  |                  |                |               |       |               |                  |
|--------------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|-------|---------------|------------------|
| 存出保证金                    | 4,652.05         | -                | -              | -             | -     | -             | 4,652.05         |
| 交易性金融资产                  | 200,120,195.83   | 1,293,313,011.65 | 530,554,481.48 | 89,806,845.83 | -     | -             | 2,113,794,534.79 |
| 衍生金融资产                   | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 买入返售金融资产                 | 803,539,661.31   | -                | -              | -             | -     | -             | 803,539,661.31   |
| 应收证券清算款                  | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 应收利息                     | -                | -                | -              | -             | -     | 16,968,818.73 | 16,968,818.73    |
| 应收股利                     | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 应收申购款                    | -                | -                | -              | -             | -     | 3,146,217.11  | 3,146,217.11     |
| 其他资产                     | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 资产总计                     | 1,005,778,215.18 | 1,493,313,011.65 | 680,554,481.48 | 89,806,845.83 | -     | 20,115,035.84 | 3,289,567,589.98 |
| 负债                       | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 卖出回购证券款                  | 239,999,680.00   | -                | -              | -             | -     | -             | 239,999,680.00   |
| 应付证券清算款                  | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 应付赎回款                    | -                | -                | -              | -             | -     | 99.40         | 99.40            |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -              | -             | -     | 1,080,840.85  | 1,080,840.85     |
| 应付托管费                    | -                | -                | -              | -             | -     | 327,527.52    | 327,527.52       |
| 应付销售服务费                  | -                | -                | -              | -             | -     | 49,782.46     | 49,782.46        |
| 应付交易费用                   | -                | -                | -              | -             | -     | 65,985.18     | 65,985.18        |
| 应交税金                     | -                | -                | -              | -             | -     | 61,480.36     | 61,480.36        |
| 应付利息                     | -                | -                | -              | -             | -     | 32,867.95     | 32,867.95        |
| 应付利润                     | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 其他负债                     | -                | -                | -              | -             | -     | 112,299.58    | 112,299.58       |
| 负债总计                     | 239,999,680.00   | -                | -              | -             | -     | 1,730,883.30  | 241,730,563.30   |
| 利率敏感度缺口                  | 765,778,535.18   | 1,493,313,011.65 | 680,554,481.48 | 89,806,845.83 | -     | 18,384,152.54 | 3,047,837,026.68 |
| 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 | 1 个月以内           | 1-3 个月           | 3 个月-1 年       | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                  |                  |                |               |       |               |                  |
| 银行存款                     | 634,261,674.17   | 2,210,000,000.00 | 300,000,000.00 | -             | -     | -             | 3,144,261,674.17 |
| 清算备付金                    | 36,392,480.01    | -                | -              | -             | -     | -             | 36,392,480.01    |
| 存出保证金                    | 97,057.91        | -                | -              | -             | -     | -             | 97,057.91        |
| 交易性金融资产                  | 279,416,659.09   | 1,352,295,858.00 | 444,263,544.19 | -             | -     | -             | 2,075,976,061.28 |
| 衍生金融资产                   | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 买入返售金融资产                 | 982,481,633.73   | -                | -              | -             | -     | -             | 982,481,633.73   |
| 应收证券清算款                  | -                | -                | -              | -             | -     | 672,750.00    | 672,750.00       |
| 应收利息                     | -                | -                | -              | -             | -     | 22,287,186.81 | 22,287,186.81    |
| 应收股利                     | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 应收申购款                    | -                | -                | -              | -             | -     | 63,466,365.00 | 63,466,365.00    |
| 其他资产                     | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 资产总计                     | 1,932,649,504.91 | 3,562,295,858.00 | 744,263,544.19 | -             | -     | 86,426,301.81 | 6,325,635,208.91 |
| 负债                       | -                | -                | -              | -             | -     | -             | -                |
| 卖出回购金融资产                 | 199,984,500.02   | -                | -              | -             | -     | -             | 199,984,500.02   |

