

东吴货币市场证券投资基金 2025 年年度报告

2025 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	22
§6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	29
§8 投资组合报告	56

8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 债券回购融资情况.....	56
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	57
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.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 期末按实际利率计算账面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.....	58
8.7 “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.....	58
8.8 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.....	59
8.9 投资组合报告附注.....	59
§9 基金份额持有人信息.....	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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情况.....	61
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	61
§10 开放式基金份额变动.....	61
§11 重大事件揭示.....	62
11.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
11.4 基金投资策略的改变.....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	66
11.9 其他重大事件.....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§13 备查文件目录.....	70
13.1 备查文件目录.....	70
13.2 存放地点.....	71
13.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴货币市场证券投资基金				
基金简称	东吴货币				
基金主代码	583001				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2010年5月11日				
基金管理人	东吴基金管理有限公司				
基金托管人	中国农业银行股份有限公司				
报告期末基金份额总额	9,632,184,009.11份				
基金合同存续期	不定期				
下属分级基金的基金简称	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E
下属分级基金的交易代码	583001	583101	020039	023601	023993
报告期末下属分级基金的份额总额	1,827,750,209.29份	6,022,147,520.06份	496,058,743.46份	465,677,193.28份	820,550,343.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理及量化分析，为投资者提供稳定的收益。
投资策略	本基金采取积极的投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测；在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例；在此框架之下，通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券基金，也低于混合型基金与股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	东吴基金管理有限公司		中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘婷婷	任航
	联系电话	021-50509888-8308	010-66060069
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	021-50509666/400-821-0588		95599
传真	021-50509888-8211		010-68121816
注册地址	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室		北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼		北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120		100031
法定代表人	李素明		谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 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 号瑞明大厦 9 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2025 年			2025 年 4 月 17 日(基 金合 同生 效日) - 2025 年 12 月 31 日			2024 年			2023 年 11 月 13 日(基 金合 同生 效日) - 2023 年 12 月 31 日		
	东吴货 币 A	东吴货 币 B	东吴货 币 C	东吴货 币 D	东吴货 币 E	东吴货 币 A	东吴货 币 B	东吴货 币 C	东吴货 币 A	东吴货 币 B	东吴货 币 C	
本期已 实现收 益	19,984,534.94	14,711,017.86	5,352,270.03	422,843.25	2,271,003.59	10,956,738.67	7,595,758.70	1,885,031.71	2,023,953.54	6,876,059.24	101,918.05	
本期利	19,984,534.94	14,711,017.86	5,352,270.03	422,843.25	2,271,003.59	10,956,738.67	7,595,758.70	1,885,031.71	2,023,953.54	6,876,059.24	101,918.05	

润	, 534.94	, 017.86	270.03	3.25	003.59	, 738.67	758.70	031.71	953.54	059.24	8.05
本期净值收益率	1.3773%	1.6016%	1.6016%	0.9355%	0.5829%	1.7268%	1.9706%	1.9707%	1.7786%	2.0232%	0.3038%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末					2024 年末			2023 年末		
期末基金资产净值	1,827,750.20	6,022,147.52	496,058,743.46	465,677,193.28	820,550,343.02	1,046,475.83	293,944,300.28	94,140,308.34	112,174,281.53	735,660,137.20	70,176,316.31
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2025 年末					2024 年末			2023 年末		
累计净值收益率	48.0132%	53.4196%	3.9186%	0.9355%	0.5829%	46.0024%	51.0011%	2.2805%	43.5240%	48.0830%	0.3038%

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	0.3121%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	-0.0282%	0.0011%
过去六个月	0.6328%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	-0.0477%	0.0009%
过去一年	1.3773%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.0273%	0.0011%

					%	%
过去三年	4.9621%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	0.9084%	0.0018%
过去五年	8.7259%	0.0019%	6.7537%	0.0000%	1.9722%	0.0019%
自基金合同生效起 至今	48.0132%	0.0051%	21.3077%	0.0001%	26.7055%	0.0050%

东吴货币 B

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	0.3648%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.0245%	0.0011%
过去六个月	0.7357%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	0.0552%	0.0009%
过去一年	1.6016%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.2516%	0.0011%
过去三年	5.6999%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	1.6462%	0.0018%
过去五年	10.0168%	0.0019%	6.7537%	0.0000%	3.2631%	0.0019%
自基金合同生效起 至今	53.4196%	0.0048%	21.3077%	0.0001%	32.1119%	0.0047%

东吴货币 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	0.3648%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.0245%	0.0011%

过去六个月	0.7357%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	0.0552%	0.0009%
过去一年	1.6016%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.2516%	0.0011%
自基金合同生效起至今	3.9186%	0.0017%	2.8849%	0.0000%	1.0337%	0.0017%

东吴货币 D

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	0.3237%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	-0.0166%	0.0011%
过去六个月	0.6514%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	-0.0291%	0.0009%
自基金合同生效起至今	0.9355%	0.0009%	0.9579%	0.0000%	-0.0224%	0.0009%

