

# 东吴增鑫宝货币市场基金 2017年第3季度报告

2017年9月30日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十七日

## § 1 重要提示

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

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东吴增鑫宝	
场内简称	-	
基金主代码	003588	
交易代码	003588	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 7 日	
报告期末基金份额总额	5,921,089,310.73 份	
投资目标	在严格控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B
下属分级基金的交易代码	003588	003589
报告期末下属分级基金的份额总额	8,778,521.01 份	5,912,310,789.72 份

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 30 日 ）	
	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B
1. 本期已实现收益	72,069.44	78,391,928.41
2. 本期利润	72,069.44	78,391,928.41
3. 期末基金资产净值	8,778,521.01	5,912,310,789.72

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 本报告期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

##### 东吴增鑫宝 A

阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	0.9931%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	0.6528%	0.0003%

注：1、比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、本基金于 2016 年 11 月 7 日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

##### 东吴增鑫宝 B

阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	1.0545%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	0.7142%	0.0003%

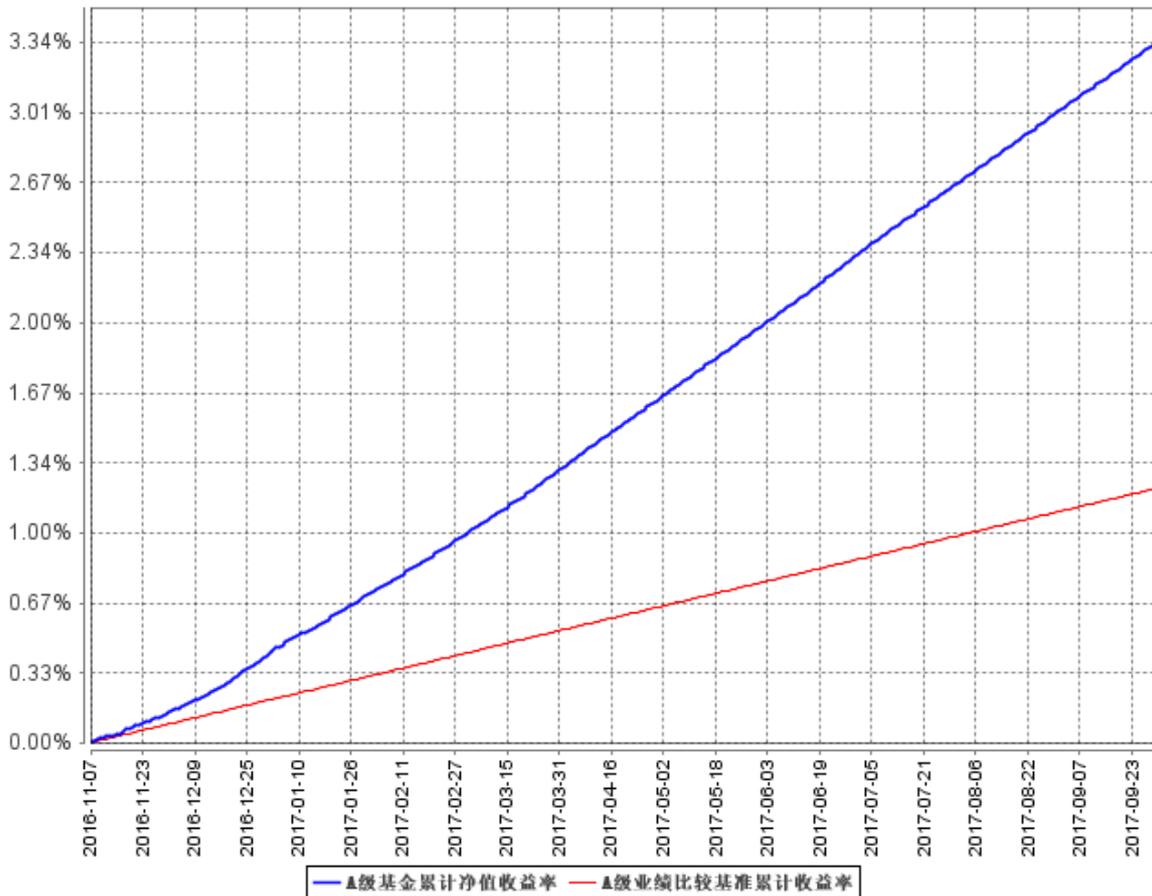
注：1、比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

