

# 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年年度报告

2021 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十一日

## § 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| § 1 重要提示及目录.....                             | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| §2 基金简介.....                                 | 5  |
| 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  |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 12 |
| §4 管理人报告.....                                | 13 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 13 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 16 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 16 |
| 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.....             | 17 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17 |
| 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.....                | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 19 |
| 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.....       | 19 |
| §5 托管人报告.....                                | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 20 |
| 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..... | 20 |
| 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.....      | 20 |
| §6 审计报告.....                                 | 21 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 21 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 21 |
| §7 年度财务报表.....                               | 24 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 24 |
| 7.2 利润表.....                                 | 25 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 26 |
| 7.4 报表附注.....                                | 27 |
| §8 投资组合报告.....                               | 53 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 53 |
| 8.2 债券回购融资情况.....                            | 53 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 53 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....         | 54 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 54 |
| 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....      | 55 |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....         | 55        |
| 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 ..... | 55        |
| 8.9 投资组合报告附注 .....                           | 55        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                    | <b>57</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                  | 57        |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                 | 57        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....               | 57        |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....      | 58        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>59</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                      | <b>60</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                       | 60        |
| 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 .....       | 60        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 60        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                         | 60        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 60        |
| 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 .....          | 60        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 60        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                  | 61        |
| 11.9 其他重大事件 .....                            | 61        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>              | <b>68</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 .....     | 68        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 68        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                      | <b>69</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                            | 69        |
| 13.2 存放地点 .....                              | 69        |
| 13.3 查阅方式 .....                              | 69        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 东吴增鑫宝货币市场基金        |                    |
| 基金简称            | 东吴增鑫宝货币            |                    |
| 基金主代码           | 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    |                    |
| 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         |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 6,132,694,865.56 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称:    | 东吴增鑫宝货币 A          | 东吴增鑫宝货币 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 | 37,490,929.21 份    | 6,095,203,936.35 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。                                        |

### 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                        | 浙商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 刘婷婷                               | 朱巍                |
|         | 联系电话 | 021-50509888-8308                 | 0571-87659806     |
|         | 电子邮箱 | liutt@scfund.com.cn               | zhuwei@czbank.com |
| 客户服务电话  |      | 021-50509666/400-821-0588         | 95527             |
| 传真      |      | 021-50509888-8211                 | 0571-88268688     |
| 注册地址    |      | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室 | 杭州市萧山区鸿宁路 1788 号  |
| 办公地址    |      | 上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼           | 杭州市拱墅区延安路 368 号   |
| 邮政编码    |      | 200120                            | 310006            |
| 法定代表人   |      | 邓晖                                | 张荣森（代为履行法定代表人职责）  |

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于 2022 年 1 月 14 日以书面传签方式召开第六届董事会 2022 年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经

全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 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 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层   |
| 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<br>期间<br>数据<br>和指<br>标 | 2021 年        |                  | 2020 年        |                  | 2019 年        |                   |
|------------------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-------------------|
|                              | 东吴增鑫宝货<br>币 A | 东吴增鑫宝货币 B        | 东吴增鑫宝货<br>币 A | 东吴增鑫宝货币 B        | 东吴增鑫宝货<br>币 A | 东吴增鑫宝货币 B         |
| 本期<br>已实<br>现收<br>益          | 586,041.97    | 118,937,198.17   | 495,328.12    | 115,692,448.61   | 583,048.81    | 253,226,081.01    |
| 本期<br>利润                     | 586,041.97    | 118,937,198.17   | 495,328.12    | 115,692,448.61   | 583,048.81    | 253,226,081.01    |
| 本期<br>净值<br>收益<br>率          | 2.0112%       | 2.2565%          | 1.9011%       | 2.1460%          | 2.2425%       | 2.4884%           |
| 3.1.2<br>期末<br>数据<br>和指<br>标 | 2021 年末       |                  | 2020 年末       |                  | 2019 年末       |                   |
| 期末<br>基金<br>资产<br>净值         | 37,490,929.21 | 6,095,203,936.35 | 30,963,936.13 | 3,229,372,077.36 | 20,690,181.65 | 10,575,239,001.18 |
| 期末<br>基金<br>份额<br>净值         | 1.0000        | 1.0000           | 1.0000        | 1.0000           | 1.0000        | 1.0000            |
| 3.1.3<br>累计<br>期末<br>指标      | 2021 年末       |                  | 2020 年末       |                  | 2019 年末       |                   |
| 累计<br>净值<br>收益<br>率          | 14.5044%      | 15.9284%         | 12.2469%      | 13.3702%         | 10.1527%      | 10.9884%          |

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

东吴增鑫宝货币 A

| 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     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月          | 0.5164%      | 0.0018%             | 0.3403%            | 0.0000%               | 0.1761% | 0.0018% |
| 过去六个月          | 0.9865%      | 0.0015%             | 0.6805%            | 0.0000%               | 0.3060% | 0.0015% |
| 过去一年           | 2.0112%      | 0.0018%             | 1.3500%            | 0.0000%               | 0.6612% | 0.0018% |
| 过去三年           | 6.2817%      | 0.0022%             | 4.0537%            | 0.0000%               | 2.2280% | 0.0022% |
| 过去五年           | 14.0284%     | 0.0029%             | 6.7537%            | 0.0000%               | 7.2747% | 0.0029% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 14.5044%     | 0.0029%             | 6.9571%            | 0.0000%               | 7.5473% | 0.0029% |

东吴增鑫宝货币 B

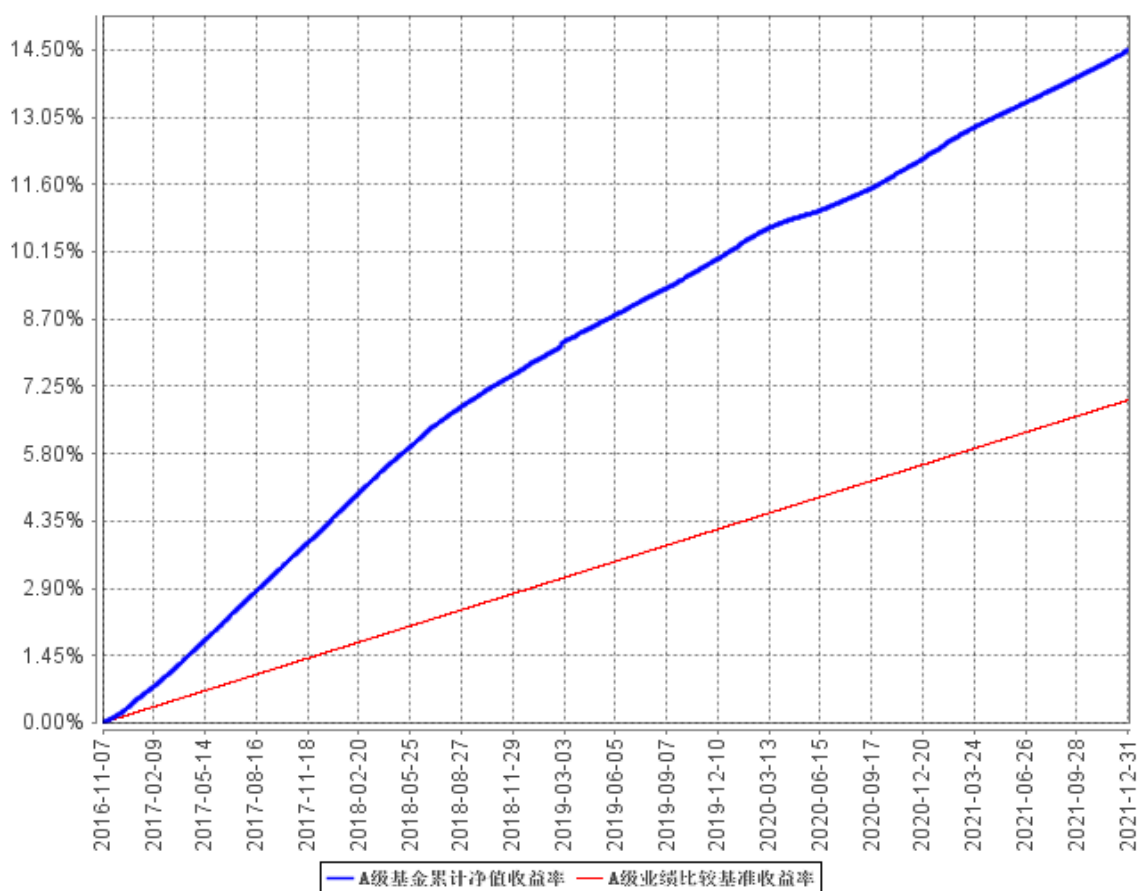
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月          | 0.5773%      | 0.0018%             | 0.3403%            | 0.0000%               | 0.2370% | 0.0018% |
| 过去六个月          | 1.1088%      | 0.0015%             | 0.6805%            | 0.0000%               | 0.4283% | 0.0015% |
| 过去一年           | 2.2565%      | 0.0018%             | 1.3500%            | 0.0000%               | 0.9065% | 0.0018% |
| 过去三年           | 7.0501%      | 0.0022%             | 4.0537%            | 0.0000%               | 2.9964% | 0.0022% |
| 过去五年           | 15.4063%     | 0.0029%             | 6.7537%            | 0.0000%               | 8.6526% | 0.0029% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 15.9284%     | 0.0029%             | 6.9571%            | 0.0000%               | 8.9713% | 0.0029% |