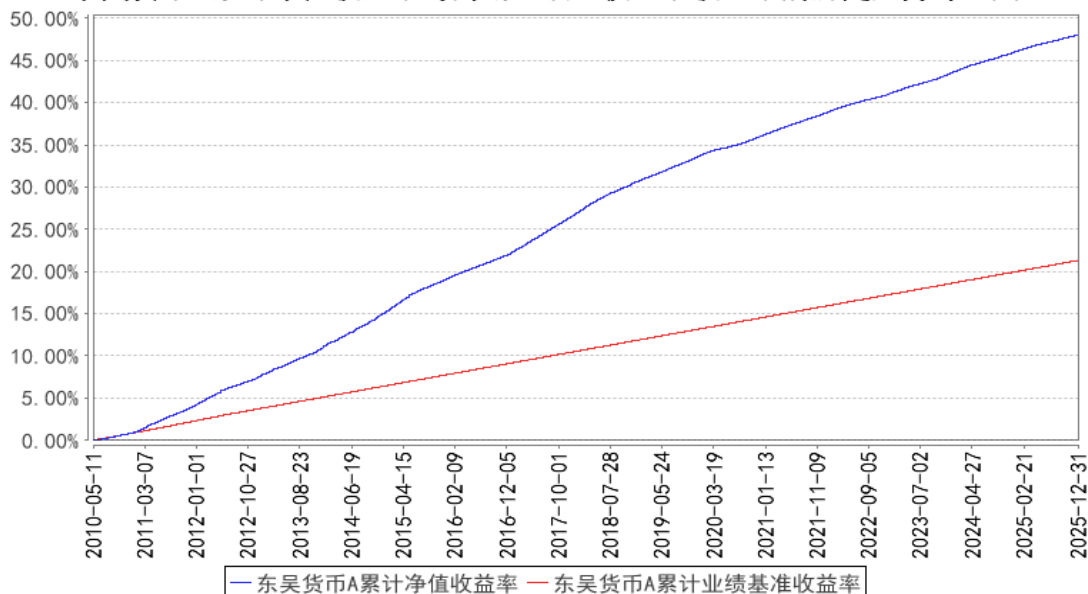
东吴货币 E

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	0.3424%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.0021%	0.0011%
自基金合同生效起至今	0.5829%	0.0016%	0.5733%	0.0000%	0.0096%	0.0016%

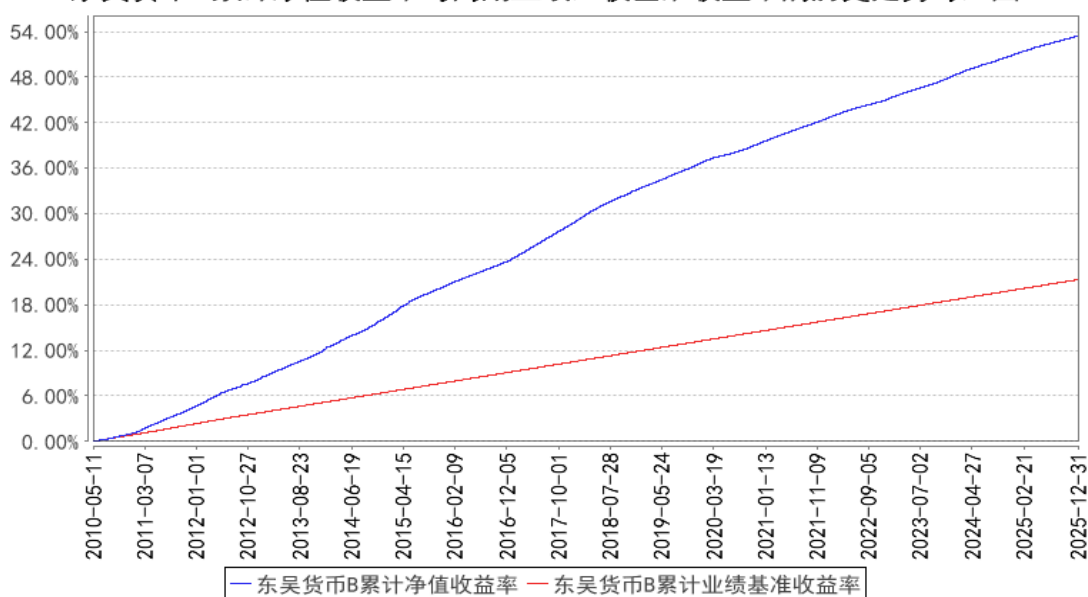
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

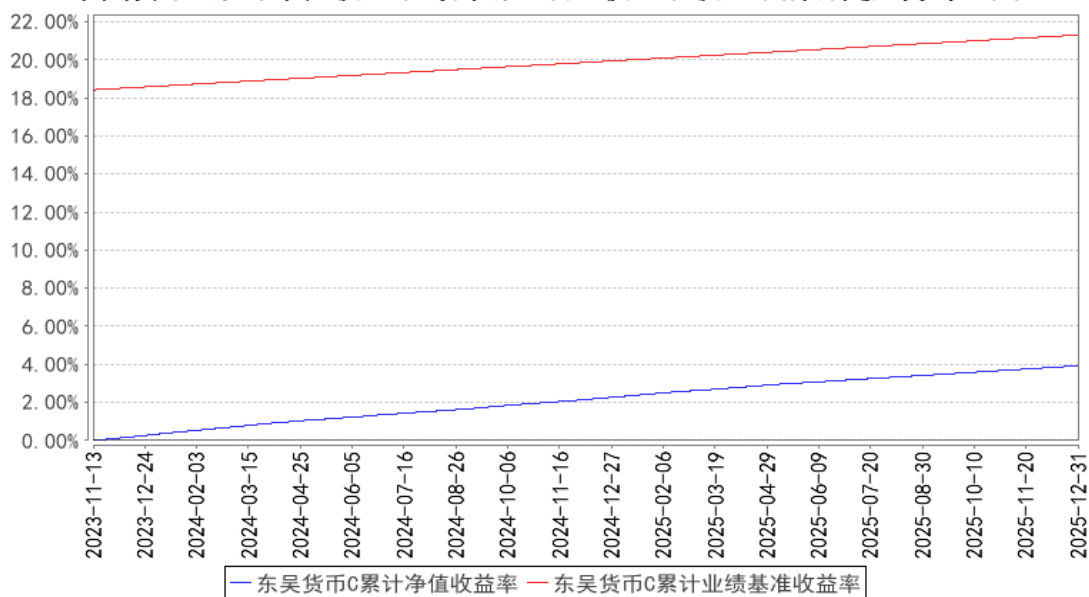
东吴货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



