

东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2023 年 7 月 21 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	50
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	50
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.11 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	52
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4 基金投资策略的改变 .....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	55
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录 .....	59
13.2 存放地点 .....	59
13.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	东吴添瑞三个月定开债券	
基金主代码	018416	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 21 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	200,111,881.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴添瑞三个月定开债券 A	东吴添瑞三个月定开债券 C
下属分级基金的交易代码:	018416	018417
报告期末下属分级基金的份额总额	200,103,689.68 份	8,191.51 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极的投资管理，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济形势发展和变动趋势，基于对财政政策、货币政策和债券市场的综合研判，在遵守有关投资限制规定的前提下，灵活运用投资策略，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行大类资产配置的动态调整，力争在保障基金资产流动性和本金安全的前提下实现投资组合收益的最大化。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取利率预期策略、信用债投资策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型基金，理论上其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司

			司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	胡波
	联系电话	021-50509888-8308	021-61618888
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	021-31888888
传真		021-50509888-8211	021-63602540
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼 901、902 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		李素明	张为忠

注：基金管理人于 2023 年 6 月 28 日发布关于公司法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为李素明先生。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座（14 幢）20 楼
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

## § 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	2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	东吴添瑞三个月定开债券 A	东吴添瑞三个月定开债券 C
本期已实现收益	925,962.53	27.81
本期利润	2,338,294.69	85.65
加权平均基金份额本期利润	0.0100	0.0099
本期加权平均净值利润率	1.00%	0.99%
本期基金份额净值增长率	1.14%	1.04%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	863,826.85	27.62
期末可供分配基金份额利润	0.0043	0.0034
期末基金资产净值	202,381,985.51	8,277.01
期末基金份额净值	1.0114	1.0104
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	1.14%	1.04%

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金于 2023 年 7 月 21 日成立。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴添瑞三个月定开债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.00%	0.05%	0.82%	0.04%	0.18%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.14%	0.05%	0.62%	0.05%	0.52%	0.00%

东吴添瑞三个月定开债券 C

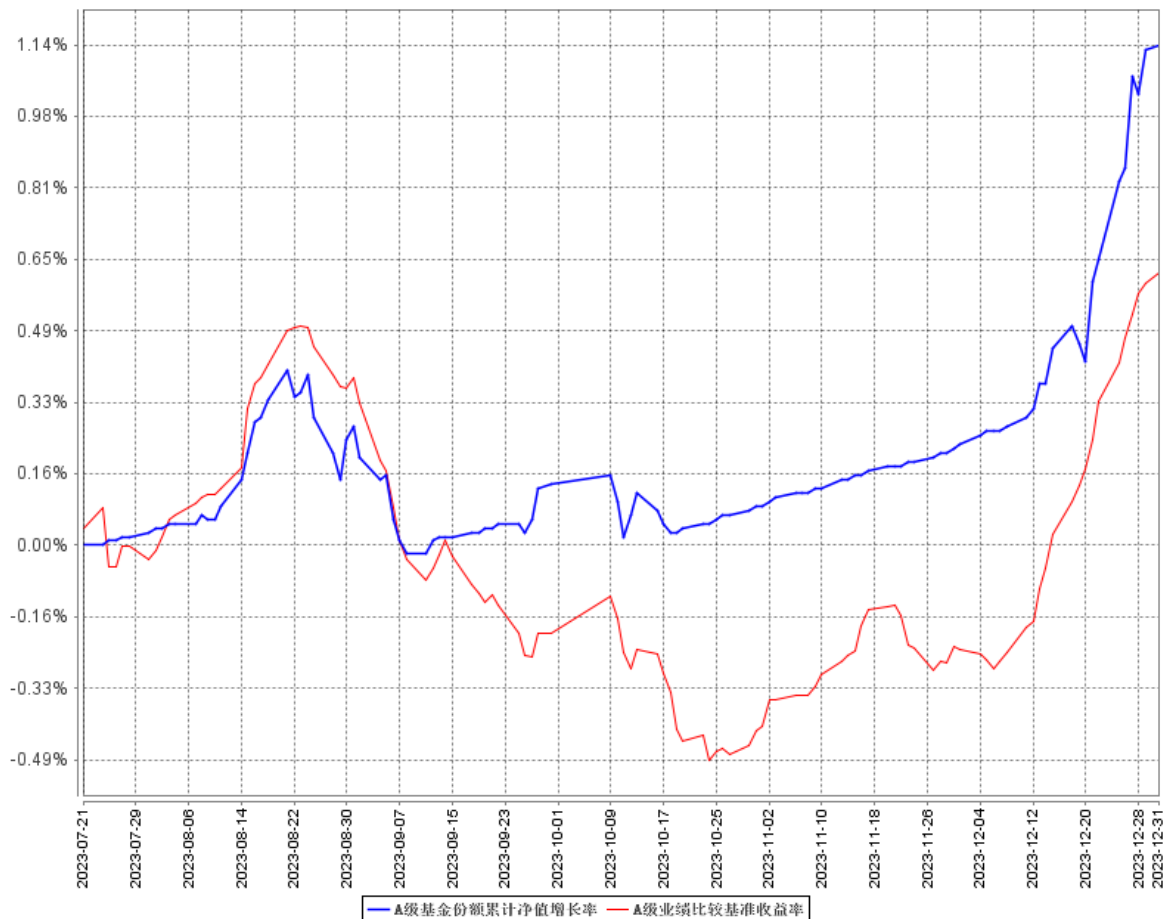
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.94%	0.05%	0.82%	0.04%	0.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.04%	0.05%	0.62%	0.05%	0.42%	0.00%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率；