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）。

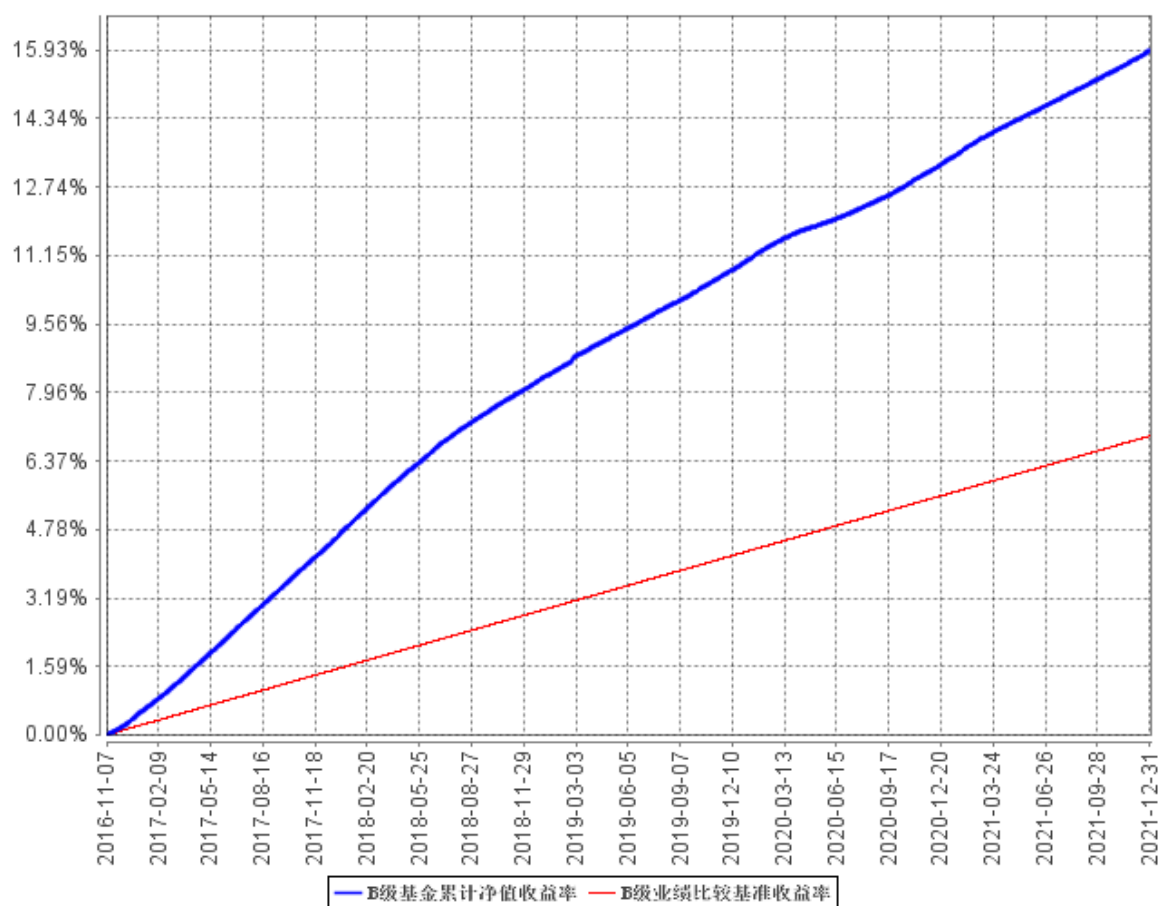
2、本基金收益分配按日结转份额。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



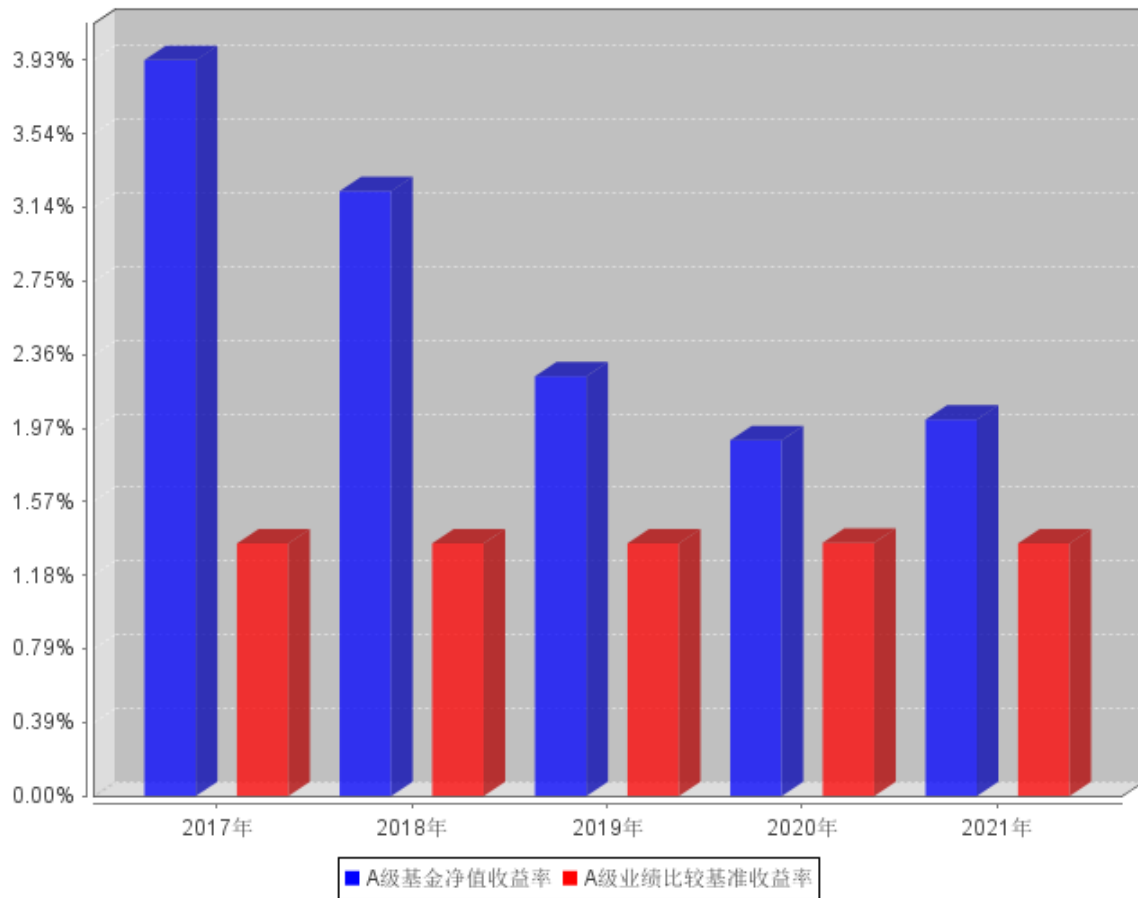
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