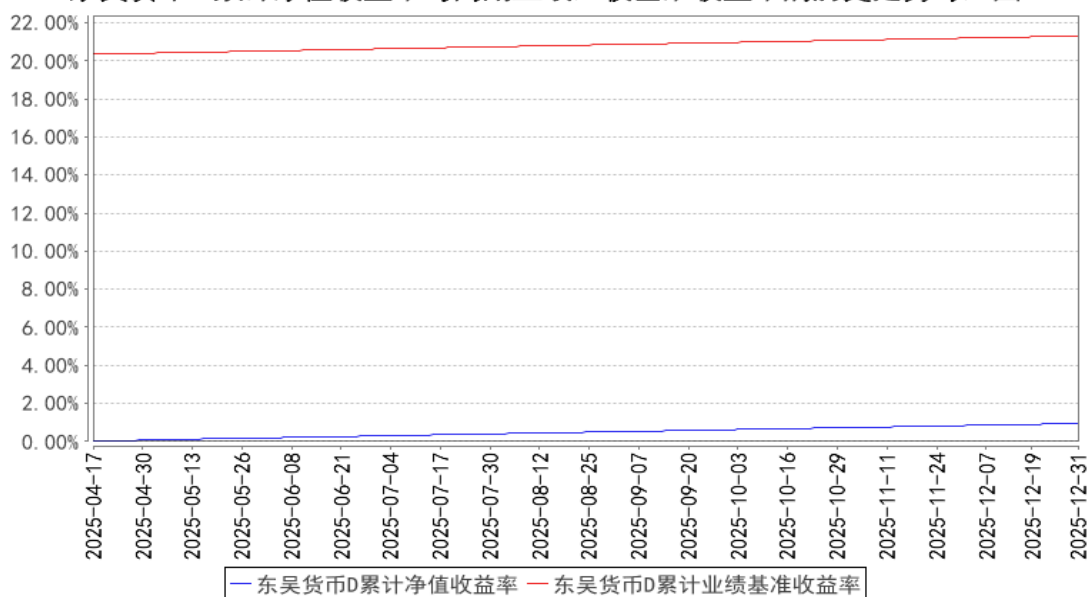
东吴货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



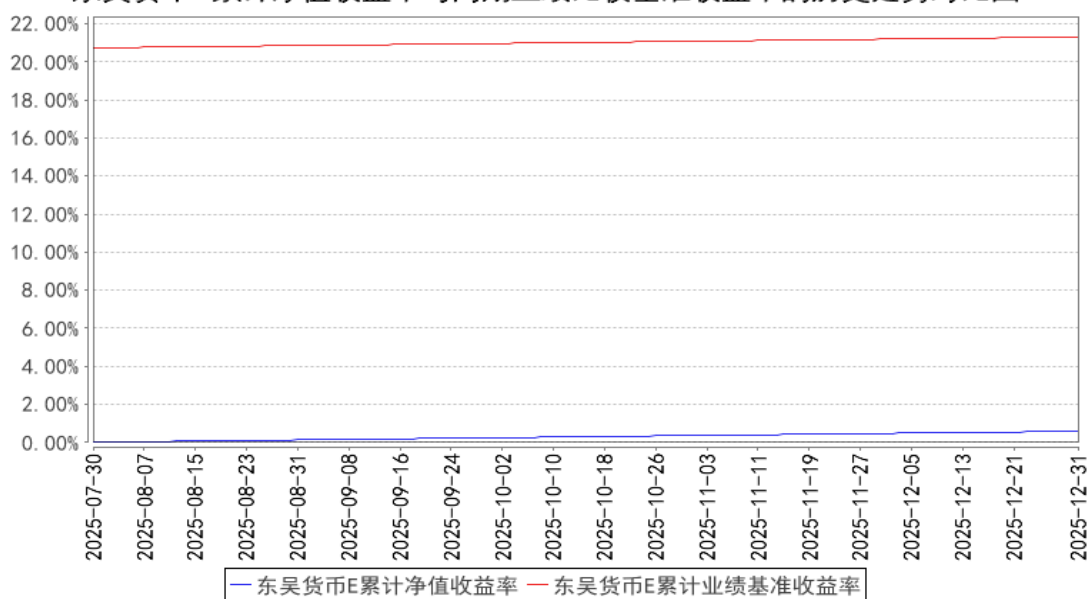
东吴货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



