

东吴增鑫宝货币市场基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限	40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	41

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	42
7.8 期末按公允价值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	42
7.9 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	47
10.9 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 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	11,988,159,871.40 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	东吴增鑫宝货币 C	东吴增鑫宝货币 D
下属分级基金的交易代码	003588	003589	019771	020240
报告期末下属分级基金的份额总额	1,506,218,355.13 份	9,706,471,150.79 份	118,331,719.49 份	657,138,645.99 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	胡燕
	联系电话	021-50509888-8308	0571-87659392
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	zsyhzctgb@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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		200120	310006

法定代表人	李素明	陈海强
-------	-----	-----

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)			
期间数据和指标	东吴增鑫宝货币 A	东吴增鑫宝货币 B	东吴增鑫宝货币 C	东吴增鑫宝货币 D
本期已实现收益	7,502,717.40	19,461,469.97	744,864.99	1,103,486.99
本期利润	7,502,717.40	19,461,469.97	744,864.99	1,103,486.99
本期净值收益率	0.5303%	0.6510%	0.6510%	0.5318%
3.1.2	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			
期末基金资产净值	1,506,218,355.13	9,706,471,150.79	118,331,719.49	657,138,645.99
期末基金份额	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

净值				
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			
累计净 值收益 率	22.5986%	25.4684%	4.2641%	3.3774%

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 值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.2540%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	-0.082 6%	0.0011 %
过去六个月	0.5303%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	-0.139 2%	0.0011 %
过去一年	1.1347%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	-0.215 3%	0.0012 %
过去三年	4.2708%	0.0013%	4.0537%	0.0000%	0.2171 %	0.0013 %
过去五年	8.1251%	0.0019%	6.7537%	0.0000%	1.3714 %	0.0019 %
过去七年	12.5315 %	0.0020%	9.4574%	0.0000%	3.0741 %	0.0020 %
自基金合同生效起 至今	22.5986 %	0.0029%	13.0303%	0.0000%	9.5683 %	0.0029 %

阶段	份额净 值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.3139%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	-0.022 7%	0.0011 %
过去六个月	0.6510%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	-0.018 5%	0.0011 %
过去一年	1.3772%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.0272 %	0.0012 %
过去三年	5.0228%	0.0013%	4.0537%	0.0000%	0.9691 %	0.0013 %
过去五年	9.4292%	0.0019%	6.7537%	0.0000%	2.6755 %	0.0019 %
过去七年	14.4374 %	0.0020%	9.4574%	0.0000%	4.9800 %	0.0020 %
自基金合同生效起 至今	25.4684 %	0.0029%	13.0303%	0.0000%	12.438 1%	0.0029 %

东吴增鑫宝货币 C

阶段	份额净 值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.3139%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	-0.022 7%	0.0011 %
过去六个月	0.6510%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	-0.018 5%	0.0011 %
过去一年	1.3773%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.0273 %	0.0012 %
自基金合同生效起 至今	4.2641%	0.0013%	3.5544%	0.0000%	0.7097 %	0.0013 %