2、本基金于 2023 年 7 月 21 日成立，本报告期末距基金合同生效不满一年。

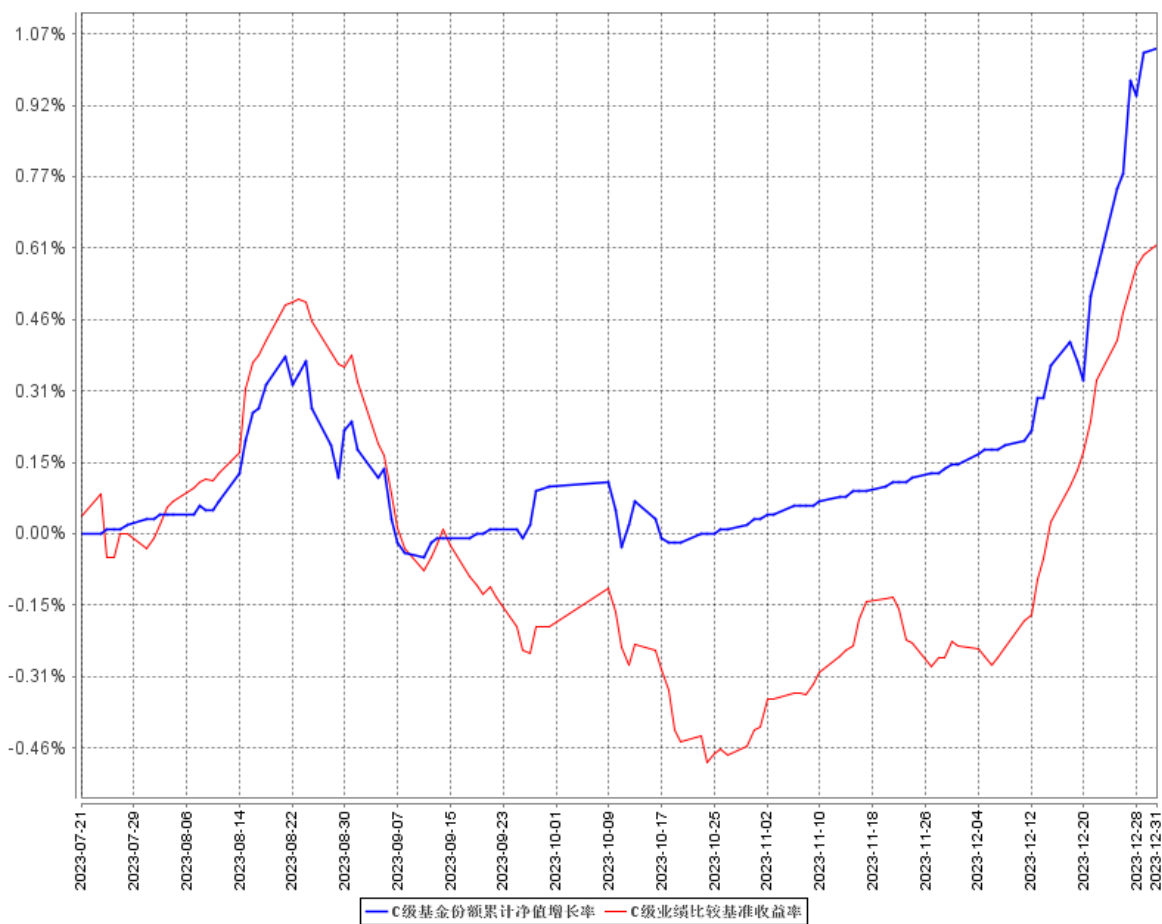
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