东吴货币E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



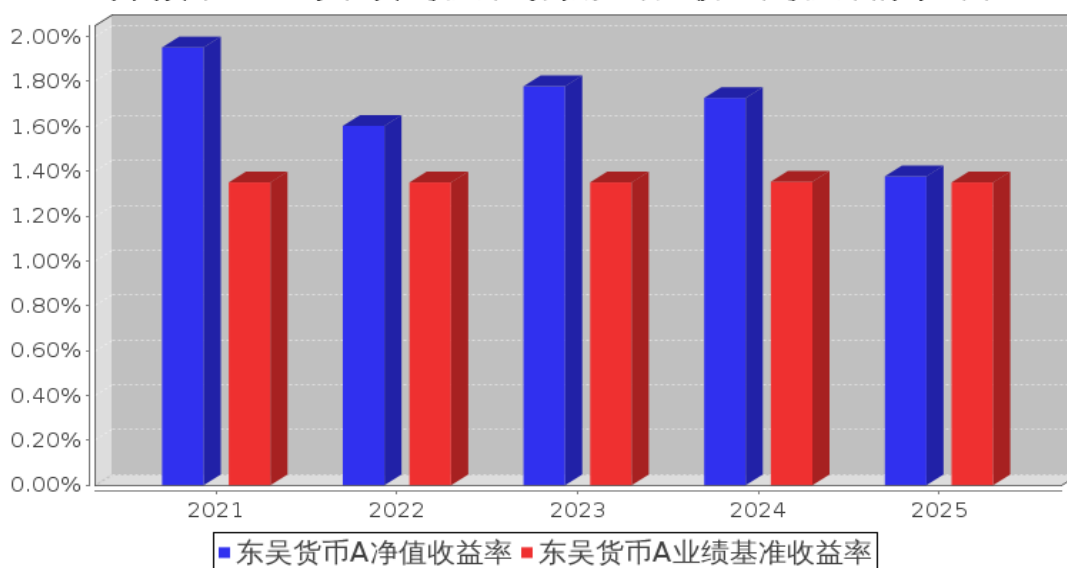
注：1、本基金于 2023 年 11 月 13 日开始分为 A、B、C 三类基金份额。

2、本基金于 2025 年 4 月 17 日起增设 D 类份额。

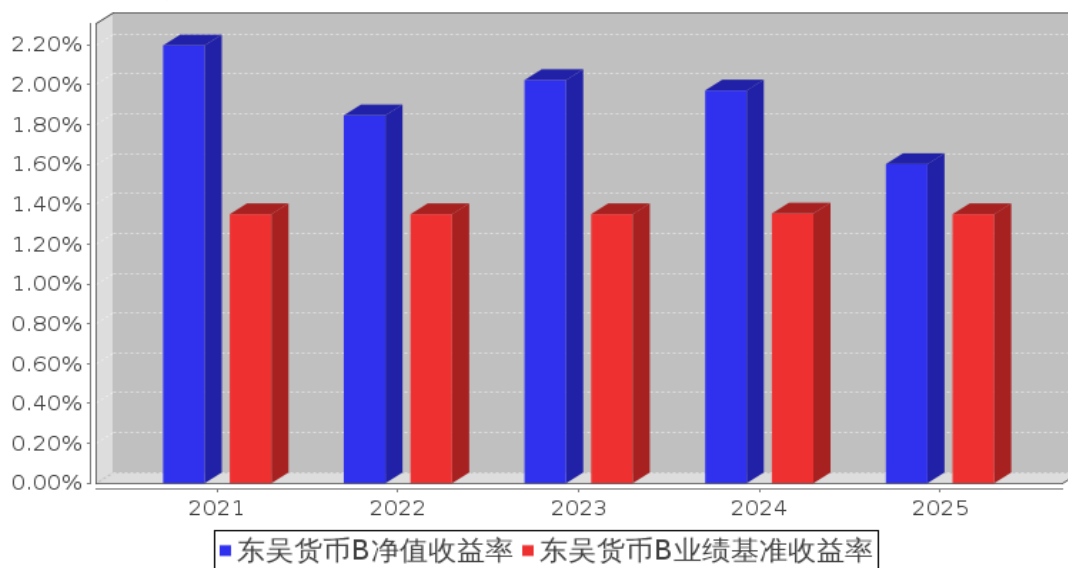
3、本基金于 2025 年 7 月 30 日起增设 E 类份额。

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

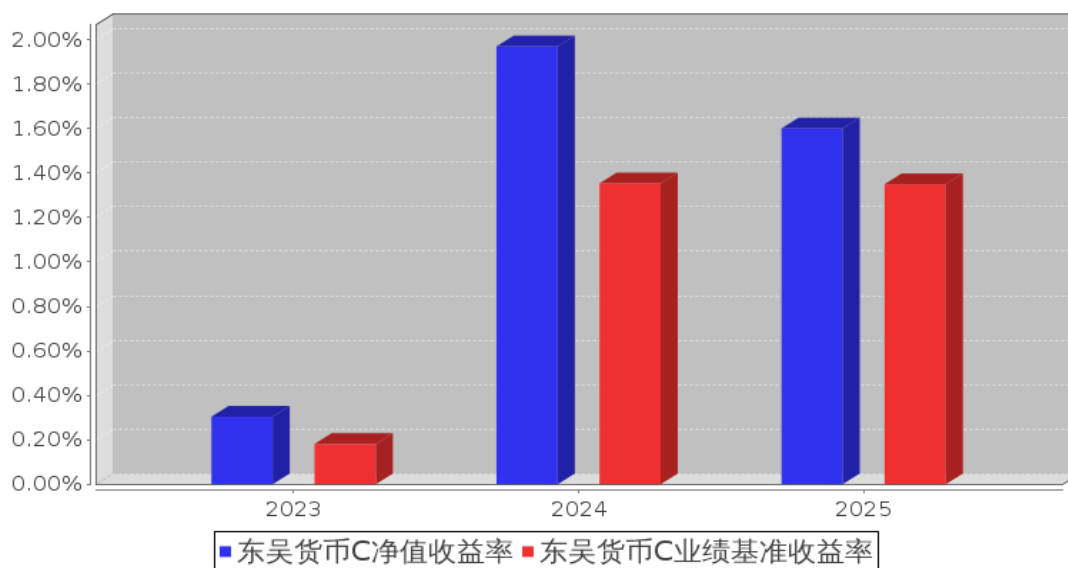
东吴货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