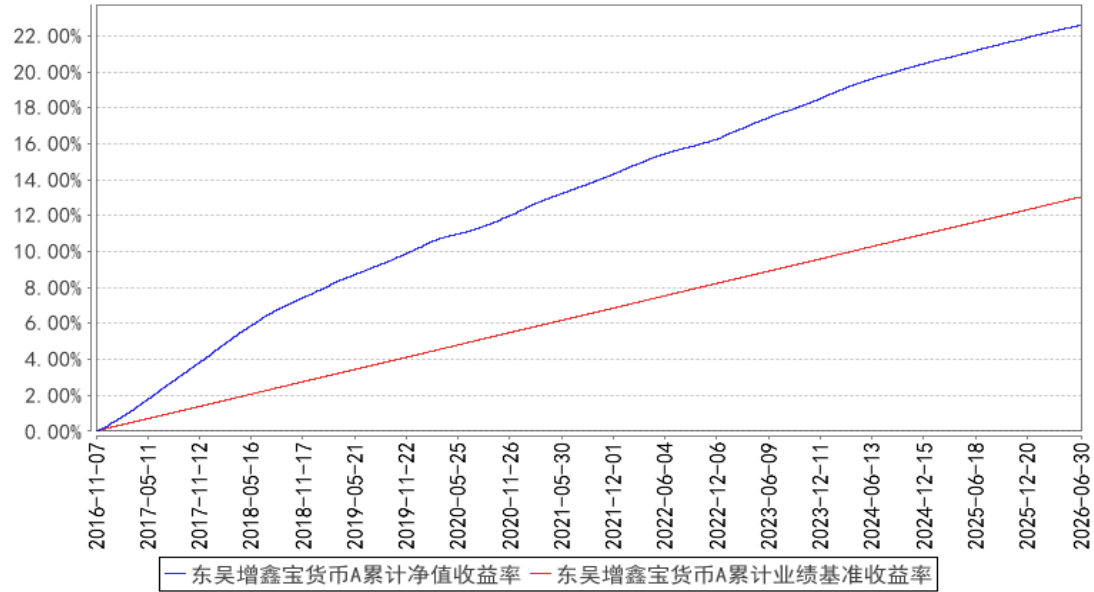
东吴增鑫宝货币 D

阶段	份额净值 值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.2545%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	-0.082 1%	0.0011 %
过去六个月	0.5318%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	-0.137 7%	0.0011 %
过去一年	1.1352%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	-0.214 8%	0.0012 %
自基金合同生效起 至今	3.3774%	0.0012%	3.3990%	0.0000%	-0.021 6%	0.0012 %