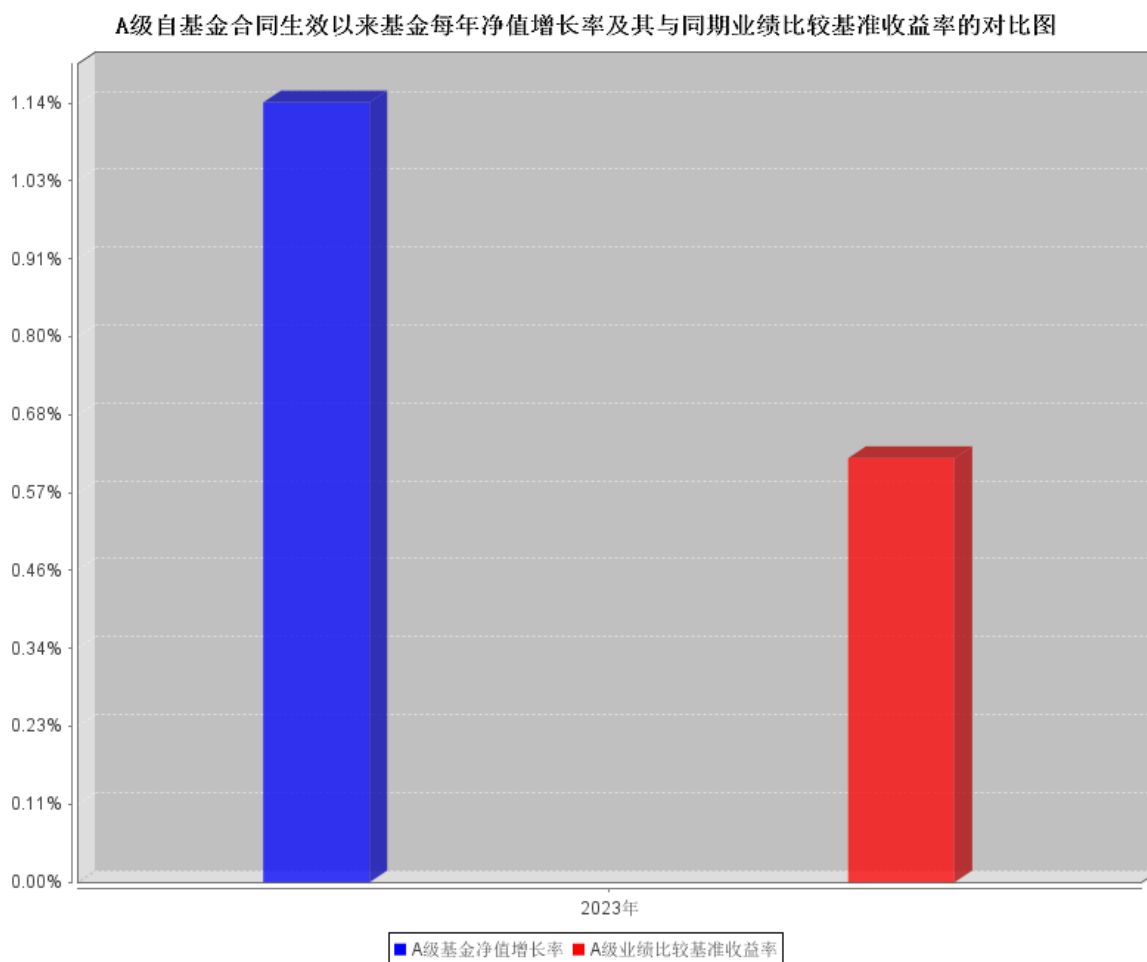
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