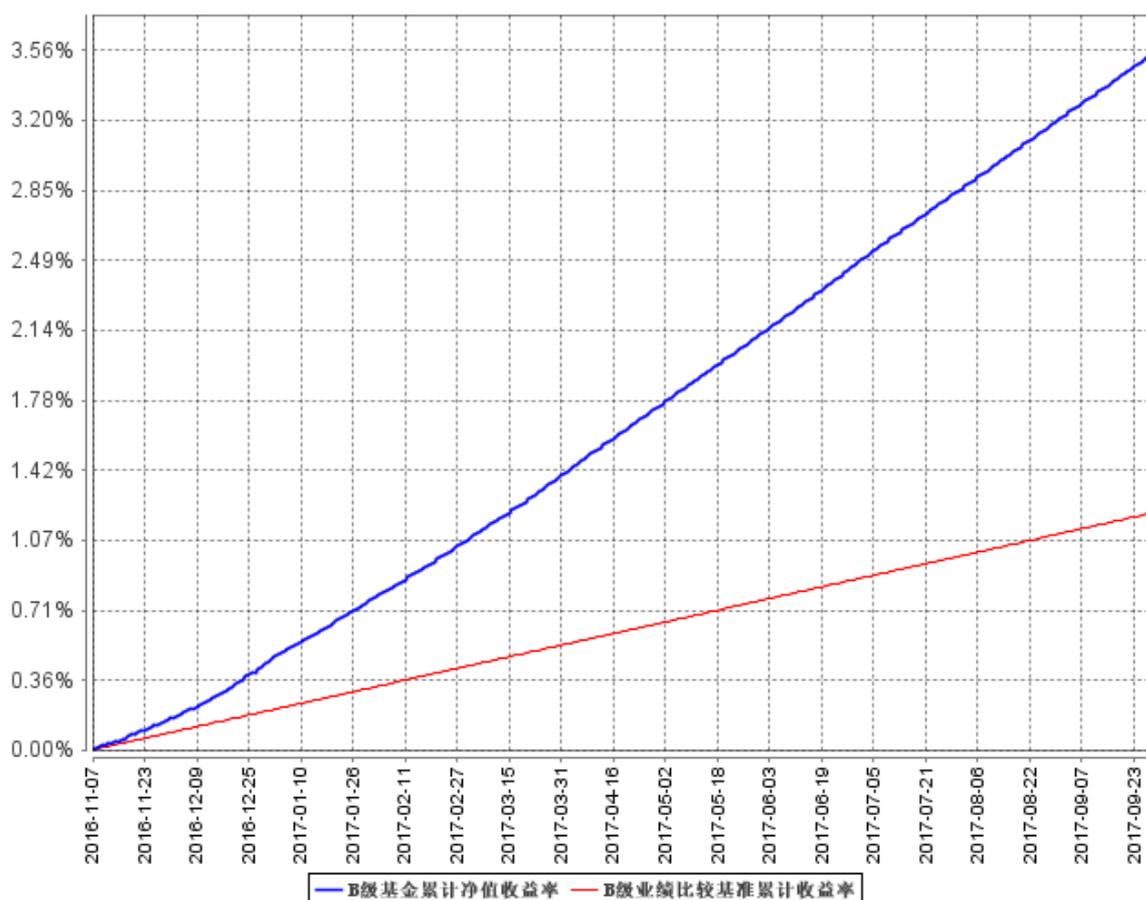
3、本基金于 2016 年 11 月 7 日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金于2016年11月7日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晨	本基金基金经理	2016年11月7日	-	5.5年	硕士，2011年6月获厦门大学硕士学位。2011年6月至2013年2月就职于华泰（联合）证券研究所任固定收益研究员，自2013年3月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事债券投资研究工作，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，自2015年6月8日起担任东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）（原东吴鼎利分

					级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。
王文华	本基金基金经理	2016 年 11 月 7 日	-	10 年	南开大学毕业,金融硕士学位。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,自 2014 年 10 月 16 日起担任东吴增利债券基金基金经理、自 2016 年 11 月 7 日起担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。

注:1、此处的任职日期为基金成立日;