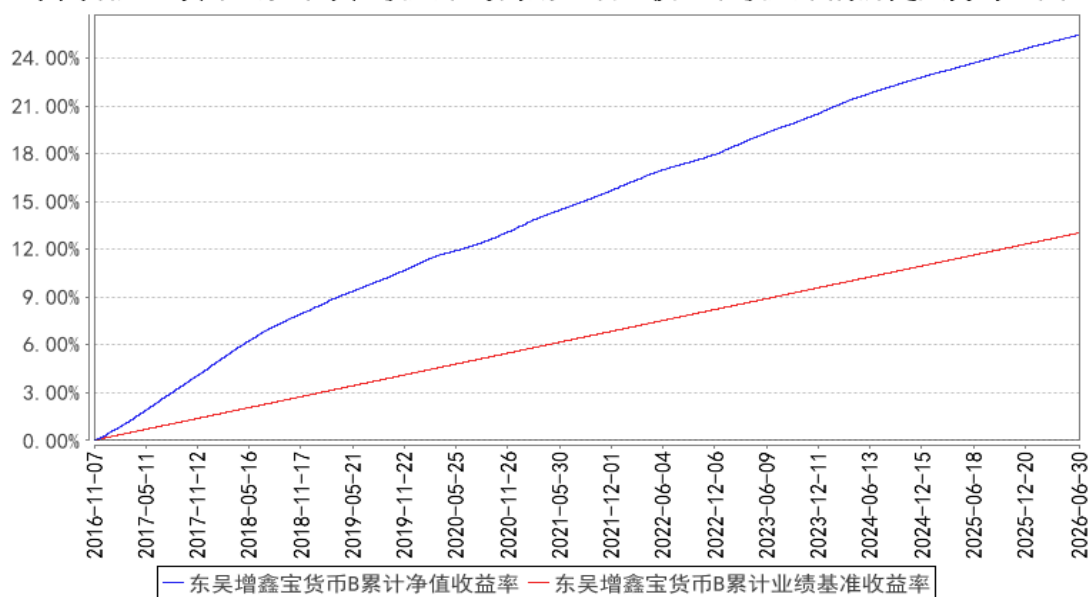
注： 本基金收益分配按日结转份额。

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

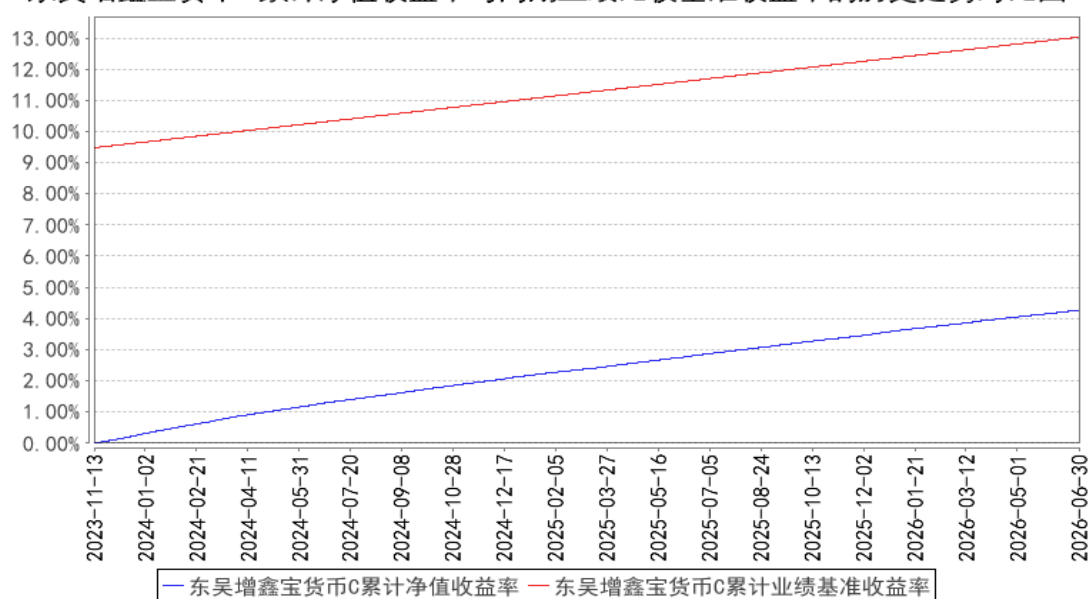
东吴增鑫宝货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



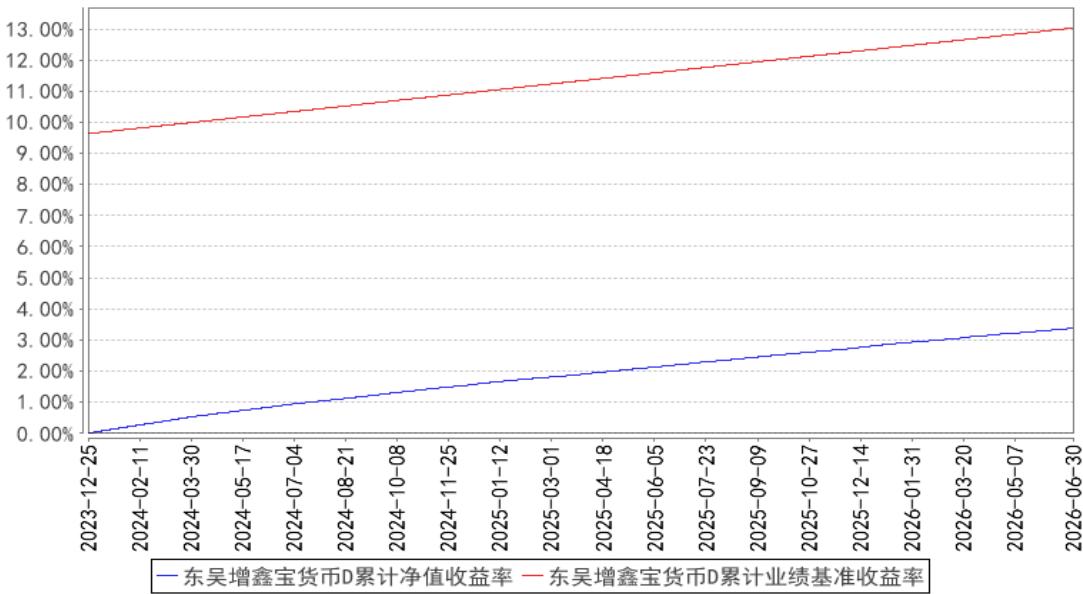
东吴增鑫宝货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东吴增鑫宝货币C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



东吴增鑫宝货币D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2023 年 11 月 13 日开始分为 A、B、C 三类基金份额。

2、本基金于 2023 年 12 月 25 日起增设 D 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王明欣	基金经理	2022 年 11 月 9 日	-	8 年	王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017 年 7 月加入东吴基金管理有限公司,现任基金经理。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，2026 年 3 月 27 日至今担任东吴恒益纯债债券型证券投资基金基金经理。
邵笛	基金经理	2024 年 9 月 25 日	-	19 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。2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日及 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基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至 2023 年 7 月 27 日担任东吴中债 1-3 年政策性金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，2025 年 6 月 17 日至今担任东吴中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 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 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对公司旗下所有投资组合及交易进行了相关分析，未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年经济情况呈“前高后低”走势。结构上呈外强内弱、供强需弱的特征。出口持续走强，AI 产业链和新三样（新能源相关）共同支撑外需韧性，是上半年经济最重要的支撑项。但内需有待改善，居民信心不足制约消费和地产复苏，信贷投放有待修复。具体来看，一季度实现“开门红”，GDP 增速 5.0%，2 月通胀、出口、3 月 PMI 均超预期，一线地产热度好转，基本面