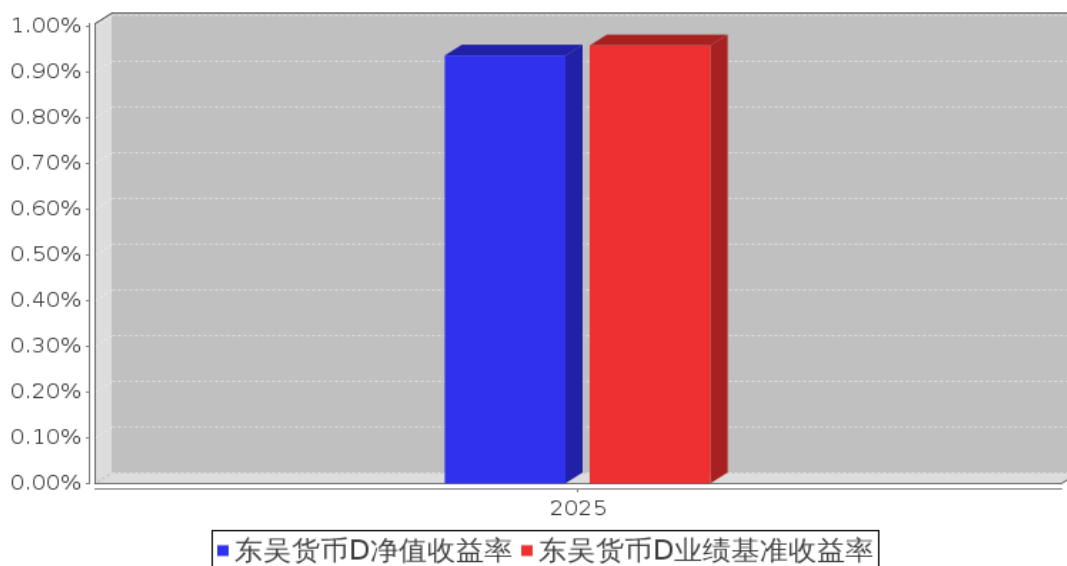
东吴货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



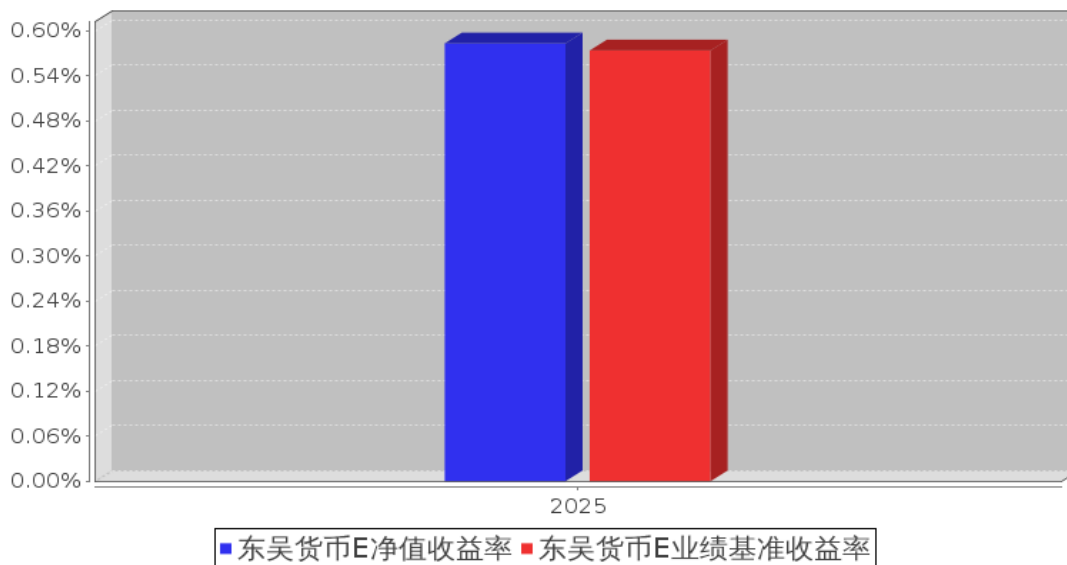
东吴货币C基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东吴货币D基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东吴货币E基金每年净值收益率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

东吴货币 A

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2025 年	19,984,534.94	-	-	19,984,534.94	-
2024 年	10,956,738.67	-	-	10,956,738.67	-
2023 年	2,023,953.54	-	-	2,023,953.54	-
合计	32,965,227.15	-	-	32,965,227.15	-

东吴货币 B

年度	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注
----	---------	--------	------	------	----

	转实收基金	赎回款转出金额	本年变动	分配合计	
2025 年	14,711,017.86	-	-	14,711,017.86	-
2024 年	7,595,758.70	-	-	7,595,758.70	-
2023 年	6,876,059.24	-	-	6,876,059.24	-
合计	29,182,835.80	-	-	29,182,835.80	-

东吴货币 C

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2025 年	5,352,270.03	-	-	5,352,270.03	-
2024 年	1,885,031.71	-	-	1,885,031.71	-
2023 年	101,918.05	-	-	101,918.05	-
合计	7,339,219.79	-	-	7,339,219.79	-

东吴货币 D

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2025 年	422,843.25	-	-	422,843.25	-
合计	422,843.25	-	-	422,843.25	-

东吴货币 E

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2025 年	2,271,003.59	-	-	2,271,003.59	-
合计	2,271,003.59	-	-	2,271,003.59	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵笛	基金经理	2014 年 10 月 30 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。
侯慧娣	固收投资总监兼固定收益总部总经理、基金	2023 年 11 月 6 日	2025 年 4 月 2 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员、基金经理、固定收