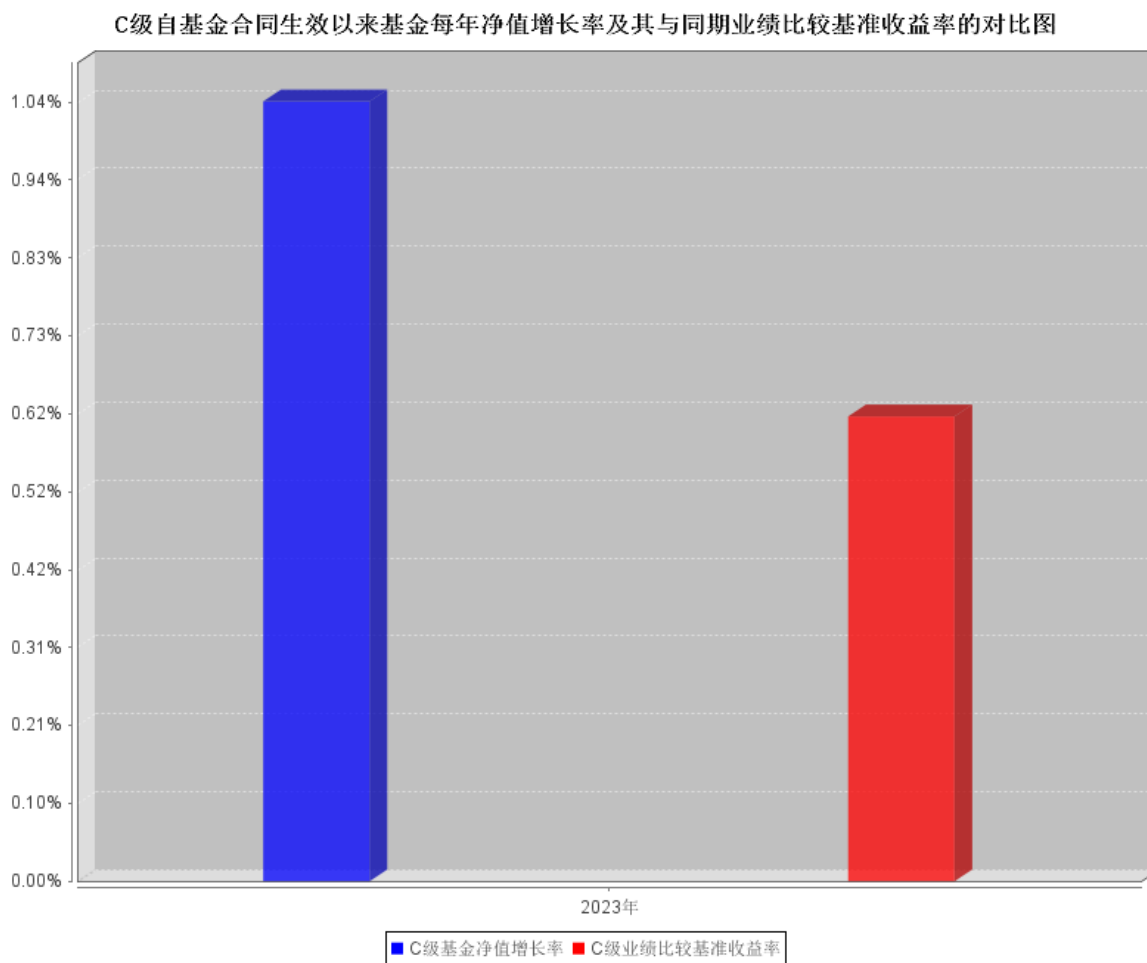


注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率；

2、本基金于 2023 年 7 月 21 日成立，本报告期末距基金合同生效不满一年。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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





注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率；

2、本基金于 2023 年 7 月 21 日成立，本报告期末距基金合同生效不满一年。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地为上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 901、902 室。目前由东吴证券股份有限公司和海澜集团有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”的东吴文化,追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来,在泛资管大背景下,公司推进公募基金、私募资产管理业务协同发展,涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求,进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵笛	基金经理	2023 年 7 月 21 日	-	17 年	邵笛先生,中国国籍,上海财经大学工商管理硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职上海广大律师事务所;上海文筑建筑咨询公司;上海永一房产咨询有限公司。2006 年 9 月起加入东吴基金管理有限公司,现任基金经理。2019 年 4 月 2 日至 2020 年 7 月 7 日担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理,2021 年 7 月 2 日至 2021 年 7 月 28 日担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金经理,2022 年 12 月 2 日至 2023 年 7 月 27 日担任东