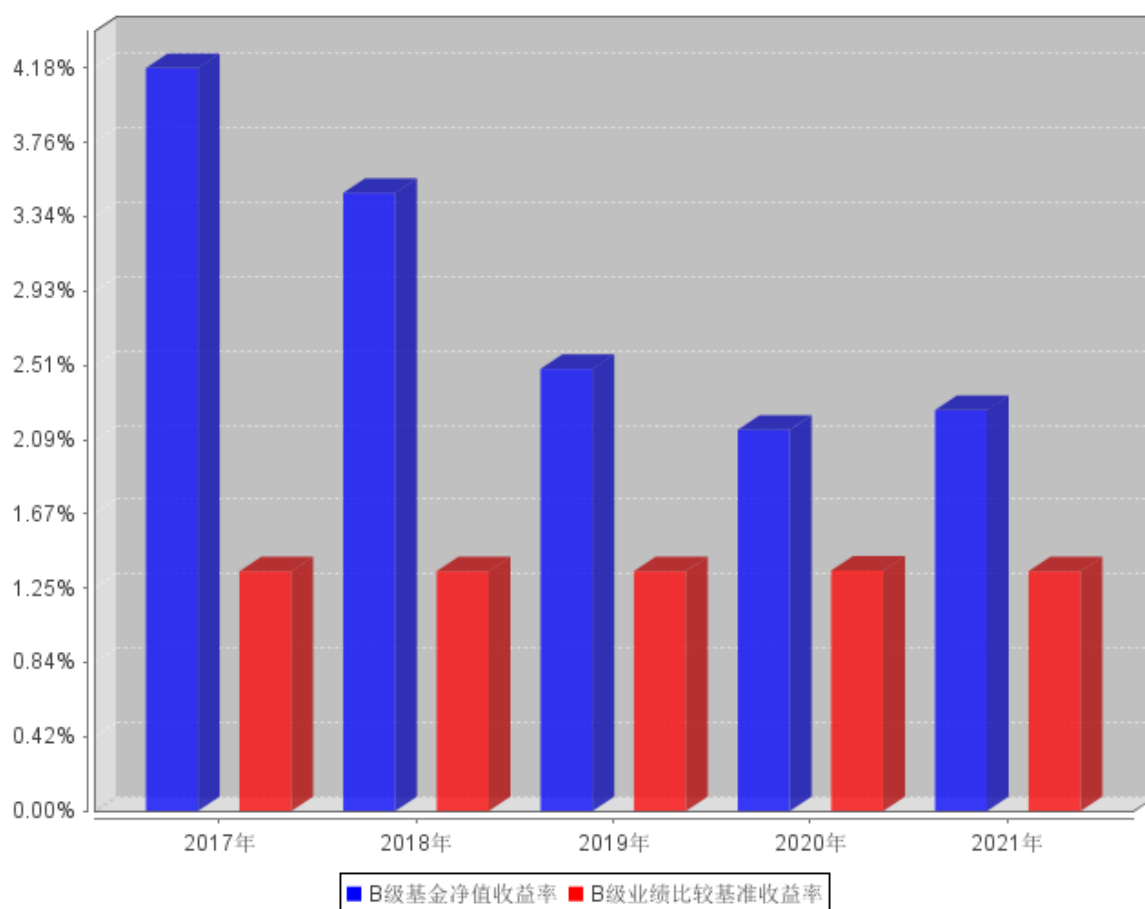
注：比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

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

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 东吴增鑫宝货币 A |                  |                   |              |              |    |
|-----------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>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 | 年度利润<br>分配合计 | 备注 |
| 2021      | 586,041.97       | -                 | -            | 586,041.97   |    |
| 2020      | 495,328.12       | -                 | -            | 495,328.12   |    |
| 2019      | 583,048.81       | -                 | -            | 583,048.81   |    |
| 合计        | 1,664,418.90     | -                 | -            | 1,664,418.90 |    |

单位：人民币元

| 东吴增鑫宝货币 B |                  |                   |              |                |    |
|-----------|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>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 | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2021      | 118,937,198.17   | -                 | -            | 118,937,198.17 |    |
| 2020      | 115,692,448.61   | -                 | -            | 115,692,448.61 |    |
| 2019      | 253,226,081.01   | -                 | -            | 253,226,081.01 |    |
| 合计        | 487,855,727.79   | -                 | -            | 487,855,727.79 |    |

## § 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、私募资产管理业务以及子公司业务协同发展, 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。

截至 2021 年年末, 公司整体资产管理规模为【399.99】亿元, 其中公募基金【294.31】亿元, 私募资产管理业务【105.68】亿元, 子公司【4.74】亿元; 旗下管理着【29】只公募基金(不含清盘中的基金), 【35】只存续私募资产管理计划(不包含正在清盘中的资产管理计划), 【9】项专项资产管理计划(子公司)。

#### 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 | 2018 年 4 月 11 日 | -    | 14 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，2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日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，2018 年 4 月 11 日起至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。                                                                                                                             |
| 黄婧丽 | 基金经理 | 2019 年 3 月 8 日 | 2021 年 1 月 22 日 | 8 年 | 黄婧丽女士，中国国籍，英国帝国理工学院金融学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职世纪证券有限责任公司研究员；国海证券股份有限公司投资助理。2016 年 11 月加入东吴基金管理有限公司，2021 年 7 月 19 日离任基金经理。2018 年 5 月 9 日至 2020 年 12 月 16 日担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 1 月 29 日至 2021 年 1 月 22 日担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月 8 日至 2021 年 1 月 22 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2018 年 11 月 8 日至 2021 |

|     |      |                 |                |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|------|-----------------|----------------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      |                 |                |      | 年 7 月 19 日担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 王文华 | 基金经理 | 2016 年 11 月 7 日 | 2021 年 7 月 2 日 | 13 年 | 王文华女士，中国国籍，南开大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职中诚信证券评估有限公司高级分析师；联合证券股份有限公司投资银行高级经理。2012 年 3 月起加入东吴基金管理有限公司，2021 年 7 月 2 日离任基金经理。2014 年 10 月 15 日至 2020 年 7 月 17 日担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月 7 日至 2021 年 7 月 2 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2018 年 4 月 11 日至 2021 年 7 月 2 日担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2019 年 12 月 24 日至 2021 年 7 月 2 日担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金（原东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金）基金经理。 |

注：1、此处的任职日期及离任日期均为公司对外公告之日；

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。

#### 4.1.3 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《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。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

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资权限、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

2021 年中国经济呈现前高后低的走势，外需好而内需弱。出口强于市场预期，大宗商品价格全面上行，PPI 大幅走高，地产行业调整对经济负面影响逐渐显现，疫情反复引发谨慎预期，居民消费动力不足，CPI 表现温和。美联储退出宽松政策的安排不断明晰，人民币对美元汇率保持强势，波动加大，升值幅度不及去年。宏观政策保持中性，在下半年更加积极，提出跨周期调节、推动形成实物工作量、稳增长等要求，对地产业等限制性措施进行微调，通过两次降准、下调 LPR 利率、下调支农支小再贷款利率等方式为实体经济助力，市场流动性保持合理充裕。

出口好而内需弱的经济格局为债市提供了有利条件，宽松的货币环境催生了全年的债券上涨行情。10 年期国债收益率全年下行 35bp，7 月份的降准加速了下行速度与幅度；市场也出现两次调整期，幅度在 10-18bp 左右，一次是年初受资金面影响，另一次是十月份宽松预期回落叠加宽信用及美联储政策转向担忧。信用债方面，整体表现平稳，但市场分化明显，高等级、短久期品种受到市场追捧，民企、地产债受负面影响较大。在理财资金配置及市场风险偏好下降的推动下，存款存单的利率同样出现了明显的下行，1 年前存单利率由年初最高的 3.15% 位置下行多达 50bp。