	经理				益部副总监，国联安基金管理有限公司基金经理，万家基金管理有限公司基金经理及现金管理部副总监（主持工作），达诚基金管理有限公司总经理助理。2022 年 5 月加入东吴基金管理有限公司，现任固收投资总监兼固定收益总部总经理。2023 年 9 月 28 日至 2025 年 4 月 2 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，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 10 月 31 日至 2025 年 4 月 2 日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 2025 年 4 月 2 日担任东吴月月享 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 2025 年 4 月 2 日担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。
姜靖松	基金经理	2025 年 1 月 24 日	-	6 年	姜靖松先生，中国国籍，上海对外经贸大学金融学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职中国工商银行上海分行客户经理、平安利顺国际货币经纪有限责任公司经纪人、西部利得基金管理有限公司债券交易员、鑫元基金管理有限公司债券交易员、基金经理助理。2024 年 12 月入职东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2025 年 1 月 24 日至今担任东吴货币市场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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善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，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，对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

据统计局数据显示，2025 年 GDP 同比增长 5.0%，CPI 与上年持平，国民经济顶住多重压力保持稳中有进发展态势，高质量发展取得新成效。宏观层面，更加积极的财政政策与适度宽松的货币政策深度协同发力，财政赤字率首次按 4% 安排，发行 1.3 万亿元超长期特别国债支持“两重”“两新”领域，地方政府专项债规模同步扩容；央行实施适度宽松取向，年内降准降息各 1 次，通过 MLF 超量续作、买断式逆回购等工具积极投放资金保持流动性充裕，并在年末重启公开市场国债买卖稳定预期。基本面呈现分化特征，生产供给稳步增长，消费呈 K 形分化，实物消费疲软而服务消费有支撑，投资与工业生产承压，物价低位波动，海外需求韧性与结构分化并存。

债券市场方面，全年债券收益率先上后下、而后又震荡上行，整体呈“N”字型走势。具体来

看，年初，央行宣布阶段性暂停国债买卖操作，债市资金面波动加大，同时权益市场表现较强提振市场风险偏好，10 年国债收益率从低位上行约 30bp 至 1.90% 水平；二季度受中美关税博弈与宽货币政策落地驱动，资金面转松叠加避险情绪，债券收益率快速下行后低位震荡；三季度“反内卷”政策推升风险偏好，股市走强叠加基金费率改革征求意见稿引发机构预防性赎回，债市持续调整；四季度多空交织，央行宣布重启国债买卖短暂推动收益率下行，但买债落地后规模不及预期、基金费率新规悬而未决，叠加理财资金入市缺位，债市弱势震荡收尾。存单方面，年初资金面波动加大，存单收益率震荡上行；而后市场流动性逐步回稳，同时中美关税博弈反复，随后央行宣布降准降息，存单收益率快速回落并保持窄幅震荡走势。

本基金在报告期内，坚持追求稳健的投资策略，以高评级银行存款存单、信用债以及短期逆回购为主，根据资产价格走势和市场资金面波动情况，灵活调整组合剩余期限和各类资产占比，同时争取主动积极把握资产配置和交易机会，在流动性和安全性的前提下努力为投资者获取合理收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期东吴货币 A 的基金份额净值收益率为 1.3773%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；本报告期东吴货币 B 的基金份额净值收益率为 1.6016%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；本报告期东吴货币 C 的基金份额净值收益率为 1.6016%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；本报告期东吴货币 D 的基金份额净值收益率为 0.9355%，同期业绩比较基准收益率为 0.9579%；本报告期东吴货币 E 的基金份额净值收益率为 0.5829%，同期业绩比较基准收益率为 0.5733%。

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 2026 年，预计出口韧性或仍强；政策有望继续加码、内需温和修复；GDP 增速可能前高后低，全年 GDP 目标可能在 4.5%-5% 之间。具体看：1) 消费方面，在以旧换新政策接续、扩就业、促增收等举措下，2026 年消费有望保持温和回升态势；2) 出口方面，中美经贸关系阶段性缓和下，我国对美出口可能趋于稳定，“一带一路”建设和“新三样（电动车、锂电和光伏）”等产品优势或将继续推动我国对新兴市场出口高增，2026 年出口仍有望实现较高增速；3) 投资方面，预计整体固定资产投资增速可能小幅回升，其中：出口韧性、企业盈利回升、设备更新政策有利于制造业投资逐步企稳回升，“反内卷”政策带来行业竞争格局改善后，企业也有望扩张资本开支；地产景气仍处下行通道，但下跌较快时期可能已过去，房地产政策有望进一步放松，或推动地产止跌回稳，2026 年地产投资跌幅可能小幅收窄；基建作为逆周期调节的关键抓手，有望进一步发力托底经济，中央也在计划新一批重大项目，预计基建投资增速可能温和反弹。此外，低基数、消费温和修复和“反内卷”措施下，2026 年物价大概率趋于回升。

宏观政策方面，政策基调或将延续偏积极、偏扩张，推动“内需主导、消费拉动、内生增长”，包括促消费、稳地产、拉基建、强产业。财政方面，2026 年预计可能仍然偏积极、偏扩张，广义赤字规模和 2025 年相当，投向上，或将把“投资于人”摆在更加突出的位置，发力重点可能进一步向民生、消费等领域倾斜。货币方面，2026 年宽松可能还是大方向，结构性货币政策工具也有望降价扩容，配合“五篇大文章”，支持经济结构转型和高质量发展。债券市场大概率延续震荡格局，难现单边行情，股债跷跷板效应、政府债供给节奏及可能发生的海外事件等或将构成核心扰动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人坚持从合法经营、勤勉尽责、维护基金份额持有人利益角度出发，坚守合规底线，将合规风控与监察稽核作为公司稳健经营的基石。本报告期内公司监察稽核工作采取定期/不定期检查和重点稽核等方式，开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促整改，定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作重点内容包括：持续跟踪学习监管法规政策变化和监管新要求，制定落实方案及分工，稳步推进新规落地；找准业务重点环节，通过基础风险点例行检查与重点内容专项排查相结合的方式开展了对公司基金投资、研究、交易、线上直播、投资者适当性、廉洁从业、员工投资申报、反洗钱等方面的专项稽核工作，对稽核中发现问题针对性地提出可操作的优化措施并跟踪落实情况，按照工作程序向公司及董事会报告；持续加强合规文化建设，推动全员主动合规，为业务高质量发展提供可持续的文化支撑。本报告期内未发现基金投资运作存在违法违规从而影响基金份额持有人利益的情形。