					<p>吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日及 2022 年 12 月 2 日至今担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，2014 年 10 月 30 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 6 日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 7 月 21 日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>
侯慧娣	固收投资总监兼固定收益总部总经理、基金经理	2023 年 10 月 31 日	-	14 年	<p>侯慧娣女士，中国国籍，理学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职世商软件(上海)有限公司债券分析师，国信证券研究所固定收益分析师，德邦基金管</p>

				<p>理有限公司高级债券研究员、基金经理、固定收益部副总监，国联安基金管理有限公司基金经理，万家基金管理有限公司基金经理及现金管理部副总监(主持工作)，达诚基金管理有限公司总经理助理。2022 年 5 月加入东吴基金管理有限公司，现任固收投资总监兼固定收益总部总经理，2023 年 9 月 28 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2023 年 10 月 31 日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 10 月 31 日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 10 月 31 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2023 年 11 月 6 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、邵笛为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日，其他任职日期为公司对外公告日；

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。

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

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

## 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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

本基金管理人建立了严格的投资权限、研究管理、投资决策制度、投资备选库管理制度和集中交易制度，以保障各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会，并落实交易执行环节公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行交易指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，尽可能确保公平对待各投资组合，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对公司旗下所有投资组合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。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

根据统计局数据，2023 年 GDP 同比增长 5.2%，高于年初 5%目标，分季度看，同比增速呈前高后低的走势。经过一季度短暂的快速修复后，经济的疤痕效应显现，叠加外部美联储持续加息、各国制造业修复、需求回落等因素影响，国内经济表现出弱复苏的特征，总需求不足，市场信心有待重振。由于城镇化进程阶段性见顶，房地产与城投联动发展的模式出现根本性变化，叠加大环境影响，地产销售与投资受挫，拖累经济发展，同时对居民资产负债表产生较大冲击。货币政策保持适度宽松，今年央行两次降息，1 年期 MLF 利率由 2.75%降 25bp 至 2.5%，并进行了两次降准，共计 50bp。财政政策在下半年全面发力，通过一揽子化债措施、增发国债及各项产业政策，托底经济，改善市场预期。

2023 年债券市场长时间内处于上涨期，受基本面、货币政策和资金利率因素影响，呈现较为清晰的阶段性行情。年初至 2 月份，受经济复苏和资金利率影响，债市小幅调整；3 月后，资金面宽松，而基本面表现平淡，下行压力显现，债券收益率呈单边下行走势，在 8 月财政政策发力前下行至年内低点；9 至 10 月，受稳汇率及特殊再融资债和新增国债发行驱动，债市出现阶段性调整；11 月后，经济恢复动能偏弱，通胀大幅低于预期，存款利率再度下调，资金面宽松，债券收益率持续回落，年底接近 3 月份低位。信用债表现较利率债更强，受“资产荒”及一揽子化债推动，信用债尤其是中低等级城投债收益率出现大幅下行，市场需求由短端向中长端扩散。存单收益率走势和 10 年期国债走势基本一致，全年资金面保持宽松，仅在一季度和 10 月份略有收紧，央行通过超额续作 MLF 和大量 OMO 操作有效对冲季节性资金需求。

本基金在报告期内，以利率债为主要配置标的，根据市场变化以及对资金面的判断，适时调整组合久期及杠杆水平，在不同市场环境下，选择杠杆套息及波段交易等不同策略，结合利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化，据此确定组合的具体形态。合理安排融资结构，努力控制融资成本和市场调整风险，力争获取相对稳定收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴添瑞三个月定开债券 A 基金份额净值为 1.0114 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.14%；截至本报告期末东吴添瑞三个月定开债券 C 基金份额净值为 1.0104 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.04%；同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年国内经济仍有下行压力，宏观政策大概率继续偏宽松、偏扩张。基本面看，地产政策持续优化，销售和新开工情况有待改善，“三大工程”的增量对冲时间可能不会很早；2023 年出