呈复苏态势。二季度有所回落，GDP 增速降至 4.3%，社零同比仅增 0.2%，单月一度负增，总投资及地产、制造业、基建三大分项投资同比跌幅均走阔。

2026 年上半年债市表现较强，上半年 10 年国债活跃券收益率呈下行态势，在 1.70%-1.90% 区间内震荡走强。一季度中短端信用表现相对强势，二季度中长期利率债更优。年初以来银行存款端流出情况好于预期，而贷款需求较弱，短端流动性充裕，同业活期存款利率调降，资金利率走低，支撑短端表现。1 年期国债收益率下行至 1.20%，一季度 1 年期国股大行存单下行至 1.50% 附近。二季度人民币升值，带动企业结汇，带来了增量流动性。4-5 月资金利率明显低于政策利率，市场对资金面乐观程度逐步升温，带动长短端同时下行，存单市场供不应求，收益率震荡下行，随后，央行在公开市场明显回收流动性，资金利率回到政策利率附近，根据 WIND 数据，1 年期国股存单最低下行至 1.4275% 附近，2 季度大部分时间在 1.45-1.50% 窄幅震荡。（以上数据来源于 WIND）

本基金在报告期内，根据不同时间段的经济环境和市场特点，积极灵活的选择配置时机，调整组合久期。今年以来资金和存单的季节性特征减弱，本组合在尽力保证组合流动性安全的前提下，逢调整积极配置。同时控制投资组合偏离度，致力防范市场波动风险。在保证各项指标合规的前提下构建投资组合，进行主动投资，尽全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

本报告期东吴增鑫宝货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5303%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%；本报告期东吴增鑫宝货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6510%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%；本报告期东吴增鑫宝货币 C 的基金份额净值收益率为 0.6510%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%；本报告期东吴增鑫宝货币 D 的基金份额净值收益率为 0.5318%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年基本面压力仍存，经济“K 型分化”或将继续，仍需要支持性的货币政策保驾护航，同时信贷投放仍面对挑战，资产荒大背景不变，债市大幅调整的风险可能相对较低。下半年存款利率或仍存在下调空间，存单和资金的季节性特征减弱，我们将逢调整配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理可参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关约定，本基金的收益分配采用“每日分配、按日支付”的原则。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每日支付。本报告期东吴增鑫宝货币 A 级基金应分配收益 7,502,717.40 元，实际分配收益 7,502,717.40 元；东吴增鑫宝货币 B 级基金应分配收益 19,461,469.97 元，实际分配收益 19,461,469.97 元；东吴增鑫宝货币 C 级基金应分配收益 744,864.99 元，实际分配收益 744,864.99 元；东吴增鑫宝货币 D 级基金应分配收益 1,103,486.99 元，实际分配收益 1,103,486.99 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金的管理人——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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 2026 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,901,396,038.79	1,063,561,926.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,917,853,276.51	7,606,501,272.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,917,853,276.51	7,606,501,272.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,220,521,256.84	2,616,958,781.92
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	14,206,852.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		12,039,770,572.14	11,301,228,833.06
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		49,823,630.98	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		760,219.88	495,201.77
应付托管费		304,087.95	198,080.69
应付销售服务费		404,556.63	214,271.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		49,107.06	28,220.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	269,098.24	302,182.65
负债合计		51,610,700.74	1,237,957.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	11,988,159,871.40	11,299,990,875.47
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		11,988,159,871.40	11,299,990,875.47
负债和净资产总计		12,039,770,572.14	11,301,228,833.06

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 11,988,159,871.40 份，其中东吴增鑫宝货币 A 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,506,218,355.13 份；东吴增鑫宝货币 B 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,706,471,150.79 份；东吴增鑫宝货币 C 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 118,331,719.49 份；东吴增鑫宝货币 D 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 657,138,645.99 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		42,444,810.07	24,862,040.92
1. 利息收入		15,547,409.65	5,952,214.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,105,478.75	472,417.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,441,930.90	5,479,797.48