|         |                  |                  |                |   |   |                |                  |
|---------|------------------|------------------|----------------|---|---|----------------|------------------|
| 款       |                  |                  |                |   |   |                |                  |
| 应付证券清算款 | -                | -                | -              | - | - | -              | -                |
| 应付赎回款   | -                | -                | -              | - | - | 298.80         | 298.80           |
| 应付管理人报酬 | -                | -                | -              | - | - | 3,693,793.95   | 3,693,793.95     |
| 应付托管费   | -                | -                | -              | - | - | 1,119,331.51   | 1,119,331.51     |
| 应付销售服务费 | -                | -                | -              | - | - | 161,957.96     | 161,957.96       |
| 应付交易费用  | -                | -                | -              | - | - | 115,260.34     | 115,260.34       |
| 应交税费    | -                | -                | -              | - | - | 32,521.68      | 32,521.68        |
| 应付利息    | -                | -                | -              | - | - | 104,387.48     | 104,387.48       |
| 应付利润    | -                | -                | -              | - | - | -              | -                |
| 其他负债    | -                | -                | -              | - | - | 99,480.89      | 99,480.89        |
| 负债总计    | 199,984,500.02   | -                | -              | - | - | 5,327,032.61   | 205,311,532.63   |
| 利率敏感度缺口 | 1,732,665,004.89 | 3,562,295,858.00 | 744,263,544.19 | - | - | -81,099,269.20 | 6,120,323,676.28 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |   |                                 |                        |
|----|---|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 1、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。 |                                 |                        |
|    | 2、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。        |                                 |                        |
|    | 3、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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |   | 本期末（2019 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
|    | 利率下降 25 个基点                                     | 1,005,472.64                    | 950,903.23             |
|    | 利率上升 25 个基点                                     | -1,002,410.78                   | -948,057.41            |

#### 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，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 2,113,794,534.79 | 64.26         |
|    | 其中:债券             | 2,113,794,534.79 | 64.26         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 803,539,661.31   | 24.43         |
|    | 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      | 352,113,705.99   | 10.70         |
| 4  | 其他各项资产            | 20,119,687.89    | 0.61          |
| 5  | 合计                | 3,289,567,589.98 | 100.00        |

### 7.2 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 | 2.47           |                |
|    | 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 | 239,999,680.00 | 7.87           |
|    | 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

本基金本报告期无债券正回购资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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    | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 62 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 24 |

### 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。

#### 7.3.2 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                 | 36.93               | 7.87                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 23.24               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 26.74               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 3.60                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 16.76               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                        | 107.27              | 7.87                |

#### 7.4 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。

#### 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                 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | 69,375,352.55    | 2.28          |
| 2  | 央行票据                 | -                | -             |
| 3  | 金融债券                 | 380,273,844.52   | 12.48         |
|    | 其中：政策性金融债            | 279,890,108.27   | 9.18          |
| 4  | 企业债券                 | 77,741,323.39    | 2.55          |
| 5  | 企业短期融资券              | 1,178,703,583.11 | 38.67         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -             |
| 7  | 同业存单                 | 407,700,431.22   | 13.38         |
| 8  | 其他                   | -                | -             |
| 9  | 合计                   | 2,113,794,534.79 | 69.35         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -             |

## 7.6 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<br>(张) | 摊余成本           | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
|----|-----------|---------------|-------------|----------------|-------------------|
| 1  | 1628017   | 16 民生银行 01    | 1,000,000   | 100,383,736.25 | 3.29              |
| 2  | 71900023  | 19 浙商证券 CP001 | 1,000,000   | 100,086,036.37 | 3.28              |
| 3  | 11901403  | 19 苏交通 SCP014 | 1,000,000   | 99,964,611.85  | 3.28              |
| 4  | 11901343  | 19 华能 SCP005  | 1,000,000   | 99,900,604.68  | 3.28              |
| 5  | 11901182  | 19 苏交通 SCP008 | 1,000,000   | 99,878,742.42  | 3.28              |
| 6  | 71900036  | 19 中信 CP005   | 1,000,000   | 99,772,445.14  | 3.27              |
| 7  | 11900396  | 19 中电信 SCP003 | 1,000,000   | 99,691,808.54  | 3.27              |
| 8  | 11900728  | 19 南电 SCP014  | 1,000,000   | 99,592,434.46  | 3.27              |
| 9  | 111909154 | 19 浦发银行 CD154 | 1,000,000   | 99,538,969.50  | 3.27              |
| 10 | 111994117 | 19 南京银行 CD020 | 1,000,000   | 99,358,709.08  | 3.26              |

## 7.7 “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                   | 0.1797% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0332% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.1015% |

### 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。

## 7.8 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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。

### 7.9.3 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   | 4,652.05      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 16,968,818.73 |
| 4  | 应收申购款   | 3,146,217.11  |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 20,119,687.89 |

### 7.9.4 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。

## § 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 |
| 东吴货币 A | 132,577  | 1,095.29       | 5,658,024.80     | 3.90%   | 139,552,482.50 | 96.10% |
| 东吴货币 B | 24       | 120,942,771.64 | 2,902,626,519.38 | 100.00% | 0.00           | 0.00%  |
| 合计     | 132,601  | 22,985.02      | 2,908,284,544.18 | 95.42%  | 139,552,482.50 | 4.58%  |