本基金管理人将不断深入分析和识别市场变化和潜在风险，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，切实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。

4.8 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、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。本报告期东吴货币 A 级基金应分配收益 19,984,534.94 元，实际分配收益 19,984,534.94 元；东吴货币 B 级基金应分配收益 14,711,017.86 元，实际分配收益 14,711,017.86 元；东吴货币 C 级基金应分配收益 5,352,270.03 元，实际分配收益 5,352,270.03 元；东吴货币 D 级基金应分配收益 422,843.25 元，实际分配收益 422,843.25 元；东吴货币 E 级基金应分配收益 2,271,003.59 元，实际分配收益 2,271,003.59 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东吴基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，东吴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人

利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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	毕马威华振审字第 2602963 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	东吴货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的东吴货币市场证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表、2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，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。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	该基金管理人东吴基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计

	<p>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。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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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）评价该基金管理人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）对该基金管理人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，就可能导致对该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，</p>

	未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (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。我们与该基金管理人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。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蔡晓晓	朱鹏飞
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2026年3月30日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,990,545,746.87	91,350,926.95
结算备付金		101,689.10	-
存出保证金		5,021.92	-
交易性金融资产	7.4.7.2	5,217,371,441.15	903,389,654.33
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,217,371,441.15	903,389,654.33
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,036,928,402.06	435,230,415.55
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,074,114.06	5,345,772.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		10,259,026,415.16	1,435,316,768.94
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
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		624,974,328.28	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		22,001.08	-
应付管理人报酬		699,459.55	181,197.25
应付托管费		233,153.17	60,399.07
应付销售服务费		563,304.98	245,452.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,920.71	9,334.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	323,238.28	259,939.78
负债合计		626,842,406.05	756,323.34
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	9,632,184,009.11	1,434,560,445.60
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		9,632,184,009.11	1,434,560,445.60
负债和净资产总计		10,259,026,415.16	1,435,316,768.94

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 9,632,184,009.11 份，其中东吴货币 A 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,827,750,209.29 份；东吴货币 B 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,022,147,520.06 份；东吴货币 C 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 496,058,743.46 份；东吴货币 D 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 465,677,193.28 份；东吴货币 E 的基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 820,550,343.02 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		55,797,317.87	25,630,991.97
1. 利息收入		17,132,769.73	10,058,834.54
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,795,817.83	3,273,592.42
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		14,336,951.90	6,785,242.12
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,664,548.14	15,570,155.47
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	38,664,548.14	15,570,155.47
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.15	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.16	-	2,001.96
减：二、营业总支出		13,055,648.20	5,193,462.89
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,511,199.73	1,722,978.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,503,733.29	574,326.32
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,840,291.63	1,746,527.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,925,115.63	866,613.19
其中：卖出回购金融资产 支出		2,925,115.63	866,613.19
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		14,830.73	13,992.83
8. 其他费用	7.4.7.18	260,477.19	269,024.78
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		42,741,669.67	20,437,529.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		42,741,669.67	20,437,529.08
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		42,741,669.67	20,437,529.08

7.3 净资产变动表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	1,434,560,445. 60	-	-	1,434,560,445.6 0
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,434,560,445. 60	-	-	1,434,560,445.6 0
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,197,623,563. 51	-	-	8,197,623,563.5 1
(一)、综合收益总额	-	-	42,741,669.67	42,741,669.67
(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)	8,197,623,563. 51	-	-	8,197,623,563.5 1
其中：1. 基金申购款	74,218,140,938 .15	-	-	74,218,140,938. 15
2. 基金赎回款	-66,020,517,37 4.64	-	-	-66,020,517,374 .64
(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)	-	-	-42,741,669.67	-42,741,669.67
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	9,632,184,009. 11	-	-	9,632,184,009.1 1
项目	上年度可比期间			

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	918,010,735.04	-	-	918,010,735.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	918,010,735.04	-	-	918,010,735.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	516,549,710.56	-	-	516,549,710.56
(一)、综合收益总额	-	-	20,437,529.08	20,437,529.08
(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)	516,549,710.56	-	-	516,549,710.56
其中：1. 基金申购款	20,363,350,825.47	-	-	20,363,350,825.47
2. 基金赎回款	-19,846,801,114.91	-	-	-19,846,801,114.91
(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)	-	-	-20,437,529.08	-20,437,529.08
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,434,560,445.60	-	-	1,434,560,445.60

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：

李素明

李素明

骆银

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

东吴货币市场证券投资基金（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”）证监许可[2010]415号《关于同意东吴货币市场证券投资基金募集的批复》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，《东吴货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）于2010年5月11日正式生效，首次设立募集规模为4,433,355,798.66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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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货币市场证券投资基金调低管理费率、托管费率、增加C级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。根据2025年4月16日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴货币市场证券投资基金增加D级基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，2025年4月17日起对本基金增加D类基金份额。根据2025年7月30日发布的《东吴基金管理有限公司关于东吴货币市场证券投资基金增加E级基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，2025年7月30日起对本基金增加E类基金份额。本基金增加D类、E类基金份额后，将形成A级、B级、C级、D级和E级五类基金份额并分别设置对应的基金代码（A级基金份额代码：583001；B级基金份额代码：583101；C级基金份额代码：020039；D级基金份额代码：023601；E级基金份额代码：023993）。