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

6 月上旬央行超量续作 MLF,资金面迅速宽松,市场认为货币政策已由原来的偏紧转为不松不紧,10 年期国债收益率自 3.65%左右的高点下行至最低 3.48%。7 月初央行逐步回笼资金,体现了“削峰填谷”的操作思路,加上欧美国债收益率受加息、经济好转等因素影响短期大幅上行,国内 10 年期国债收益也上行至 3.6%附近。受到大宗商品价格上行等因素影响,PPI 同比自年初逐步

下行至 5.5%后转而在 8 月开始上行，9 月达到 6.9%。10 年期国债在 8 月上旬最高上行至 3.66%后转而小幅震荡。

本基金资产配置：以存款和存单为主，剩余期限适中。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期东吴增鑫宝 A 份额净值收益率为 0.9931%，东吴增鑫宝 B 份额净值收益率为 1.0545%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日出现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情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,906,655,732.25	48.27
	其中：债券	2,906,655,732.25	48.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,189,616,757.43	19.76
	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	1,909,414,384.29	31.71
4	其他资产	15,773,390.67	0.26
5	合计	6,021,460,264.64	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.18	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

#### 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。

#### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	31.74	1.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	11.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	45.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	12.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.43	1.66

注：本基金合同约定本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	269,550,229.20	4.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,034,090.87	1.01

	其中：政策性金融债	60,034,090.87	1.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,577,071,412.18	43.52
8	其他	-	-
9	合计	2,906,655,732.25	49.09
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111709380	17 浦发银行 CD380	10,000,000	989,856,868.98	16.72
2	111710459	17 兴业银行 CD459	2,000,000	198,281,057.15	3.35
3	111716196	17 上海银行 CD196	2,000,000	198,273,862.51	3.35
4	111715323	17 民生银行 CD323	2,000,000	198,258,435.58	3.35
5	111714208	17 江苏银行 CD208	1,000,000	99,936,734.44	1.69
6	111784566	17 青岛银行 CD140	1,000,000	99,129,586.60	1.67
7	111784711	17 盛京银行 CD241	1,000,000	99,095,193.86	1.67
8	111714183	17 江苏银行 CD183	1,000,000	99,009,639.56	1.67
9	111799966	17 重庆银行 CD109	1,000,000	98,988,614.61	1.67
10	111781291	17 天津银行 CD140	1,000,000	98,664,804.93	1.67

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0149%
报告期内偏离度的最低值	-0.0065%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0073%

#### 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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 元。

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

### 5.9.2

17 上海银行 CD196（代码：111716196）的发行主体“上海银行股份有限公司”于 2017 年 8 月 11 日因违规经营被上海银监局处以罚款并责令改正；

17 民生银行 CD323（代码：111715323）的发行主体“中国民生银行股份有限公司”于 2017 年 4 月 10 日因违规经营被中国银监会处以罚款；

17 青岛银行 CD140（代码：111784566）的发行主体“青岛银行股份有限公司”于 2017 年 7 月 12 日因违规经营被青岛银监局处以罚款；

17 天津银行 CD140（代码：111781291）的发行主体“天津银行股份有限公司”于 2017 年 5 月 31 日因违规经营被天津银监局处以罚款。

本基金投资 17 上海银行 CD196、17 民生银行 CD323、17 青岛银行 CD140、17 天津银行 CD140 的投资决策程序符合公司制度的规定，且相关发行主体的处罚事项并未对其企业经营和投资价值产生实质性影响。

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

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	738.41
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,770,652.26
4	应收申购款	2,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,773,390.67

### 5.9.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B
报告期期初基金份额总额	11,067,110.12	5,867,421,790.67
报告期期间基金总申购份额	2,647,873.78	8,932,719,213.96
报告期期间基金总赎回份额	4,936,462.89	8,887,830,214.91
报告期期末基金份额总额	8,778,521.01	5,912,310,789.72

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20170701-20170906	3,881,460,312.12	-	3,911,377,704.92	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

如开放期内上述持有人集中大额赎回，极端情况下本基金可能存在一定的流动性风险以及收益波动等情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴增鑫宝货币市场基金设立的文件；

- 2、《东吴增鑫宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《东吴增鑫宝货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴增鑫宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿。

## 9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

## 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2017 年 10 月 27 日