本基金在报告期内，为更具市场变化及时调整组合久期，适时增加高收益资产配置，严控投资组合信用风险，保持偏离度在可控范围内，全面做好流动性管理。本基金争取做好各类资产配置，力争实现基金平稳健康运行，在各项指标合规的前提下努力为基金持有人获取合理收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东吴增鑫宝 A 份额净值收益率为 2.0112%。东吴增鑫宝 B 份额净值收益率为 2.2565%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，中国经济可能将受到外需转弱、地产业放缓、疫情常态化等多种考验，预计财政政策可能将更加积极，货币政策可能继续保持合理宽松。美联储加息及缩表操作逐步落地的可能性不断增强，虽然有外部的约束，预计国内货币政策或将更加注重自身的节奏，减缓经济增长的压力。同时也要注意，石油及其他大宗商品的走高及双碳目标施行都有可能引发通胀的隐忧，资产配置过程中也要加强对信用风险的防范。

## 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，保证基金合同得到严格履行。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。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 根据法规要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据《公募基金管理公司压力指引（试行）》及基金业协会的相关要求，结合公司旗下各公募基金的实际运作情况，对公司旗下公募基金开展了情景压力测试，形成压力测试分析报告，加强流动性风险管理。公司根据法规要求持续关注流动性法规执行情况，从制度建设、系统控制、指标监测、部门间协作等方面，不断优化流动性管理工作流程，建立健全公司流动性风险管理内部控制体系。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了投资、研究、交易等多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 加强宣传推介材料审核，保证合规推介。公司根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》等法规及相关监管要求，对拟对外发布的宣传材料发表初审及复审合规意见，包括不限于宣传单页、一页通、海报、PPT、视频、文章等。重点根据相关法规及监管要求对宣传材料中涉及到的业绩引用、基金评价引用、风险揭示等内容作出合规风险提示及意见。

(4) 跟踪监管动态，及时落实新规。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求进行内部讨论，成立工作小组，制订落实方案。及时开展内部培训，修改相关制度与流程，升级业务系统并调整风控设置，保障基金投资符合监管要求。

本基金管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 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、固定收益部）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。

#### **4.8 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。本报告期东吴增鑫宝 A 级基金应分配收益 586,041.97 元，实际分配收益 586,041.97 元；东吴增鑫宝 B 级基金应分配收益 118,937,198.17 元，实际分配收益 118,937,198.17 元。

#### **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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，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，东吴增鑫宝货币市场基金的管理人东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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     | 安永华明（2022）审字第 60469066_B10 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         | 东吴增鑫宝货币市场基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 审计意见            | <p>我们审计了东吴增鑫宝货币市场基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴增鑫宝货币市场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，公允反映了东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度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，我们独立于东吴增鑫宝货币市场基金，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>东吴增鑫宝货币市场基金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增鑫宝货币市场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，除非计划进行清算、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增鑫宝货币市场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，就可能导致对东吴增鑫宝货币市场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增鑫宝货币市场基金不能持续经营。</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 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)          |     |
| 注册会计师的姓名  | 陈露                          | 张亚旋 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层 |     |
| 审计报告日期    | 2022 年 3 月 29 日             |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,454,714,051.36                | 279,147,912.82                   |
| 结算备付金           |            | -                               | 1,142,857.14                     |
| 存出保证金           |            | -                               | 30,234.72                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 3,139,221,129.63                | 1,897,108,196.03                 |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 3,139,221,129.63                | 1,897,108,196.03                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 1,663,655,427.54                | 1,240,127,220.20                 |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 15,876,138.03                   | 13,462,408.61                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 131,602,200.00                  | 2.00                             |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 6,405,068,946.56                | 3,431,018,831.52                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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       |            | 64,979,847.51                   | 169,099,795.45                   |
| 应付证券清算款         |            | 205,300,000.00                  | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,206,001.04                    | 860,024.63                       |
| 应付托管费           |            | 482,400.41                      | 344,009.84                       |
| 应付销售服务费         |            | 54,601.74                       | 39,445.57                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 112,590.09                      | 89,814.97                        |
| 应交税费            |            | 15,151.40                       | 20,484.10                        |
| 应付利息            |            | 4,488.81                        | 10,243.47                        |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 219,000.00       | 219,000.00       |
| 负债合计          |          | 272,374,081.00   | 170,682,818.03   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 6,132,694,865.56 | 3,260,336,013.49 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -                | -                |
| 所有者权益合计       |          | 6,132,694,865.56 | 3,260,336,013.49 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 6,405,068,946.56 | 3,431,018,831.52 |

报告截止日 2021 年 12 月 31 日，东吴增鑫宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 37,490,929.21 份；东吴增鑫宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,095,203,936.35 份。东吴增鑫宝货币份额总额合计为 6,132,694,865.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 141,919,454.14                            | 138,025,707.59                                 |
| 1.利息收入                |            | 142,036,650.18                            | 131,786,725.34                                 |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11   | 22,407,350.07                             | 22,767,904.04                                  |
| 债券利息收入                |            | 72,141,006.98                             | 62,994,540.23                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                         | 445,341.14                                     |
| 买入返售金融资产收入            |            | 47,488,293.13                             | 45,578,939.93                                  |
| 证券出借利息收入              |            | -                                         | -                                              |
| 其他利息收入                |            | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -150,085.18                               | 6,238,982.25                                   |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12   | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                |            | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13   | -150,085.18                               | 6,238,982.25                                   |
| 资产支持证券投资              | 7.4.7.13.3 | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益               |            | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14   | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | 7.4.7.15   | -                                         | -                                              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | -                                         | -                                              |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 32,889.14                                 | -                                              |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 列)                         |            |                |                |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 22,396,214.00  | 21,837,930.86  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 13,583,648.98  | 13,648,496.05  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 5,433,459.58   | 5,459,398.34   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 613,750.47     | 608,299.25     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18   | 375.00         | 688.00         |
| 5. 利息支出                    |            | 2,472,841.94   | 1,824,154.69   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,472,841.94   | 1,824,154.69   |
| 6. 税金及附加                   |            | 46,138.03      | 49,694.53      |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.19   | 246,000.00     | 247,200.00     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 119,523,240.14 | 116,187,776.73 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 119,523,240.14 | 116,187,776.73 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日      |                 |                    |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|--------------------|
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 3,260,336,013.49                            | -               | 3,260,336,013.49   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | 119,523,240.14  | 119,523,240.14     |
| 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）      | 2,872,358,852.07                            | -               | 2,872,358,852.07   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 25,207,673,395.39                           | -               | 25,207,673,395.39  |
| 2. 基金赎回款                               | -22,335,314,543.32                          | -               | -22,335,314,543.32 |
| 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） | -                                           | -119,523,240.14 | -119,523,240.14    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,132,694,865.56                            | -               | 6,132,694,865.56   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                 |                    |

|                                        | 实收基金               | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
|----------------------------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 10,595,929,182.83  | -               | 10,595,929,182.83  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                  | 116,187,776.73  | 116,187,776.73     |
| 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）      | -7,335,593,169.34  | -               | -7,335,593,169.34  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 26,881,777,339.73  | -               | 26,881,777,339.73  |
| 2. 基金赎回款                               | -34,217,370,509.07 | -               | -34,217,370,509.07 |
| 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） | -                  | -116,187,776.73 | -116,187,776.73    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 3,260,336,013.49   | -               | 3,260,336,013.49   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>邓晖</u> | <u>徐明</u> | <u>骆银</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   |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴增鑫宝货币市场基金（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”）证监基金[2016]2292号《关于同意东吴增鑫宝货币市场基金募集的批复》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2016年11月7日正式生效，首次设立募集规模为272,486,612.37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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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

人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 债券投资

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

##### (2) 回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金持有的金融工具的估值方法具体如下：

(1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

(2) 债券投资

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

(3) 回购协议

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

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

(4) 其他

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

2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 收入/[(损失)的确认和计量

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

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

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

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

(5) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致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确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到