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。

### 8.2 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  | 其他机构  | 657,418,446.65 | 21.57% |
| 2  | 银行类机构 | 501,978,758.29 | 16.47% |
| 3  | 券商类机构 | 303,564,567.86 | 9.96%  |
| 4  | 其他机构  | 251,751,338.40 | 8.26%  |
| 5  | 银行类机构 | 202,985,945.98 | 6.66%  |
| 6  | 其他机构  | 158,182,741.68 | 5.19%  |
| 7  | 银行类机构 | 152,391,851.33 | 5.00%  |
| 8  | 其他机构  | 102,712,107.80 | 3.37%  |
| 9  | 其他机构  | 100,273,838.18 | 3.29%  |
| 10 | 其他机构  | 70,100,251.61  | 2.30%  |

**8.3 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持有本基金 | 东吴货币 A | 172,071.93 | 0.1185%  |
|                  | 东吴货币 B | -          | -        |
|                  | 合计     | 172,071.93 | 0.0056%  |

**8.4 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。

**§ 9 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                   | 230,739,945.72   | 5,889,583,730.56  |
| 本报告期期间基金总申购份额                  | 219,223,563.07   | 10,256,342,393.72 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额                | 304,753,001.49   | 13,243,299,604.90 |
| 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                   | 145,210,507.30   | 2,902,626,519.38  |

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内管理人未发生重大的人事变动。

本基金本报告期内托管人发生以下人事变动：

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。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，制定相关整改措施，落实整改工作。

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东吴证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合 | 1 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期退租一个交易单元，为信达证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东吴证券 | -    | -            | 4,693,078,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 招商证券 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 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 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 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 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华泰联合 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 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。

## 10.9 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管理的基金 2018 年年度资产净值公告                        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2019 年 1 月 2 日  |
| 2  | 东吴货币市场证券投资基金 2018 年第 4 季度报告                           | 中国证券报、公司网站                            | 2019 年 1 月 19 日 |
| 3  | 东吴货币市场证券投资基金暂停大额申购（含定期定额）、大额转换转入业务的公告                 | 中国证券报、公司网站                            | 2019 年 1 月 24 日 |
| 4  | 东吴基金管理有限公司关于调整东吴货币市场证券投资基金申购最低金额和赎回及持有最低份额限制的公告       | 中国证券报、公司网站                            | 2019 年 2 月 20 日 |
| 5  | 东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站            | 2019 年 3 月 8 日  |
| 6  | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额、转换业务的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站            | 2019 年 3 月 8 日  |
| 7  | 东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金 A 级新增北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、公司网站                            | 2019 年 3 月 8 日  |
| 8  | 东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金调整基金份额升降级规则的公告              | 中国证券报、公司网站                            | 2019 年 3 月 8 日  |
| 9  | 东吴货币市场证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要                           | 中国证券报、公司网站                            | 2019 年 3 月 29 日 |
| 10 | 东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站            | 2019 年 4 月 17 日 |

|    |   |                            |                 |
|----|---|----------------------------|-----------------|
| 11 | 东吴货币市场证券投资基金 2019 年第 1 季度报告                                     | 中国证券报、公司网站                 | 2019 年 4 月 20 日 |
| 12 | 东吴基金管理有限公司关于东吴货币市场证券投资基金调整收益支付方式的公告                             | 中国证券报、公司网站                 | 2019 年 5 月 8 日  |
| 13 | 东吴货币市场证券投资基金 2019 年端午假期前暂停大额申购（含定期定额）、大额转换转入业务的公告               | 中国证券报、公司网站                 | 2019 年 6 月 3 日  |
| 14 | 东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金 A 类份额在北京肯特瑞基金销售有限公司开通“T+0 赎回提现业务”的公告 | 中国证券报、公司网站                 | 2019 年 6 月 12 日 |
| 15 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为代销机构的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2019 年 6 月 14 日 |
| 16 | 东吴基金管理有限公司关于参加华瑞保险销售有限公司费率优惠的公告                                 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2019 年 6 月 14 日 |
| 17 | 东吴货币市场证券投资基金更新招募说明书以及摘要   | 中国证券报、公司网站                 | 2019 年 6 月 24 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              | 20190627 - 20190630     | 648,162,321.71 | 9,133,475.56 | -    | 657,295,797.27 | 21.57% |
| 个人    | -              | -                       | -              | -            | -    | -              | -      |

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

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

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

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

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

##### 3. 流动性风险

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴货币市场证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴货币市场证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴货币市场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、报告期内东吴货币市场证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日