口偏弱，有结构性亮点，2024 年可能依然面临着诸多未知扰动因素；消费在报复性反弹后或许会回归基本面走势。因此，货币政策方面，在支持实体经济修复和引导融资成本降低的目标下，央行大概率会维持稳健宽松的取向，通过降准降息、MLF、PSL 以及其他货币政策工具提供支持；财政方面，预计可能将保持适当的赤字率，加杠杆宽信用，通过进一步深化改革开放为经济注入增长动力。债券市场可能仍面临着经济增速下行和“资产荒”的局面，有望延续缓慢上行走势，期间也可能出现阶段性震荡，需根据基本面和政策面变化进行相应调整。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。重点关注基金投资研究交易、市场销售以及运营等环节的合法合规和风险控制，及时发现需要完善的业务环节，与相关部门沟通并向公司管理层报告，根据要求定期向公司治理层及监管部门报送相关情况报告。

同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。

本基金管理人将不断深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部）负责人、合规风控部负责人、产品策略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，公司总经理担任基金资产估值委员会主席，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。同时，基金资产估值委员会主席指定的其他人员可以列席会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；基金会计等参与基金组合估值方法的确定，

复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金自成立以来未进行过利润分配。

#### **4.9 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由东吴基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天衡审字(2024)00706 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日) 起至 2023 年 12 月 31 日的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日) 起至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金管理层(以下简称管理层)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估东吴添瑞三个月定期开放债券</p>

	<p>型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金不能持</p>

	<p>续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	纪纬   吴悦
会计师事务所的地址	中国·南京
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	34,974.05
结算备付金		12,169.07
存出保证金		7.91
交易性金融资产	7.4.7.2	269,848,480.76
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		269,848,480.76
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		269,895,631.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		67,270,998.04
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		51,242.32
应付托管费		17,080.76
应付销售服务费		1.42
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	166,046.73
负债合计		67,505,369.27
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	200,111,881.19
未分配利润	7.4.7.8	2,278,381.33
净资产合计		202,390,262.52
负债和净资产总计		269,895,631.79

报告截止日 2023 年 12 月 31 日，东吴添瑞三个月定开债券 A 基金份额净值 1.0114 元，基金份额总额 200,103,689.68 份；东吴添瑞三个月定开债券 C 基金份额净值 1.0104 元，基金份额总额 8,191.51 份。东吴添瑞三个月定开债券份额总额合计为 200,111,881.19 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		3,100,400.15
1.利息收入		1,043,100.74
其中：存款利息收入	7.4.7.9	453,251.89
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		589,848.85
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		644,908.17
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	644,908.17
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	1,412,390.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1.24
<b>减：二、营业总支出</b>		762,019.81



1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	313,450.16
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	104,483.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7.88
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		190,953.41
其中：卖出回购金融资产支出		190,953.41
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.18	153,125.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,338,380.34</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,338,380.34</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>2,338,380.34</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	250,111,721.21	-	250,111,721.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,999,840.02	2,278,381.33	-47,721,458.69
（一）、综合收益总额	-	2,338,380.34	2,338,380.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-49,999,840.02	-59,999.01	-50,059,839.03



## 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 7 月 21 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日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

### 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。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 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。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金

融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 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；

(4) 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 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 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；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(4) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(5) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(6) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基

基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基



金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法》、《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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	34,974.05
等于：本金	34,969.12
加：应计利息	4.93
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	34,974.05

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	263,925,610.00	4,510,480.76	269,848,480.76
	合计	263,925,610.00	4,510,480.76	269,848,480.76
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	263,925,610.00	4,510,480.76	269,848,480.76	1,412,390.00

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	16,546.73
其中：交易所市场	-
银行间市场	16,546.73
应付利息	-
应付信息披露费	100,000.00
应付中债账户维护费	4,500.00
应付上清所账户维护费	4,500.00
应付审计费	40,500.00
合计	166,046.73

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴添瑞三个月定开债券 A		
项目	本期 2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	250,102,739.69	250,102,739.69
本期申购	49.93	49.93
本期赎回(以“-”号填列)	-49,999,099.94	-49,999,099.94
本期末	200,103,689.68	200,103,689.68

金额单位：人民币元

东吴添瑞三个月定开债券 C		
项目	本期 2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	8,981.52	8,981.52
本期申购	49.97	49.97
本期赎回(以“-”号填列)	-839.98	-839.98
本期末	8,191.51	8,191.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴添瑞三个月定开债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	925,962.53	1,412,332.16	2,338,294.69
本期基金份额交易产生的变动数	-62,135.68	2,136.82	-59,998.86
其中：基金申购款	0.05	-	0.05
基金赎回款	-62,135.73	2,136.82	-59,998.91