小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 1. 增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 714,051.36              | 147,912.82               |
| 定期存款           | 1,454,000,000.00        | 279,000,000.00           |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | 200,000,000.00           |
| 存款期限 1-3 个月    | 174,000,000.00          | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | 1,280,000,000.00        | 79,000,000.00            |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 1,454,714,051.36        | 279,147,912.82           |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |                  |              |         |
|--------|-------|--------------------------|------------------|--------------|---------|
|        |       | 摊余成本                     | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度     |
| 债券     | 交易所市场 | -                        | -                | -            | -       |
|        | 银行间市场 | 3,139,221,129.63         | 3,144,503,000.00 | 5,281,870.37 | 0.0861% |
|        | 合计    | 3,139,221,129.63         | 3,144,503,000.00 | 5,281,870.37 | 0.0861% |
| 资产支持证券 |       | -                        | -                | -            | -       |
| 合计     |       | 3,139,221,129.63         | 3,144,503,000.00 | 5,281,870.37 | 0.0861% |
| 项目     |       | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                  |              |         |
|        |       | 摊余成本                     | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度     |
| 债券     | 交易所市场 | -                        | -                | -            | -       |
|        | 银行间市场 | 1,897,108,196.03         | 1,900,538,000.00 | 3,429,803.97 | 0.1052% |
|        | 合计    | 1,897,108,196.03         | 1,900,538,000.00 | 3,429,803.97 | 0.1052% |
| 资产支持证券 |       | -                        | -                | -            | -       |
| 合计     |       | 1,897,108,196.03         | 1,900,538,000.00 | 3,429,803.97 | 0.1052% |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 205,300,000.00           | —         |
| 银行间市场 | 1,458,355,427.54         | —         |
| 合计    | 1,663,655,427.54         | —         |
| 项目    | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | —                        | —         |
| 银行间市场 | 1,240,127,220.20         | —         |
| 合计    | 1,240,127,220.20         | —         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 70.45                   | 45.84                    |
| 应收定期存款利息   | 5,737,969.99            | 705,411.67               |
| 应收其他存款利息   | —                       | —                        |
| 应收结算备付金利息  | —                       | 565.73                   |
| 应收债券利息     | 8,952,882.91            | 11,704,374.79            |
| 应收资产支持证券利息 | —                       | —                        |
| 应收买入返售证券利息 | 1,185,214.68            | 1,051,995.62             |
| 应收申购款利息    | —                       | —                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —                       | —                        |
| 应收出借证券利息   | —                       | —                        |
| 其他         | —                       | 14.96                    |
| 合计         | 15,876,138.03           | 13,462,408.61            |

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | 112,590.09              | 89,814.97                |
| 合计          | 112,590.09              | 89,814.97                |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 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   | -                       | -                        |
| 应付信息披露费     | 120,000.00              | 120,000.00               |
| 应付审计费       | 90,000.00               | 90,000.00                |
| 应付中债账户维护费   | 4,500.00                | 4,500.00                 |
| 应付上清所账户维护费  | 4,500.00                | 4,500.00                 |
| 合计          | 219,000.00              | 219,000.00               |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 东吴增鑫宝货币 A     |                                        |                 |
|---------------|----------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额            |
| 上年度末          | 30,963,936.13                          | 30,963,936.13   |
| 本期申购          | 138,835,479.05                         | 138,835,479.05  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -132,308,485.97                        | -132,308,485.97 |
| - 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           | 37,490,929.21                          | 37,490,929.21   |

金额单位：人民币元

| 东吴增鑫宝货币 B |
|-----------|
|-----------|

| 项目            | 本期                               |                    |
|---------------|----------------------------------|--------------------|
|               | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                    |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额               |
| 上年度末          | 3,229,372,077.36                 | 3,229,372,077.36   |
| 本期申购          | 25,068,837,916.34                | 25,068,837,916.34  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -22,203,006,057.35               | -22,203,006,057.35 |
| - 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           | 6,095,203,936.35                 | 6,095,203,936.35   |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 东吴增鑫宝货币 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           | 586,041.97  | -     | 586,041.97  |
| 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        | -586,041.97 | -     | -586,041.97 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

单位：人民币元

| 东吴增鑫宝货币 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           | 118,937,198.17  | -     | 118,937,198.17  |
| 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        | -118,937,198.17 | -     | -118,937,198.17 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,586.55                              | 28,089.61                                   |
| 定期存款利息收入  | 22,381,748.04                          | 22,717,319.82                               |
| 其他存款利息收入  | -                                      | -                                           |
| 结算备付金利息收入 | 10,957.90                              | 22,212.30                                   |
| 其他        | 57.58                                  | 282.31                                      |
| 合计        | 22,407,350.07                          | 22,767,904.04                               |

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -150,085.18                     | 6,238,982.25                         |
| 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                           | -150,085.18                     | 6,238,982.25                         |

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 24,071,513,057.26               | 26,291,774,381.47                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 23,926,411,695.33               | 26,158,682,068.63                    |
| 减：应收利息总额               | 145,251,447.11                  | 126,853,330.59                       |
| 买卖债券差价收入               | -150,085.18                     | 6,238,982.25                         |

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | -                               | 18,496,260.00                        |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | -                               | 18,000,000.00                        |
| 减：应收利息总额       | -                               | 496,260.00                           |
| 资产支持证券投资收益     | -                               | -                                    |

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                               | -                                    |
| 其他      | 32,889.14                       | -                                    |
| 合计      | 32,889.14                       | -                                    |

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | -                               | -                                    |
| 银行间市场交易费用 | 375.00                          | 688.00                               |

|           |        |        |
|-----------|--------|--------|
| 交易基金产生的费用 | -      | -      |
| 其中：申购费    | -      | -      |
| 赎回费       | -      | -      |
| 合计        | 375.00 | 688.00 |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12<br>月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 审计费用    | 90,000.00                                 | 90,000.00                                      |
| 信息披露费   | 120,000.00                                | 120,000.00                                     |
| 证券出借违约金 | -                                         | -                                              |
| 账户维护费   | 34,800.00                                 | 36,000.00                                      |
| 其他费用    | 1,200.00                                  | 1,200.00                                       |
| 银行汇划费用  | -                                         | -                                              |
| 合计      | 246,000.00                                | 247,200.00                                     |

#### 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，本基金无其他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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 浙商银行股份有限公司      | 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       |
| 海澜集团有限公司        | 基金管理人的股东              |
| 上海新东吴优胜资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司             |

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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                      |
|------------|----------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------|----------------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                                        | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 |
| 东吴证券股份有限公司 | -                                      | -                    | 129,447,256.36                              | 100.00%              |

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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                            | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                            |
|------------|----------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|----------------------------|
|            | 回购成交金额                                 | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                                      | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 |
| 东吴证券股份有限公司 | 1,120,100,000.00                       | 100.00%                    | 3,926,279,000.00                            | 100.00%                    |

**7.4.10.1.4 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。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度末均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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月<br>31 日 |
|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付 | 13,583,648.98                             | 13,648,496.05                                  |

|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 的管理费            |            |            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 456,126.92 | 540,776.92 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月<br>31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
|                |                                           |                                                |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,433,459.58                              | 5,459,398.34                                   |

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |            |            |
|----------------|----------------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                       |            |            |
|                | 东吴增鑫宝货币 A                              | 东吴增鑫宝货币 B  | 合计         |
| 东吴基金管理有限公司     | 31,480.09                              | 478,847.67 | 510,327.76 |
| 浙商银行股份有限公司     | 188.01                                 | 1,389.26   | 1,577.27   |
| 东吴证券股份有限公司     | 262.55                                 | -          | 262.55     |
| 合计             | 31,930.65                              | 480,236.93 | 512,167.58 |

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |            |              |
|--------------------|---------------------------------------------|------------|--------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |            |              |
|                    | 东吴增鑫宝货币<br>A                                | 东吴增鑫宝货币 B  | 合计           |
| 东吴基金管理有限公司         | 34,196.66                                   | 977,006.66 | 1,011,203.32 |
| 浙商银行股份有限公司         | 175.76                                      | -          | 175.76       |
| 东吴证券股份有限公司         | 50.92                                       | -          | 50.92        |
| 合计                 | 34,423.34                                   | 977,006.66 | 1,011,430.00 |

注：基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 级的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类基金份额条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金登记机构，由给基金登记机构代付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日      |        |      |          |          |                |           |
|---------------------------------------------|--------|------|----------|----------|----------------|-----------|
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 浙商银行股份有限公司                                  | -      | -    | -        | -        | 959,880,000.00 | 55,686.69 |
| 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |        |      |          |          |                |           |
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额           | 利息支出      |

|            |                |   |   |   |                |           |
|------------|----------------|---|---|---|----------------|-----------|
| 浙商银行股份有限公司 | 199,543,560.89 | - | - | - | 234,361,000.00 | 22,378.73 |
|------------|----------------|---|---|---|----------------|-----------|

