东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年第 1 季度报告

2025年3月31日

基金管理人: 东吴基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:二〇二五年四月二十二日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本 基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	016758
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年11月8日
报告期末基金份额总额	43, 313, 339. 61 份
	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获
投资目标	得与标的指数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪
	误差的最小化。
	本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化
	的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成
投资策略	份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造
	与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对
	标的指数的有效跟踪。
	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年
业绩比较基准	定期存款利率(税后)×5%
	本基金预期的风险与收益低于股票型基金、偏股混合
风险收益特征	型基金,高于货币市场基金。本基金主要投资于标的
	指数成份券及备选成份券,具有与标的指数相似的风
	险收益特征。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2025年1月1日 - 2025年3月31日)
1. 本期已实现收益	90, 995. 05
2. 本期利润	84, 216. 72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0027
4. 期末基金资产净值	45, 171, 801. 74
5. 期末基金份额净值	1.0429

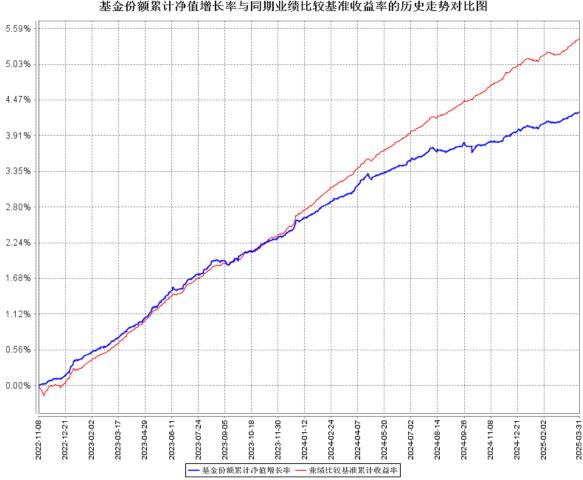
- 注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率 标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-(3)	2-4
过去三个月	0. 24%	0.01%	0. 34%	0. 01%	-0.10%	0.00%
过去六个月	0. 52%	0.01%	0. 94%	0.01%	-0.42%	0.00%
过去一年	1.21%	0.01%	2.06%	0.01%	-0.85%	0.00%
自基金合同 生效起至今	4. 29%	0.01%	5. 43%	0. 01%	-1.14%	0.00%

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



基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基		证券从业年限	说明
<u>姓石</u>		任职日期	离任日期	亚分 州业中限	\u00d7\u00d7
侯慧娣	固收投资 固 总 监	2023年10月 31日	_	15 年	侯慧娣女士,中国国籍,理学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职世商软件(上海)有限公司债券分析师,国信证券研究所固定收益分析师,德邦基金管理有限公司高级债券研究

	1				
					员、基金经理、固定
					收益部副总监, 国联
					安基金管理有限公司
					基金经理, 万家基金
					管理有限公司基金经
					理及现金管理部副总
					监(主持工作), 达诚
					基金管理有限公司总
					经理助理。2022 年 5
					月加入东吴基金管理
					有限公司,现任固收
					投资总监兼固定收益
					总部总经理、基金经
					理。2023年10月31
					日至 2025 年 1 月 21
					日担任东吴添利三个
					月定期开放债券型证
					券投资基金基金经
					理, 2023 年 10 月 31
					日至 2025 年 3 月 3 日
					担任东吴添瑞三个月
					定期开放债券型证券
					投资基金基金经理,
					2023年9月28日至今
					担任东吴增鑫宝货币
					市场基金基金经理,
					2023年10月31日至
					今担任东吴中证同业
					存单 AAA 指数 7 天持
					有期证券投资基金基
					金经理,2023年10月
					31 日至今担任东吴月
					月享30天持有期短债
					债券型证券投资基金
					基金经理,2023年11
					月 6 日至今担任东吴
					货币市场证券投资基
					金基金经理。
					王明欣女士,中国国
					籍,上海社会科学院
		9099年11日			经济学硕士, 具备证
王明欣	基金经理	2022年11月	_	7年	券投资基金从业资
		8日			格。2017年7月加入
					东吴基金管理有限公
					司,现任基金经理。
					77, 沙山坐亚江生。