本期已分配利润	-	-	-
本期末	863,826.85	1,414,468.98	2,278,295.83

单位：人民币元

东吴添瑞三个月定开债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	27.81	57.84	85.65
本期基金份额交易产生的变动数	-0.19	0.04	-0.15
其中：基金申购款	0.03	-	0.03
基金赎回款	-0.22	0.04	-0.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27.62	57.88	85.50

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年7月21日(基金合同生效日)至2023年12月31日
活期存款利息收入	9,082.27
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	444,169.59
其他	0.03
合计	453,251.89

#### 7.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年7月21日(基金合同生效日)至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,824,677.17
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-1,179,769.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	644,908.17

**7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月21日(基金合同生效日)至 2023年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	807,255,799.88
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	796,436,899.00
减:应计利息总额	11,987,169.88
减:交易费用	11,500.00
买卖债券差价收入	-1,179,769.00

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.14 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年7月21日(基金合同生效日)至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,412,390.00
——股票投资	-
——债券投资	1,412,390.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减:应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,412,390.00

**7.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月21日(基金合同生效日)至2023 年12月31日

基金赎回费收入	1.20
其他	0.04
合计	1.24

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月21日(基金合同生效日)至2023 年12月31日
审计费用	40,500.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	12,000.00
其他	400.00
银行汇划费用	225.00
合计	153,125.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付的关联方佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月21日(基金合同生效日)至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	313,450.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	75.34
应支付基金管理人的净管理费	313,374.82

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,483.36

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期末未产生关联方销售服务费。

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务。



#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未发生转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年7月21日(基金合同生效日)至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	34,974.05	9,082.27

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 67,270,998.04 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
230205	23 国开 05	2024 年 1 月 2 日	104.72	108,000	11,310,155.41
180210	18 国开 10	2024 年 1 月 2 日	108.42	600,000	65,049,508.20
合计				708,000	76,359,663.61

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济形势发展和变动趋势，基于对财政政策、货币政策和债券市场的综合研判，在遵守有关投资限制规定的前提下，灵活运用投资策略，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行大类资产配置动态调整，力争在保障基金资产流动性和本金安全的前提下实现投资组合收益的最大化。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

基于该投资目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临

各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的货币资金均存放于信用良好的银行，因而与货币资金相关的信用风险不重大。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金投资于信用评级在 AA+级及以上的信用债券（含资产支持证券，下同）。其中 AA+级信用债占本基金所投资的信用债比例为 0-50%；AAA 级信用债占本基金所投资的信用债比例为 50%-100%。其中，信用评级为债项评级，若无债项评级或债项评级为短期信用评级的，依照其主体评级。因评级下调不满足上述要求的，将在评级报告发布之日起 3 个月内调整至符合相应要求。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	269,848,480.76
合计	269,848,480.76

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	34,974.05	-	-	-	-	-	34,974.05
结算备付金	12,169.07	-	-	-	-	-	12,169.07
存出保证金	7.91	-	-	-	-	-	7.91
交易性金融资产	-	-	-	146,760,262.30	123,088,218.46	-	269,848,480.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	47,151.03	-	-	146,760,262.30	123,088,218.46	-	269,895,631.79
负债							
卖出回购金融资产款	67,270,998.04	-	-	-	-	-	67,270,998.04
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,242.32	51,242.32
应付托管费	-	-	-	-	-	17,080.76	17,080.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1.42	1.42
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	166,046.73	166,046.73
负债总计	67,270,998.04	-	-	-	-	234,371.23	67,505,369.27

利率敏感度缺口	-67,223,847.01	-	-146,760,262.30	123,088,218.46	-234,371.23	202,390,262.52
---------	----------------	---	-----------------	----------------	-------------	----------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2023 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	3,646,874.88
	基准利率增加 25 个基点	-3,574,799.37

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种、买入返售金融资产及卖出回购资产，因此无重大市场价格风险。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-
第二层次	269,848,480.76
第三层次	-
合计	269,848,480.76

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.15.1 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。

### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	269,848,480.76	99.98
	其中：债券	269,848,480.76	99.98
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	47,143.12	0.02
8	其他各项资产	7.91	0.00
9	合计	269,895,631.79	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	60,254,021.74	29.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	209,594,459.02	103.56
	其中：政策性金融债	209,594,459.02	103.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	269,848,480.76	133.33