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

东吴增鑫宝货币 B

份额单位：份

| 关联方名称               | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                          |
|---------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                     | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 上海新东吴<br>优胜资产管理有限公司 | 13,299,132.77           | 0.2182%                  | -                        | -                        |
| 东吴证券股份有限公司          | 300,028,409.35          | 4.9224%                  | -                        | -                        |

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 A 类基金。

#### 7.4.10.5 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>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |           |
|-------------------------|----------------------------------------|-----------|---------------------------------------------|-----------|
|                         | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额                                        | 当期利息收入    |
| 浙商银行股份<br>有限公司-活<br>期存款 | 714,051.36                             | 14,586.55 | 147,912.82                                  | 28,089.61 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

## 东吴增鑫宝货币A

| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计   | 备注 |
|--------------|---------------|----------|------------|----|
| 586,041.97   | -             | -        | 586,041.97 | -  |

## 东吴增鑫宝货币B

| 已按再投资形式转实收基金   | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计       | 备注 |
|----------------|---------------|----------|----------------|----|
| 118,937,198.17 | -             | -        | 118,937,198.17 | -  |

**7.4.12 期末（2021 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 2021 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证券款余额 64,979,847.51 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        |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 200217 | 20 国开 17 | 2022 年 1 月 4 日 | 99.81  | 684,000 | 68,272,753.79 |
| 合计     |          |                |        | 684,000 | 68,272,753.79 |

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 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。

**7.4.13 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。本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证

券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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

本基金的基金管理人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。

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。

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。

本基金禁止投资信用等级在 AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具；本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券的信用级别应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

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。

#### 7.4.13.2.1 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>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | 829,547,023.85           |
| A-1 以下 | 0.00                    | 60,094,276.13            |
| 未评级    | 918,008,463.37          | 349,693,596.39           |
| 合计     | 918,008,463.37          | 1,239,334,896.37         |

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

#### 7.4.13.2.2 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>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | —                        |
| A-1 以下 | 0.00                    | —                        |
| 未评级    | 1,790,726,364.55        | 98,674,379.00            |
| 合计     | 1,790,726,364.55        | 98,674,379.00            |

#### 7.4.13.2.3 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>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 220,925,407.43          | —                        |
| AAA 以下 | —                       | —                        |
| 未评级    | 209,560,894.28          | 559,098,920.66           |
| 合计     | 430,486,301.71          | 559,098,920.66           |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

#### 7.4.13.2.4 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。

#### 7.4.13.2.5 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。

### 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《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。针对被动超标和个别暂未达标的情形，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，本期末本基金的资产均能及时变现。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。

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。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年<br>12 月 31<br>日 | 1 个月以内         | 1-3 个月         | 3 个月-1 年       | 1-5<br>年 | 5 年<br>以上 | 不计息 | 合计               |
|-------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------|-----------|-----|------------------|
| 资产                            |                |                |                |          |           |     |                  |
| 银行存款                          | 604,714,051.36 | 250,000,000.00 | 600,000,000.00 | -        | -         | -   | 1,454,714,051.36 |
| 结算备付金                         | -              | -              | -              | -        | -         | -   | -                |

|           |                  |                  |                |   |   |                 |                   |
|-----------|------------------|------------------|----------------|---|---|-----------------|-------------------|
| 存出保证金     | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 交易性金融资产   | 610,103,791.35   | 2,399,349,369.98 | 129,767,968.30 | - | - | -               | -3,139,221,129.63 |
| 衍生金融资产    | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 买入返售金融资产  | 1,663,655,427.54 | -                | -              | - | - | -               | -1,663,655,427.54 |
| 应收证券清算款   | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 应收利息      | -                | -                | -              | - | - | 15,876,138.03   | 15,876,138.03     |
| 应收股利      | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 应收申购款     | -                | -                | -              | - | - | -131,602,200.00 | 131,602,200.00    |
| 其他资产      | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 资产总计      | 2,878,473,270.25 | 2,649,349,369.98 | 729,767,968.30 | - | - | -147,478,338.03 | 6,405,068,946.56  |
| 负债        | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 卖出回购金融资产款 | 64,979,847.51    | -                | -              | - | - | -               | 64,979,847.51     |
| 应付证券清算款   | -                | -                | -              | - | - | -205,300,000.00 | 205,300,000.00    |
| 应付赎回款     | -                | -                | -              | - | - | -               | -                 |
| 应付管理人报酬   | -                | -                | -              | - | - | 1,206,001.04    | 1,206,001.04      |
| 应付托管费     | -                | -                | -              | - | - | 482,400.41      | 482,400.41        |
| 应付销售服务费   | -                | -                | -              | - | - | 54,601.74       | 54,601.74         |
| 应付交易费用    | -                | -                | -              | - | - | 112,590.09      | 112,590.09        |
| 应交税费      | -                | -                | -              | - | - | 15,151.40       | 15,151.40         |

|                                |                  |                  |                |       |       |                |                  |
|--------------------------------|------------------|------------------|----------------|-------|-------|----------------|------------------|
| 应付利息                           | -                | -                | -              | -     | -     | 4,488.81       | 4,488.81         |
| 应付利润                           | -                | -                | -              | -     | -     | -              | -                |
| 其他负债                           | -                | -                | -              | -     | -     | 219,000.00     | 219,000.00       |
| 负债总计                           | 64,979,847.51    | -                | -              | -     | -     | 207,394,233.49 | 272,374,081.00   |
| 利率敏感度缺口                        | 2,813,493,422.74 | 2,649,349,369.98 | 729,767,968.30 | -     | -     | -59,915,895.46 | 6,132,694,865.56 |
| 上年度末<br>2020 年<br>12 月 31<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                           | 200,147,912.82   | 79,000,000.00    | -              | -     | -     | -              | 279,147,912.82   |
| 结算备付金                          | 1,142,857.14     | -                | -              | -     | -     | -              | 1,142,857.14     |
| 存出保证金                          | 30,234.72        | -                | -              | -     | -     | -              | 30,234.72        |
| 交易性金融资产                        | 709,782,122.02   | 888,778,896.22   | 298,547,177.79 | -     | -     | -              | 1,897,108,196.03 |
| 买入返售金融资产                       | 1,240,127,220.20 | -                | -              | -     | -     | -              | 1,240,127,220.20 |
| 应收利息                           | -                | -                | -              | -     | -     | 13,462,408.61  | 13,462,408.61    |
| 应收申购款                          | -                | -                | -              | -     | -     | 2.00           | 2.00             |
| 资产总计                           | 2,151,230,346.90 | 967,778,896.22   | 298,547,177.79 | -     | -     | 13,462,410.61  | 3,431,018,831.52 |
| 负债                             |                  |                  |                |       |       |                |                  |
| 卖出回购金融资产款                      | 169,099,795.45   | -                | -              | -     | -     | -              | 169,099,795.45   |
| 应付管理人报酬                        | -                | -                | -              | -     | -     | 860,024.63     | 860,024.63       |
| 应付托管费                          | -                | -                | -              | -     | -     | 344,009.84     | 344,009.84       |

|         |                  |                |                |   |   |               |                  |
|---------|------------------|----------------|----------------|---|---|---------------|------------------|
| 应付销售服务费 | -                | -              | -              | - | - | 39,445.57     | 39,445.57        |
| 应付交易费用  | -                | -              | -              | - | - | 89,814.97     | 89,814.97        |
| 应付利息    | -                | -              | -              | - | - | 10,243.47     | 10,243.47        |
| 应交税费    | -                | -              | -              | - | - | 20,484.10     | 20,484.10        |
| 其他负债    | -                | -              | -              | - | - | 219,000.00    | 219,000.00       |
| 负债总计    | 169,099,795.45   | -              | -              | - | - | 1,583,022.58  | 170,682,818.03   |
| 利率敏感度缺口 | 1,982,130,551.45 | 967,778,896.22 | 298,547,177.79 | - | - | 11,879,388.03 | 3,260,336,013.49 |