					2021 年 7 月 12 日至
					2021 年 7 月 12 日至 2023 年 11 月 6 日担任
					东吴货币市场证券投
					资基金基金经理,
					2022年5月9日至今
					担任东吴瑞盈 63 个月
					定期开放债券型证券
					投资基金基金经理,
					2022 年 5 月 9 日至今
					担任东吴月月享30天
					持有期短债债券型证
					券投资基金基金经
					理,2022年11月8日
					至今担任东吴中证同
					业存单 AAA 指数 7 天
					持有期证券投资基金
					基金经理,2022 年 11 月 9 日至今担任东吴
					增鑫宝货币市场基金基金经理。
					举 <u>五</u> 红垤。 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。
					2018 年 4 月 23 日至
邵笛	基金经理	2024年9月	_	18 年	2021 年 9 月 1 日及
		25 日			2022 年 12 月 2 日至
					2025年1月21日担任
					东吴悦秀纯债债券型
					证券投资基金基金经
					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

年12月2日至2023年7月27日担任东吴中债1-3年政策设金融债捐数证券投资基金融金约里2022年5月9日至2024年4月10日担任东吴茂基金基金经里,2018年9月25日至今担任东吴港畲金经里,2014年9月25日至今担任东吴增畲金经理,2014年10月30日至今担任东吴增畲金经理,2014年10月30日至今担任东吴肃泰继基金是理。2014年10月30日至今担任东吴肃泰继基金是一2022年5月9日至债券型经回至今担任东吴肃泰继基金组百名个月定期班基金是百名个月定期班基金是百名个月定期班基金是百名个月定期班基金是百名个月定期于基金基金是一2023年7月21日三个月定期开放债券登回至个月定期开放债券型。2023年7月21日三个月定期开放债券投资基金基金经日至个月定期开放债券投资基金基金是1022年9月25日至今担任东吴城市发行,2023年7月21日三个月定期开放债券投资基金基金经理,2024年9月25日至外担任东吴城市发行,2023年7月21日三个月11日,2024年9月25日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年9月26日,2024年16日,2024年9			基金基金经理,2022
中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金处理,2022 年 5 月 9 日至 2024 年 4 月 10 日担任东吴从益金基金处理,2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日及 2021 年 9 月 28 日及 2021 年 9 月 28 日及 2021 年 9 月 28 日至今担任东吴。增鑫宝理,2014年 10 月 30 日场证券投资基金经理,2014年 10 月 30 日场证券投资基金经理,2014年 10 月 30 日场证券投资基金经理,2022 年 5 月 9 日债债券必经理 2022 年 12 月 26 日至今担任东政战基金经日产人捐益债券型经理 2023 年 3 月 3 日 三 证券,投资基金 月 6 三 证券,投资基金 7 月 定期开总量 1 三 元 2023 年 9 月 25 日 至 9 担任 明 26 日 至 今 担任 所 政 量金 经 20 年 9 月 25 日 30 天 持 有 期 6 票 段 债券 整 经 理,2024 年 9 月 25 日 30 天 持 有 期 6 票 段 债券 数 金 经 理,2024 年 9 月 25 日			年 12 月 2 日至 2023
融债指数证券投资基金基金经理,2022年5月9日至2024年4月10日担任东吴优益债券型延,2018年4月11日至2023年9月125日至今担任东吴增产金经理,2018年9月25日至今担任东吴增产金经理,2014年10月30日场中进投资年5月9日至债券投资率。2022年2月3日至今担任东吴基金基金经理,2022年12月26日至今担任东吴基常参经经日至个月定增债券经经日至个月定增债券经经日至个月定期开金基合日产化进升。2023年3月6日产证券投资基金月21日,2023年7月定期开金日产证券投资基金年至月度增加,2023年7月定期开金日产证券投资基金年至月度增加,2024年9月25日享30日,2024年9月25日,2024年17日,2024年17日,2024年17日,2024年17日,2024年17日,2024年17日,2024年17日,2024年17日,202			年7月27日担任东吴
金基金经理,2022年 5月9日至2024年4 月10日担任东吴代益 基金经理,2018年4 月月11日至2023年9 月28日及2024年9 月25日至今担任东吴 增鑫宝货币市场基金 基金经理,2014年10 月30日场正安少担任东吴 增金基金经理,2022年 5月9日至今担任东吴 鼎泰纯债债券型延理, 2022年12月2日26 2022年12月2日26 2022年12月2日26 2023年3月6日平分担任东吴陈 被债金基金经理,2023年3月6日平 2023年3月6日平 2023年7月滤淌类型延理, 2023年7月滤淌类型延理, 2023年7月滤淌类型延理, 2023年7月滤淌差经日个月定期开放金是日个月定期开放债金经理, 2024年9月25日至今担任东吴周债债券 投资基金经理, 2024年9月月6季型证明, 2024年9月25日			中债 1-3 年政策性金
5月9日至2024年4月10日担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理,2018年4月11日至2023年9月25日至今2024年9月25日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,2014年10月30日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理,2022年5月9日至今持型型证券投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴肃紊纯债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴泽清期层债费型证券投资基金基经理,2024年9月25日			融债指数证券投资基
月10日担任东吴优益 债券型证券投资基金 基金经理,2018 年 4 月11 日至 2023 年 9 月28 日及 2024 年 9 月25 日至今担任东吴 增鑫宝经理,2014 年 10 月30 日至今担任东吴 黄币市场证券投资基 金基金经理,2022 年 5月9日至今担任东吴 鼎泰纯债债券型证券 投资基金基金经理, 2022 年 12 月 2 日至今 担任东吴瑞盈务型 亚券 投资基金基金经理, 2023 年 3 月 6 日至今 担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023 年 7 月 21 日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年 9 月 25 日至今 担任东吴月月享30 天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年 9 月 25 日			金基金经理,2022年
债券型证券投资基金基金经理,2018年4月11日至2023年9月28日及2024年9月28日及2024年9月25日至今担任东吴增鑫宝货。2014年10月30日至今担任东吴增鑫宝货。2022年5月9日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴瑞泰型理,2022年12月2日至今担任东吴瑞勋营金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴所等型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月期短债债券型理,2024年9月25日至今担任东吴月周多0天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			5月9日至2024年4
基金经理,2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日及 2024 年 9 月 25 日至今担任东吴 增鑫宝货币市场基金 基金经理,2014 年 10 月 30 日至今担任东吴 货币市场证券投资基 金基金经理,2022 年 5 月 9 日至今担任东吴 鼎泰基金基理, 2022年 12 月 2 日至今 担任东吴瑞盈 63 个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年 3 月 6 日至今 担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年 7 月 21 日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债金经理, 2024年 9 月 25 日至今 担任东吴月月享 30 天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年 9 月 25 日			月 10 日担任东吴优益