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180210	18 国开 10	600,000	65,049,508.20	32.14
2	230205	23 国开 05	600,000	62,834,196.72	31.05
3	230018	23 付息国债 18	600,000	60,254,021.74	29.77
4	230404	23 农发 04	500,000	51,481,311.48	25.44
5	230413	23 农发 13	300,000	30,229,442.62	14.94

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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

本报告期内，本基金投资的前十名证券除“23 农发 04（证券代码：230404）、23 农发 13（证券代码：230413）”外，其他证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7.91
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7.91

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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
东吴添瑞三个月定期开债券 A	122	1,640,194.18	199,998,000.00	99.95%	105,689.68	0.05%
东吴添瑞三个月定期开债券 C	295	27.77	-	-	8,191.51	100.00%
合计	417	479,884.61	199,998,000.00	99.94%	113,881.19	0.06%

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	东吴添瑞三个月定期开债券 A	103,470.37	0.0517%
	东吴添瑞三个月定期开债券 C	1,491.00	18.2018%
	合计	104,961.37	0.0525%

注：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，比例的分母采用基金份额的合计数。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东吴添瑞三个月定期开债券 A	0~10
	东吴添瑞三个月定期开债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴添瑞三个月定期开债券 A	0~10
	东吴添瑞三个月定期开债券 C	-
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴添瑞三个月定 开债券 A	东吴添瑞三个月定 开债券 C
基金合同生效日（2023 年 7 月 21 日）基金 份额总额	250,102,739.69	8,981.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	49.93	49.97
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	49,999,099.94	839.98
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	200,103,689.68	8,191.51

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

## § 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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2023 年 3 月 30 日经东吴基金管理有限公司第四届董事会 2023 年第 1 次临时会议审议通过，聘任李杰同志为东吴基金管理有限公司副总经理，2023 年 4 月 4 日完成相关手续后，正式履职。

2、2023 年 6 月 2 日经东吴基金管理有限公司第四届董事会第三次会议审议通过，聘任李素明同志为东吴基金管理有限公司董事、总经理兼财务负责人、法定代表人，2023 年 6 月 6 日完成相关手续后，正式履职；陈军先生不再代任公司总经理，不再担任公司董事及法定代表人。

3、2023 年 8 月 7 日经东吴基金管理有限公司第三十次股东会审议通过，聘任郭晶晶同志担任东吴基金管理有限公司董事，免去叶犇同志董事职务；聘任叶犇同志担任东吴基金管理有限公司监事长，免去袁维静同志监事长职务。

4、2023 年 12 月 27 日经东吴基金管理有限公司第四届董事会 2023 年第 3 次临时会议审议通过，同意陈军同志辞去公司常务副总经理职务，陈军同志不再担任公司常务副总经理。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2023 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内应支付审计费 40500 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
民生证券	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 2 个，为民生证券 2 个。

#### 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
民生证券	199,769.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 14 日
2	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 14 日
3	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 14 日
4	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金产品	公司网站、中证信息网站	2023 年 7 月 14 日

	资料概要		
5	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告	公司网站、中证信息网站	2023年7月14日
6	东吴添瑞三个月定期开放证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023年7月14日
7	东吴基金管理有限公司关于东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023年7月20日
8	东吴基金管理有限公司关于东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023年7月22日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023年8月21日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023年9月5日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023年9月20日
12	东吴基金管理有限公司关于东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务并参与费率优惠的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023年10月19日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023年10月19日
14	东吴基金管理有限公司旗下基金 2023 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023年10月25日
15	东吴添瑞三个月定期开放证	公司网站、中证信息	2023年10月25日



	券投资基金 2023 年第 3 季度报告	网站	
16	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023 年 11 月 1 日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 11 月 3 日
18	东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2023 年 11 月 3 日
19	东吴基金管理有限公司关于参加上海万得基金销售有限公司申购补差费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 11 月 10 日
20	东吴基金管理有限公司关于参加嘉实财富管理有限公司申购补差费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 11 月 29 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 12 月 4 日
22	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2023 年 12 月 15 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站、中证信息网站	2023 年 12 月 22 日
24	东吴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所网站、公司网站、中证信息网站	2023 年 12 月 29 日

## § 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	20230720-20231231	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	49.97%
	2	20230720-20231231	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	49.97%
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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2024年3月29日