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,897,400.42	18,909,826.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	26,897,400.42	18,909,826.26
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	-	-
减：二、营业总支出		13,632,270.72	6,926,181.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,725,473.40	3,209,009.82
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,890,189.35	1,283,603.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,175,975.94	457,334.93
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,720,050.59	1,862,364.12
其中：卖出回购金融资产 支出		4,720,050.59	1,862,364.12
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		22,763.28	5,603.34
8. 其他费用	6.4.7.18	97,818.16	108,265.15
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		28,812,539.35	17,935,859.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		28,812,539.35	17,935,859.57
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		28,812,539.35	17,935,859.57

6.3 净资产变动表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,299,990,875.47	-	-	11,299,990,875.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,299,990,875.47	-	-	11,299,990,875.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	688,168,995.93	-	-	688,168,995.93
(一)、综合收益总额	-	-	28,812,539.35	28,812,539.35
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	688,168,995.93	-	-	688,168,995.93
其中：1. 基金申购款	85,014,045,345.96	-	-	85,014,045,345.96
2. 基金赎回款	-84,325,876,350.03	-	-	-84,325,876,350.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-28,812,539.35	-28,812,539.35
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	11,988,159,871	-	-	11,988,159,871.

	. 40			40
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	9,834,866,019.82	-	-	9,834,866,019.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	9,834,866,019.82	-	-	9,834,866,019.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,121,822,342.51	-	-	-4,121,822,342.51
(一)、综合收益总额	-	-	17,935,859.57	17,935,859.57
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-4,121,822,342.51	-	-	-4,121,822,342.51
其中：1. 基金申购款	13,355,623,144.08	-	-	13,355,623,144.08
2. 基金赎回款	-17,477,445,486.59	-	-	-17,477,445,486.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-17,935,859.57	-17,935,859.57
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,713,043,677.31	-	-	5,713,043,677.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>李素明</u>	<u>李素明</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

6.4 报表附注

6.4.1 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”）证监基金字[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，《东吴增鑫宝货币市场基金基金合同》（以下简称《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。

根据 2023 年 11 月 10 日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴增鑫宝货币市场基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》及 2023 年 12 月 22 日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴增鑫宝货币市场基金增加 D 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，2023 年 11 月 13 日起对本基金增加 C 类基金份额，2023 年 12 月 25 日起对本基金增加 D 类基金份额。本基金增加 C 类和 D 类基金份额后，将形成 A 类、B 类、C 类和 D 类四类基金份额并分别设置对应的基金代码（A 类基金份额代码：003588；B 类基金份额代码：003589；C 类基金份额代码：019771；D 类基金份额代码：020240）。

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）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公

开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免

征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,901,396,038.79
等于：本金	1,900,990,550.75
加：应计利息	405,488.04
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,901,396,038.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,917,853,276.51	6,919,133,194.20	1,279,917.69	0.0107
	合计	6,917,853,276.51	6,919,133,194.20	1,279,917.69	0.0107
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,917,853,276.51	6,919,133,194.20	1,279,917.69	0.0107

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,220,521,256.84	-
合计	3,220,521,256.84	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	180,755.08
其中：交易所市场	-
银行间市场	180,755.08
应付利息	-

应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	19,835.79
应付账户维护费	9,000.00
合计	269,098.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴增鑫宝货币 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,646,172,206.63	3,646,172,206.63
本期申购	16,009,805,507.16	16,009,805,507.16
本期赎回（以“-”号填列）	-18,149,759,358.66	-18,149,759,358.66
本期末	1,506,218,355.13	1,506,218,355.13

东吴增鑫宝货币 B

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,326,885,578.46	7,326,885,578.46
本期申购	66,789,418,804.40	66,789,418,804.40
本期赎回（以“-”号填列）	-64,409,833,232.07	-64,409,833,232.07
本期末	9,706,471,150.79	9,706,471,150.79

东吴增鑫宝货币 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	133,605,918.67	133,605,918.67
本期申购	243,783,105.40	243,783,105.40
本期赎回（以“-”号填列）	-259,057,304.58	-259,057,304.58
本期末	118,331,719.49	118,331,719.49

东吴增鑫宝货币 D

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	193,327,171.71	193,327,171.71
本期申购	1,971,037,929.00	1,971,037,929.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,507,226,454.72	-1,507,226,454.72
本期末	657,138,645.99	657,138,645.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	7,502,717.40	-	7,502,717.40
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	-7,502,717.40	-	-7,502,717.40
本期末	-	-	-