月 11 日至 2023 年 9 月 28 日及 2024 年 9 月 28 日及 2024 年 9 月 25 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。2014 年 10 月 30 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 9 日至今担任东吴鼎泰纯遗债债券型证券投资基金基全理,2022 年 12 月 2 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 6 日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2023 年 7 月 21 日至今担任东吴添养型证券投资基金基金经理。2024年 9 月 25 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理。2024年 9 月 25 日			债券型证券投资基金
月 28 日及 2024 年 9 月 25 日至今担任东吴 增鑫宝货币市场基金 基金经理,2014 年 10 月 30 日至今担任东吴 货币市场证券投资基 金基金经理,2022 年 5 月 9 日至今担任东吴 鼎泰纯债债券型证券 投资基金基金经理,2022 年 12 月 2 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券金经理,2023 年 3 月 6 日至今担任东吴添看三个月定期开放债券型证券 投资基金基金经理,2023 年 7 月 21 日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券 投资基金基金经理,2024年 9 月 25 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券 投资基金基金经理,2024年 9 月 25 日			基金经理, 2018 年 4
月 25 日至今担任东吴 增鑫宝货币市场基金 基金经理,2014年10 月 30 日至今担任东吴 货币市场证券投资基 金基金经理,2022年 5月9日至今担任东吴 鼎泰纯债债券型证券 投资基金基金经理, 2022年12月2日至今 担任东吴瑞窟63个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年3月6日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴局拜930天 持有期短债债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日			月 11 日至 2023 年 9
增鑫宝货币市场基金基金经理,2014年10月30日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理,2022年5月9日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴瑞盈63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			月 28 日及 2024 年 9
基金经理,2014年10月30日至今担任东吴 货币市场证券投资基金基金经理,2022年 5月9日至今担任东吴 鼎泰纯债债券型证券 投资基金基金经理,2022年12月2日至今 担任东吴瑞盈63个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理,2023年3月6日至今 担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理,2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理,2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经理,2024年9月25日			月 25 日至今担任东吴
月30日至今担任东吴 货币市场证券投资基 金基金经理,2022年 5月9日至今担任东吴 鼎泰建金基金经理, 2022年12月2日至今 担任东吴瑞债6券型证券 投资基金基金经理, 2023年3月6日至今 担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经理, 2024年9月25日			增鑫宝货币市场基金
货币市场证券投资基金基金经理,2022年5月9日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴瑞盈63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			基金经理,2014年10
金基金经理,2022年5月9日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴瑞盈63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			月 30 日至今担任东吴
5月9日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴瑞盈63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			货币市场证券投资基
鼎泰纯债债券型证券 投资基金基金经理, 2022年12月2日至今 担任东吴瑞盈63个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年3月6日至今 担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			金基金经理,2022年
投资基金基金经理,2022年12月2日至今担任东吴瑞盈63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			5月9日至今担任东吴
2022年12月2日至今担任东吴瑞盈63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			鼎泰纯债债券型证券
担任东吴瑞盈 63 个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023 年 3 月 6 日至今 担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023 年 7 月 21 日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024 年 9 月 25 日至今 担任东吴月月享 30 天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经理,2024 年 9 月 25 日			投资基金基金经理,
定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			2022年12月2日至今
投资基金基金经理, 2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理, 2024年9月25日			担任东吴瑞盈63个月
2023年3月6日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2023年7月21日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			定期开放债券型证券
担任东吴添利三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			投资基金基金经理,
定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			2023年3月6日至今
投资基金基金经理, 2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			担任东吴添利三个月
2023年7月21日至今 担任东吴添瑞三个月 定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			定期开放债券型证券
担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			投资基金基金经理,
定期开放债券型证券 投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			2023年7月21日至今
投资基金基金经理, 2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			担任东吴添瑞三个月
2024年9月25日至今 担任东吴月月享30天 持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			定期开放债券型证券
担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2024年9月25日			投资基金基金经理,
持有期短债债券型证 券投资基金基金经 理,2024年9月25日			2024年9月25日至今
券投资基金基金经 理,2024年9月25日			担任东吴月月享30天
理,2024年9月25日			持有期短债债券型证
			券投资基金基金经
			理,2024年9月25日
			至今担任东吴中证同
业存单 AAA 指数 7 天			业存单 AAA 指数 7 天
持有期证券投资基金			持有期证券投资基金
基金经理。			基金经理。