注：表中所示为本基金资产及负债的利率风险敞口，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（2021 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 基准利率减少 25 个基点                                 | 2,196,200.54                | 1,261,737.33           |
|    | 基准利率增加 25 个基点                                 | -2,190,361.62               | -1,258,395.06          |

#### 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和银行间同业市场交易的固定收益品种以及买入返售金融资产，且

以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### **7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **7.4.14.1 公允价值**

###### **7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具**

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

###### **7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具**

###### **7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值**

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中属于第二层次的余额为人民币 239,212,652.21 元，无属于第一层次和第三层次的余额。（于 2020 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 1,897,108,196.03 元，无属于第一层次和第三层次的余额。）

###### **7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

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

本基金持有的交易性金融资产第三层次公允价值本期未发生变动。

##### **7.4.14.2 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### **7.4.14.3 其他事项**

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除此之外，截至资产负债表日，本基金无其他需要说明的其他重要事项。

##### **7.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2022 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 3,139,221,129.63 | 49.01         |
|    | 其中：债券             | 3,139,221,129.63 | 49.01         |
|    | 资产支持证券            | —                | —             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,663,655,427.54 | 25.97         |
|    | 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      | 1,454,714,051.36 | 22.71         |
| 4  | 其他各项资产            | 147,478,338.03   | 2.30          |
| 5  | 合计                | 6,405,068,946.56 | 100.00        |

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%) |                |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 1.77           |                |
|    | 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 | 64,979,847.51  | 1.06           |
|    | 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。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 55 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 56 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 19 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 46.94               | 4.41                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 3.58                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 39.62               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 3.42                | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 3.26                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 8.64                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                        | 102.04              | 4.41                |

注：本基金合同约定本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 378,884,549.45   | 6.18          |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 209,560,894.28   | 3.42          |
|    | 其中：政策性金融债 | 209,560,894.28   | 3.42          |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | 539,123,913.92   | 8.79          |
| 6  | 中期票据      | 220,925,407.43   | 3.60          |
| 7  | 同业存单      | 1,790,726,364.55 | 29.20         |
| 8  | 其他        | -                | -             |
| 9  | 合计        | 3,139,221,129.63 | 51.19         |

|    |                      |                |      |
|----|----------------------|----------------|------|
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 209,560,894.28 | 3.42 |
|----|----------------------|----------------|------|

## 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 债券数量(张)   | 摊余成本           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112110128 | 21 兴业银行 CD128  | 2,500,000 | 248,659,801.67 | 4.05         |
| 2  | 112109106 | 21 浦发银行 CD106  | 2,000,000 | 199,027,520.35 | 3.25         |
| 3  | 112111087 | 21 平安银行 CD087  | 2,000,000 | 199,022,456.49 | 3.25         |
| 4  | 219949    | 21 贴现国债 49     | 1,800,000 | 179,827,030.02 | 2.93         |
| 5  | 012103557 | 21 大唐发电 SCP007 | 1,500,000 | 149,949,419.00 | 2.45         |
| 6  | 112103022 | 21 农业银行 CD022  | 1,500,000 | 148,553,076.63 | 2.42         |
| 7  | 101900125 | 19 国电 MTN001   | 1,300,000 | 130,380,462.95 | 2.13         |
| 8  | 200217    | 20 国开 17       | 1,300,000 | 129,758,157.78 | 2.12         |
| 9  | 072110038 | 21 国信证券 CP015  | 1,000,000 | 100,026,600.87 | 1.63         |
| 10 | 012105246 | 21 电网 SCP028   | 1,000,000 | 99,934,958.47  | 1.63         |

## 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | -       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1324% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0189% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0653% |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 元。

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

### 8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券除“21 兴业银行 CD128（证券代码：112110128）、21 浦发银行 CD106（证券代码：112109106）、21 平安银行 CD087（证券代码：112111087）、21 农业银行 CD022（证券代码：112103022）、20 国开 17（证券代码：200217）”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。

### 8.9.3 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   | —              |
| 2  | 应收证券清算款 | —              |
| 3  | 应收利息    | 15,876,138.03  |
| 4  | 应收申购款   | 131,602,200.00 |
| 5  | 其他应收款   | —              |
| 6  | 待摊费用    | —              |
| 7  | 其他      | —              |
| 8  | 合计      | 147,478,338.03 |

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构            |         |               |        |
|-----------|----------|---------------|------------------|---------|---------------|--------|
|           |          |               | 机构投资者            |         | 个人投资者         |        |
|           |          |               | 持有份额             | 占总份额比例  | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 东吴增鑫宝货币 A | 2,353    | 15,933.25     | 22,644,521.24    | 60.40%  | 14,846,407.97 | 39.60% |
| 东吴增鑫宝货币 B | 61       | 99,921,376.01 | 6,095,203,936.35 | 100.00% | 0.00          | 0.00%  |
| 合计        | 2,414    | 2,540,470.12  | 6,117,848,457.59 | 99.76%  | 14,846,407.97 | 0.24%  |

注：基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）        | 占总份额比例 |
|----|-------|----------------|--------|
| 1  | 银行类机构 | 723,820,028.97 | 11.80% |
| 2  | 券商机构  | 611,578,696.49 | 9.97%  |
| 3  | 银行类机构 | 577,698,284.15 | 9.42%  |
| 4  | 其他机构  | 508,187,310.52 | 8.29%  |
| 5  | 银行类机构 | 500,070,234.97 | 8.15%  |
| 6  | 银行类机构 | 272,367,915.08 | 4.44%  |
| 7  | 其他机构  | 201,724,583.72 | 3.29%  |
| 8  | 其他机构  | 201,481,100.75 | 3.29%  |
| 9  | 券商机构  | 200,014,362.35 | 3.26%  |
| 10 | 银行类机构 | 200,000,000.00 | 3.26%  |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东吴增鑫宝货币 A | 1,579.77  | 0.0042%  |
|                  | 东吴增鑫宝     | —         | —        |

|  |      |          |         |
|--|------|----------|---------|
|  | 货币 B |          |         |
|  | 合计   | 1,579.77 | 0.0000% |

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。

#### 9.4 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

高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    | 东吴增鑫宝货币 A      | 东吴增鑫宝货币 B         |
|------------------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2016 年 11 月 7 日）基金<br>份额总额 | 485,411.20     | 272,023,000.23    |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 30,963,936.13  | 3,229,372,077.36  |
| 本报告期基金总申购份额                        | 138,835,479.05 | 25,068,837,916.34 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                      | 132,308,485.97 | 22,203,006,057.35 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”<br>填列）       | -              | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 37,490,929.21  | 6,095,203,936.35  |

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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金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 |    |
| 东吴证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

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

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

#### 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期无新增或退租席位。

## 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 |
| 东吴证券 | -    | -            | 1,120,100,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%（含）以上的情况。

## 11.9 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 2020 年年度资产净值公告                              | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 1 月 1 日  |
| 2  | 东吴基金管理有限公司关于参加平安银行股份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、中证信息网站 | 2021 年 1 月 8 日  |
| 3  | 东吴基金管理有限公司关于参加华宝证券有限责任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、中证信息网站 | 2021 年 1 月 12 日 |
| 4  | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额及转换业务的公告      | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 1 月 14 日 |
| 5  | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 6  | 东吴基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告                    | 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 | 2021 年 1 月 20 日 |
| 7  | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2020 年 4 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 | 2021 年 1 月 21 日 |
| 8  | 东吴增鑫宝货币市场基金 2020 年第 4 季度报告                                  | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 1 月 22 日 |
| 9  | 东吴增鑫宝货币市场基金基金经理变更                                           | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 1 月 22 日 |

|    |                                                             |                                   |                 |
|----|-------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|
| 10 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 1 月 23 日 |
| 11 | 东吴增鑫宝货币市场基金更新招募说明书以及产品资料概要                                  | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 1 月 26 日 |
| 12 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在北京植信基金销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告            | 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 | 2021 年 1 月 26 日 |
| 13 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在华瑞保险销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告              | 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 | 2021 年 1 月 26 日 |
| 14 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金海九州基金销售有限公司为代销机构、开通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 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 15 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在光大证券股份有限公司的定期定额业务的公告                   | 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 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 16 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为代销机构、开通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 | 2021 年 2 月 3 日  |
| 17 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年春节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            | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 18 | 东吴基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告                                     | 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 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 19 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 2 月 26 日 |
| 20 | 东吴基金管理有限公司关于旗下东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金新增民生证券                     | 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 | 2021 年 3 月 2 日  |