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	19,461,469.97	-	19,461,469.97
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	-19,461,469.97	-	-19,461,469.97
本期末	-	-	-

东吴增鑫宝货币 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	744,864.99	-	744,864.99
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	-744,864.99	-	-744,864.99
本期末	-	-	-

东吴增鑫宝货币 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,103,486.99	-	1,103,486.99
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,103,486.99	-	-1,103,486.99
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,030,261.09
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	75,217.66
合计	4,105,478.75

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	24,797,019.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,100,381.39
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	26,897,400.42

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,693,106,434.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,646,777,533.04
减：应计利息总额	44,228,519.86
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	2,100,381.39

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	475.00
合计	97,818.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
东吴证券股份有限公司（“东吴证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东吴证券	-	-	20,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付的关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,725,473.40	3,209,009.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,551,574.04	756,746.06
应支付基金管理人的净管理费	3,173,899.36	2,452,263.76

注：自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 7 月 6 日，本基金的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

根据《东吴基金管理有限公司关于东吴增鑫宝货币市场基金调低管理费率、托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2025 年 7 月 7 日起，本基金的管理费年费率由 0.25% 下调至 0.20%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,890,189.35	1,283,603.99

注：自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 7 月 6 日，本基金的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

根据《东吴基金管理有限公司关于东吴增鑫宝货币市场基金调低管理费率、托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2025 年 7 月 7 日起，本基金的托管费年费率由 0.10% 下调至 0.08%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.08\%\div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期				
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	东吴增鑫宝货 币 C	东吴增鑫宝货 币 D	合计
东吴基金管理有 限公司	18,430.91	25,329.88	12.01	10.91	43,783.71
浙商银行股份有 限公司	623.21	0.00	5,664.84	-	6,288.05
东吴证券	1.81	4,480.06	-	-	4,481.87
合计	19,055.93	29,809.94	5,676.85	10.91	54,553.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间				
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	东吴增鑫宝货 币 C	东吴增鑫宝货 币 D	合计
东吴基金管理有 限公司	4,657.87	31,798.07	0.22	6.03	36,462.19
浙商银行股份有 限公司	2,519.89	-	998.89	-	3,518.78
东吴证券	1.81	956.85	-	-	958.66
合计	7,179.57	32,754.92	999.11	6.03	40,939.63

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 级降级为 A 级的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 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。C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，C 类基金份额不进行基金份额升降级。D 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，D 类基金份额不进行基金份额升降级。四类基金份额销售服务费的计算方法相同，计算公式如下：

$$H=E\times\text{年销售服务费率}\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额基金资产净值

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	1,001,070,291.75	79,811.68	1,531,889.16	1,565.36

注：本基金的银行存款由托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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
7,502,717.40	-	-	7,502,717.40	-
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
19,461,469.97	-	-	19,461,469.97	-
东吴增鑫宝货币 C				
已按再投资形式转	直接通过应付	应付利润	本期利润分配合	备注

实收基金	赎回款转出金额	本年变动	计	
744,864.99	-	-	744,864.99	-
东吴增鑫宝货币 D				
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
1,103,486.99	-	-	1,103,486.99	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 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、审计等方面专业人员。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,174,206,878.61	780,287,373.61
合计	1,174,206,878.61	780,287,373.61

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,629,687,354.09	6,330,971,435.18
合计	5,629,687,354.09	6,330,971,435.18

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	10,233,423.34	8,115,193.61
AAA 以下	-	8,115,938.98
未评级	103,725,620.47	479,011,331.06
合计	113,959,043.81	495,242,463.65

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标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，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	1,901,396,038.79	-	-	-	1,901,396,038.79
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	6,762,873,453.87	150,869,578.78	4,110,243.86	-	6,917,853,276.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,220,521,256.84	-	-	-	3,220,521,256.84
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,884,790,749.50	150,869,578.78	4,110,243.86	-	12,039,770,572.14
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	49,823,630.98	49,823,630.98
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	760,219.88	760,219.88