注: 1、任职日期和离任日期一般情况下指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

- 2、侯慧娣自2025年4月2日起不再担任该基金基金经理。
- 3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理 办法》的相关规定。

4.1.1 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

本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。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 报告期内基金投资策略和运作分析

- 一季度经济呈结构性修复,1-2月经济数据显示一季度经济韧性尚可,但主要是逆周期调节 发力的结果,结构仍相对较弱,内需改善仍有待观察。两会已确认了全年财政政策力度,基本符 合预期,但发力窗口或提前。而货币政策则处于相机抉择模式。房地产、出口等方面仍存在较大 不确定性,基本面改善的持续性仍需观察。
- 一季度央行"防空转"的态度比较明确,资金利率基本维持在 1.80%以上,但资金利率中枢逐月下行,根据 wind 数据,R007 在 1 月、2 月、3 月的中位数分别为 2.10%、2.08%、1.83%。春节后,资金持续处于紧平衡状态,主要原因包括开门红效应下 1 月信贷投放较快、同业存款大行负债稀缺、汇率压力下央行持续回笼流动性等,2 月税期资金价格一度上行至 2.6%。3 月 MLF 招标方式改变为"固定数量、利率招标、多重价位中标",政策利率属性完全退出,后续将成为类似买断式回购的数量型工具,货币政策框架建设更加完善。3 月在大行负债压力逐步缓解叠加央