|    |                                                             |                                   |                 |
|----|-------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|
|    | 股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告                           |                                   |                 |
| 21 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增弘业期货股份有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 3 月 10 日 |
| 22 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东方财富证券股份有限公司的定期定额业务的公告                 | 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 | 2021 年 3 月 17 日 |
| 23 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为代销机构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 | 2021 年 3 月 23 日 |
| 24 | 东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告                            | 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 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 25 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2020 年年度报告                                      | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 3 月 31 日 |
| 26 | 东吴基金管理有限公司关于暂停中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告               | 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 | 2021 年 4 月 1 日  |
| 27 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 4 月 2 日  |
| 28 | 东吴基金管理有限公司关于暂停上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告                   | 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 | 2021 年 4 月 10 日 |
| 29 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年第 1 季度报告                                  | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 4 月 15 日 |
| 30 | 东吴基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司相关销售业务的公告                       | 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 | 2021 年 4 月 19 日 |
| 31 | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 年 1 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 | 2021 年 4 月 21 日 |
| 32 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年五一假期前暂停大额申购（含                             | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 4 月 27 日 |

|    |                                                               |                                   |                 |
|----|---------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|
|    | 定期定额)、大额转换转入业务的公告                                             |                                   |                 |
| 33 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 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              | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 6 月 8 日  |
| 34 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 6 月 11 日 |
| 35 | 东吴基金管理有限公司关于恢复使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告                      | 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 | 2021 年 6 月 16 日 |
| 36 | 东吴基金管理有限公司关于网上直销平台恢复农行网银直连支付开户与签约业务的公告                        | 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 | 2021 年 6 月 16 日 |
| 37 | 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 | 2021 年 6 月 19 日 |
| 38 | 东吴基金关于在公司直销开展赎回费率优惠活动的公告                                      | 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 | 2021 年 6 月 25 日 |
| 39 | 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                    | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 6 月 25 日 |
| 40 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在深圳市金海九州基金销售有限公司的定期定额业务的公告                | 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 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 41 | 东吴基金管理有限公司管理的基金 2021 年半年度基金净值公告                               | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 7 月 1 日  |
| 42 | 东吴增鑫宝货币市场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                 | 2021 年 7 月 2 日  |
| 43 | 东吴基金管理有限公司关于终止东吴基金手机 APP 服务及微信服务号交易功能的公告                      | 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 | 2021 年 7 月 3 日  |
| 44 | 东吴基金管理有限公司关于在直销网上交易平台开展转换业务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 | 2021 年 7 月 5 日  |

|    |                                                                 |                                   |                 |
|----|-----------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|
| 45 | 东吴增鑫宝货币市场基金更新招募说明书以及产品资料概要                                      | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 7 月 6 日  |
| 46 | 东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书及基金产品资料概要的补充提示                         | 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 | 2021 年 7 月 12 日 |
| 47 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 7 月 14 日 |
| 48 | 东吴基金管理有限公司关于参加鼎信汇金（北京）投资管理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、中证信息网站 | 2021 年 7 月 16 日 |
| 49 | 东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 年 2 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 | 2021 年 7 月 20 日 |
| 50 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年第 2 季度报告                                      | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 7 月 20 日 |
| 51 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华融证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 7 月 22 日 |
| 52 | 东吴基金管理有限公司关于参加国金证券股份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、中证信息网站 | 2021 年 7 月 24 日 |
| 53 | 东吴基金管理有限公司关于参加招商证券股份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、中证信息网站 | 2021 年 7 月 28 日 |
| 54 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 8 月 9 日  |
| 55 | 东吴基金管理有限公司关于参加中国工商银行股份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、中证信息网站 | 2021 年 8 月 25 日 |
| 56 | 东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告                                | 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 | 2021 年 8 月 27 日 |
| 57 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年中期报告                                          | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 8 月 27 日 |
| 58 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基                                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司          | 2021 年 8 月 28 日 |

|    |                                                                  |                                   |                  |
|----|------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|------------------|
|    | 金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告                               | 网站、中证信息网站                         |                  |
| 59 | 东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低定投金额的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、公司网站、中证信息网站           | 2021 年 9 月 8 日   |
| 60 | 东吴基金管理有限公司旗下基金招募说明书更新的提示性公告                                      | 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 | 2021 年 9 月 13 日  |
| 61 | 东吴增鑫宝货币市场基金更新招募说明书以及产品资料概要                                       | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 9 月 13 日  |
| 62 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年中秋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                 | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 9 月 14 日  |
| 63 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年国庆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                 | 上海证券报、公司网站、中证信息网站                 | 2021 年 9 月 27 日  |
| 64 | 东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2021 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 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 65 | 东吴增鑫宝货币市场基金 2021 年第 3 季度报告                                       | 公司网站、中证信息网站                       | 2021 年 10 月 27 日 |
| 66 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行同业易管家平台股份有限公司同业易管家平台为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告 | 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 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 67 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 10 月 30 日 |
| 68 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华林证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额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 | 2021 年 11 月 1 日  |
| 69 | 东吴基金管理有限公司关于参加国信证券股份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、中证信息网站 | 2021 年 11 月 24 日 |
| 70 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在渤海证券股                                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司          | 2021 年 11 月 24 日 |

|    |                                                                 |                                           |                     |
|----|-----------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|---------------------|
|    | 份有限公司的定期定额业务的公告                                                 | 网站、中证信息网站                                 |                     |
| 71 | 东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额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、<br>证券时报、证券日报、公司<br>网站、中证信息网站 | 2021 年 12 月 7<br>日  |
| 72 | 东吴基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告                       | 中国证券报、上海证券报、<br>证券时报、证券日报、公司<br>网站、中证信息网站 | 2021 年 12 月<br>10 日 |
| 73 | 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、开通定期定额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、<br>证券时报、证券日报、公司<br>网站、中证信息网站 | 2021 年 12 月<br>20 日 |
| 74 | 东吴基金管理有限公司关于平安银行股份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、<br>证券时报、证券日报、公司<br>网站、中证信息网站 | 2021 年 12 月<br>21 日 |
| 75 | 东吴基金管理有限公司关于暂停杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告                     | 中国证券报、上海证券报、<br>证券时报、证券日报、公司<br>网站、中证信息网站 | 2021 年 12 月<br>24 日 |
| 76 | 东吴基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司费率优惠的公告                                 | 中国证券报、上海证券报、<br>证券时报、证券日报、公司<br>网站、中证信息网站 | 2021 年 12 月<br>31 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              | 20210101-20210104        | 707,843,530.61 | 15,976,498.36    | 0.00             | 723,820,028.97 | 11.80% |
|       | 2              | 20210119-20210125        | 707,843,530.61 | 15,976,498.36    | 0.00             | 723,820,028.97 | 11.80% |
|       | 3              | 20210129-20210131        | 707,843,530.61 | 15,976,498.36    | 0.00             | 723,820,028.97 | 11.80% |
|       | 4              | 20210204-20210204        | 707,843,530.61 | 15,976,498.36    | 0.00             | 723,820,028.97 | 11.80% |
|       | 5              | 20210226-20210302        | 0.00           | 2,625,698,284.15 | 2,048,000,000.00 | 577,698,284.15 | 9.42%  |
|       | 6              | 20210323-20210329        | 0.00           | 2,625,698,284.15 | 2,048,000,000.00 | 577,698,284.15 | 9.42%  |
|       | 7              | 20210408-20211012        | 0.00           | 2,625,698,284.15 | 2,048,000,000.00 | 577,698,284.15 | 9.42%  |
|       | 8              | 20211028-20211031        | 0.00           | 2,625,698,284.15 | 2,048,000,000.00 | 577,698,284.15 | 9.42%  |
| 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。

### 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

2022 年 3 月 31 日