应付托管费	-	-	-	304,087.95	304,087.95
应付销售服务费	-	-	-	404,556.63	404,556.63
应交税费	-	-	-	49,107.06	49,107.06
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	269,098.24	269,098.24
负债总计	-	-	-	51,610,700.74	51,610,700.74
利率敏感度缺口	11,884,790,749.50	150,869,578.78	4,110,243.86	-51,610,700.74	11,988,159,871.40
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	1,063,561,926.52	-	-	-	1,063,561,926.52
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	7,541,674,772.54	63,788,351.40	1,038,148.50	-	7,606,501,272.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,616,958,781.92	-	-	-	2,616,958,781.92
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,206,852.18	14,206,852.18
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,222,195,480.98	63,788,351.40	1,038,148.50	14,206,852.18	11,301,228,833.06
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	495,201.77	495,201.77
应付托管费	-	-	-	198,080.69	198,080.69
应付销售服务费	-	-	-	214,271.85	214,271.85
应交税费	-	-	-	28,220.63	28,220.63
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	302,182.65	302,182.65
负债总计	-	-	-	1,237,957.59	1,237,957.59
利率敏感度缺口	11,222,195,480.98	63,788,351.40	1,038,148.50	12,968,894.59	11,299,990,875.47

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	4,109,978.37	3,846,379.47
	基准利率增加 25 个基点	-4,103,154.08	-3,841,484.26

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于交易所或银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且按实际利率计算账面价值，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 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到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	6,917,853,276.51	7,606,501,272.44
第三层次	-	-
合计	6,917,853,276.51	7,606,501,272.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,917,853,276.51	57.46
	其中：债券	6,917,853,276.51	57.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,220,521,256.84	26.75
	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	1,901,396,038.79	15.79
4	其他各项资产	-	-
5	合计	12,039,770,572.14	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	14.50	
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	50.80	0.42
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	7.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.66	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		100.35	0.42

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	268,348,105.15	2.24
	其中：政策性 金融债	268,348,105.15	2.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	905,858,773.46	7.56
6	中期票据	113,959,043.81	0.95
7	同业存单	5,629,687,354.09	46.96
8	其他	-	-
9	合计	6,917,853,276.51	57.71
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112504058	25 中国银行 CD058	5,000,000	498,918,360.15	4.16
2	250211	25 国开 11	2,650,000	268,348,105.15	2.24
3	112608024	26 中信银行 CD024	2,000,000	199,834,960.42	1.67
4	112508227	25 中信银行 CD227	2,000,000	199,770,982.69	1.67
5	112514131	25 江苏银行 CD131	2,000,000	199,770,523.98	1.67
6	112608171	26 中信银行 CD171	2,000,000	199,289,592.64	1.66

6	112697767	26 广州银行 CD101	2,000,000	199,289,592.64	1.66
7	112621098	26 渤海银行 CD098	2,000,000	199,280,288.48	1.66
8	112616037	26 上海银行 CD037	2,000,000	199,256,244.32	1.66
9	112603094	26 农业银行 CD094	2,000,000	198,926,669.77	1.66
10	112608160	26 中信银行 CD160	1,960,000	195,391,702.43	1.63

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0542%
报告期内偏离度的最低值	0.0107%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0337%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 元。

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

7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中“25 中国银行 CD058（证券代码：112504058），25 国开 11（证券代码：250211），26 中信银行 CD024（证券代码：112608024），25 中信银行 CD227（证券代码：112508227），26 广州银行 CD101（证券代码：112697767），26 中信银行 CD171（证券代码：112608171），26 上海银行 CD037（证券代码：112616037），26 农业银行 CD094（证券代码：112603094）”的发行主体在报告编制日前一年内受到监管部门的处罚。

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。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
东吴增鑫宝货币 A	342,867	4,393.01	56,483,188.32	3.75	1,449,735,166.81	96.25
东吴增鑫宝货币 B	533	18,211,015.29	9,669,586,560.42	99.62	36,884,590.37	0.38
东吴增鑫宝货币 C	17,630	6,711.95	11,608,341.68	9.81	106,723,377.81	90.19
东吴增鑫宝货币 D	11,782	55,774.80	0.00	0.00	657,138,645.99	100.00
合计	372,812	32,156.05	9,737,678,090.42	81.23	2,250,481,780.98	18.77

注：分级基金机构/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（即期末基金份额总额）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	信托类机构	800,105,773.57	6.67
2	信托类机构	700,000,000.00	5.84
3	其他机构	601,813,694.43	5.02
4	其他机构	401,327,781.94	3.35
5	信托类机构	400,065,654.42	3.34

6	其他机构	300,732,597.89	2.51
7	其他机构	300,010,430.53	2.50
8	信托类机构	250,000,000.00	2.09
9	其他机构	230,000,000.00	1.92
10	保险类机构	215,026,964.92	1.79