行态度软化的背景下,流动性维持平稳宽松格局,跨季流动性平稳。

2025年一季度,受银行负债短缺影响叠加央行在公开市场投放态度审慎,1年期 AAA 国股存单从 1.60%附近的低点缓步上行。2月受一二级存单市场供需力量失衡影响,到2月底1年期 AAA 国股存单最高上行至2.0%。随后随着大行负债压力的缓解,资金利率中枢逐步下移,同时进入3月,理财和货基的配置需求回归,截止3月底,1年期 AAA 国股存单下行至1.88%附近。(以上数据来源: wind)

本基金在报告期内,密切跟踪央行动态及市场参与者行为,根据市场波动适时调整持仓。在 对 AAA 同业存单指数进行有效跟踪的同时,灵活运用杠杆套息策略和票息策略力争增厚组合收益, 在保证组合各项指标合规的前提下,努力为基金持有人获取合理收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0429 元;本报告期基金份额净值增长率为 0.24%,业绩比较基准收益率为 0.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,因赎回等原因,本基金于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 31 日出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,基金管理人已上报中国证监会并采取适当措施。自 2024 年 12 月 25 日起,在本基金基金资产净值达到五千万元前,本基金的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等各类固定费用由基金管理人承担。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的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	_	-
	其中: 股票	_	-
2	基金投资	_	-
3	固定收益投资	40, 426, 290. 32	87. 48
	其中:债券	40, 426, 290. 32	87. 48
	资产支持证券	_	_
4	贵金属投资	_	-
5	金融衍生品投资	_	_
6	买入返售金融资产	_	_
	其中: 买断式回购的买入返售	_	-

	金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	900, 755. 60	1. 95
8	其他资产	4, 885, 127. 68	10. 57
9	合计	46, 212, 173. 60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2, 991, 036. 59	6. 62
2	央行票据	_	-
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	_	_
4	企业债券		_
5	企业短期融资券	2, 004, 662. 47	4. 44
6	中期票据	2, 032, 135. 34	4. 50
7	可转债(可交换债)	_	_
8	同业存单	33, 398, 455. 92	73. 94
9	其他	-	_
10	合计	40, 426, 290. 32	89. 49

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产净值 比例(%)
1	112402079	24 工商银行 CD079	30, 000	2, 996, 547. 31	6. 63
2	259917	25 贴现国债 17	30, 000	2, 991, 036. 59	6. 62
3	112408363	24 中信银行 CD363	30, 000	2, 988, 238. 27	6. 62
4	112405240	24 建设银行 CD240	30, 000	2, 983, 621. 29	6. 61
5	112471749	24 杭州银行 CD255	25, 000	2, 490, 554. 51	5. 51

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

- **5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细** 本基金本报告期末未持有贵金属。
- **5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细** 本基金本报告期末未持有权证。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	36. 68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4, 885, 091. 00

6	其他应收款	_
7	其他	-
8	合计	4, 885, 127. 68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	21, 451, 164. 97
报告期期间基金总申购份额	68, 812, 179. 97
减:报告期期间基金总赎回份额	46, 950, 005. 33
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"	
填列)	_
报告期期末基金份额总额	43, 313, 339. 61

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资 报告期内持有基金份额变化情况 报	报告期末持有基金情况
---------------------	------------

者类 别	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	20250219 – 20250219	4, 296. 45	4, 804, 920. 24	0.00	4, 809, 216. 69	11. 10%
	2	20250115 – 20250218	871, 080. 14	6, 727, 534. 84	7, 590, 000. 00	8, 614. 98	0. 02%

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件;
- 2、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》;
- 3、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》:
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- 5、报告期内东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金在中国证监会指定媒介上披 第 13 页 共 14 页

露的各项公告。

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站: http://www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 (021) 50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司 2025年4月22日