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	东吴增鑫宝货币 A	41,193.99	0.0027
	东吴增鑫宝货币 B	10.09	0.0000
	东吴增鑫宝货币 C	16.08	0.0000
	东吴增鑫宝货币 D	113.23	0.0000
	合计	41,333.39	0.0003

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东吴增鑫宝货币 A	0
	东吴增鑫宝货币 B	0
	东吴增鑫宝货币 C	0
	东吴增鑫宝货币 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴增鑫宝货币 A	0~10
	东吴增鑫宝货币 B	0
	东吴增鑫宝货币 C	0
	东吴增鑫宝货币 D	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴增鑫宝货币 A	东吴增鑫宝货币 B	东吴增鑫宝货币 C	东吴增鑫宝货币 D
基金合同生效日 （2016 年 11 月 7 日） 基金份额总额	485,411.20	272,023,000.23	—	—
本报告期期初基金	3,646,172,206.63	7,326,885,578.46	133,605,918.67	193,327,171.71

份额总额				
本报告期基金总申购份额	16,009,805,507.16	66,789,418,804.40	243,783,105.40	1,971,037,929.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,149,759,358.66	64,409,833,232.07	259,057,304.58	1,507,226,454.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	1,506,218,355.13	9,706,471,150.79	118,331,719.49	657,138,645.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人发生以下人事变动：

2026 年 2 月 3 日经东吴基金管理有限公司第五届董事会第三次会议审议通过，聘任葛锋先生为东吴基金管理有限公司常务副总经理，聘任夏志凡先生为东吴基金管理有限公司副总经理，李杰先生不再担任东吴基金管理有限公司副总经理职务。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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、证券公司的选择标准：

- (1) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 在交易、研究业务方面最近二年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为受到行政处罚或者刑事处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (6) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足代理基金进行证券交易的需要；
- (7) 有固定的研究机构和专业的研究人员，有较强的研究能力，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务。

2、证券公司的选择程序：

- (1) 管理人根据以上标准进行评估后甄选证券公司，并开展尽职调查。
- (2) 进入内部评估流程，经投资决策委员会审批后将所选证券公司纳入白名单。
- (3) 对于白名单内符合条件的证券公司，管理人与其签定协议。

3、报告期内证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

4、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%（含）以上的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳腾元基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 1 月 14 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 1 月 16 日
3	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2026 年 1 月 22 日
4	东吴增鑫宝货币市场基金 2025 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2026 年 1 月 22 日
5	东吴增鑫宝货币市场基金 2026 年春节假期前调整大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务限额的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2026 年 2 月 10 日
6	东吴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 2 月 14 日
7	东吴基金管理有限公司关于参加华泰证券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、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2026 年 2 月 25 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售有限公司（广州）有限公司为代销机构、开通	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	2026 年 3 月 27 日

	定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告	息网站	
9	东吴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	公司网站、中证信息网站	2026 年 3 月 31 日
10	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2026 年 3 月 31 日
11	东吴增鑫宝货币市场基金 2025 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2026 年 3 月 31 日
12	东吴基金管理有限公司旗下基金 2026 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	2026 年 4 月 22 日
13	东吴增鑫宝货币市场基金 2026 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2026 年 4 月 22 日
14	东吴增鑫宝货币市场基金 2026 年五一假期前调整大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务限额的公告	上海证券报、公司网站、中证信息网站	2026 年 4 月 28 日
15	2025 年度东吴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站、中证信息网站	2026 年 4 月 30 日
16	东吴基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	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	2026 年 5 月 22 日
17	东吴基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	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	2026 年 6 月 1 日
18	东吴基金管理有限公司关于终止深圳市金海九州基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	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	2026 年 6 月 16 日
19	东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金转换业务补差费用计算方法的公告	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	2026 年 6 月 22 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站	2026 年 6 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20260325-20260325	0.00	1,000,992,137.84	1,000,992,137.84	0.00	0.00
产品特有风险							
1. 巨额赎回风险 (1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大,单一投资者的巨额赎回,可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响; (2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时,在符合基金合同约定情况下,如基金管理人认为有必要,可延期办理本基金的赎回申请,投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险;如果连续 2 个开放日以上(含)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险 单一投资者巨额赎回后,若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的,基金管理人应当向中国证监会提出解决方案,或按基金合同约定,转换运作方式或终止基金合同,其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险; 3. 流动性风险 单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险; 4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小,导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴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中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666/400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日