本基金的投资范围为现金，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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、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：同期七天通知存款利率（税后）。

7.4.2 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，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金

会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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 7.4.2 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金

以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

初始确认后，以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（d）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金的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。投资者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，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

4、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；

5、本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若当日净收益为正值，则增加投资者基金份额；若当日净收益为负值，则缩减投资者基金份额；若当日净收益为零，则保持投资者基金份额不变；

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工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》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) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

d) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	2,980,526,730.11	561,500.83
等于：本金	2,979,643,621.77	557,116.53

加：应计利息	883,108.34	4,384.30
减：坏账准备	-	-
定期存款	10,019,016.76	90,789,426.12
等于：本金	10,000,000.00	90,500,000.00
加：应计利息	19,016.76	289,426.12
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	10,019,016.76	90,789,426.12
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,990,545,746.87	91,350,926.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 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	5,217,371,441.15	5,218,540,033.28	1,168,592.13	0.0121
	合计	5,217,371,441.15	5,218,540,033.28	1,168,592.13	0.0121
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,217,371,441.15	5,218,540,033.28	1,168,592.13	0.0121
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 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	903,389,654.33	904,022,923.15	633,268.82	0.0441
	合计	903,389,654.33	904,022,923.15	633,268.82	0.0441
资产支持证券		-	-	-	-
合计		903,389,654.33	904,022,923.15	633,268.82	0.0441

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2025 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	2,036,928,402.06	-
合计	2,036,928,402.06	-
项目	上年度末 2024 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	435,230,415.55	-
合计	435,230,415.55	-

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 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。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	152,038.28	69,139.78
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	152,038.28	69,139.78
应付利息	-	-
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付审计费	40,000.00	60,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
应付汇划费	2,200.00	1,800.00
合计	323,238.28	259,939.78

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东吴货币 A

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,046,475,836.98	1,046,475,836.98
本期申购	24,865,308,154.77	24,865,308,154.77
本期赎回（以“-”号填列）	-24,084,033,782.46	-24,084,033,782.46
本期末	1,827,750,209.29	1,827,750,209.29

东吴货币 B

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	293,944,300.28	293,944,300.28
本期申购	41,727,278,282.55	41,727,278,282.55
本期赎回（以“-”号填列）	-35,999,075,062.77	-35,999,075,062.77
本期末	6,022,147,520.06	6,022,147,520.06

东吴货币 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,140,308.34	94,140,308.34
本期申购	5,443,763,157.13	5,443,763,157.13
本期赎回（以“-”号填列）	-5,041,844,722.01	-5,041,844,722.01
本期末	496,058,743.46	496,058,743.46

东吴货币 D

项目	本期 2025 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	694,338,144.43	694,338,144.43
本期赎回（以“-”号填列）	-228,660,951.15	-228,660,951.15
本期末	465,677,193.28	465,677,193.28

东吴货币 E

项目	本期 2025 年 7 月 30 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,487,453,199.27	1,487,453,199.27
本期赎回（以“-”号填列）	-666,902,856.25	-666,902,856.25
本期末	820,550,343.02	820,550,343.02

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东吴货币 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	19,984,534.94	-	19,984,534.94
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	-19,984,534.94	-	-19,984,534.94
本期末	-	-	-

东吴货币 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	14,711,017.86	-	14,711,017.86
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	-14,711,017.86	-	-14,711,017.86
本期末	-	-	-

东吴货币 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	5,352,270.03	-	5,352,270.03
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	-5,352,270.03	-	-5,352,270.03
本期末	-	-	-

东吴货币 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	422,843.25	-	422,843.25
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	-422,843.25	-	-422,843.25
本期末	-	-	-

东吴货币 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,271,003.59	-	2,271,003.59
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	-2,271,003.59	-	-2,271,003.59
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	1,994,824.09	9,948.73
定期存款利息收入	758,748.14	3,204,090.39
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	76.98	58,959.32
其他	42,168.62	593.98
合计	2,795,817.83	3,273,592.42

7.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	36,767,314.34	14,198,196.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,897,233.80	1,371,959.39
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	38,664,548.14	15,570,155.47

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,451,202,832.58	6,145,727,249.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,432,804,804.97	6,125,346,882.45
减：应计利息总额	16,500,793.81	19,008,407.36
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	1,897,233.80	1,371,959.39

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 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。

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	2,001.96
合计	-	2,001.96

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	40,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划费	63,166.19	51,824.78
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,311.00	1,200.00
合计	260,477.19	269,024.78

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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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
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	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东吴证券	23,006,610.00	27.72	-	-

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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	4,200,000.00	100.00	132,000,000.00	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可比期间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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,511,199.73	1,722,978.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,900,428.53	681,207.14
应支付基金管理人的净管理费	2,610,771.20	1,041,771.59

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,503,733.29	574,326.32

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，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					
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E	合计
东吴基金管理有限公司	2,382.09	11,616.90	2.45	-	8.98	14,010.42
中国农业银行股份有限公司	38,578.78	105.95	-	-	-	38,684.73
东吴证券	357.34	-	-	-	-	357.34
合计	41,318.21	11,722.85	2.45	-	8.98	53,052.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间					
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E	合计
东吴基金管理有限公司	2,660.80	12,442.68	0.78	-	-	15,104.26
中国农业银行股份有限公司	30,895.60	1,811.56	-	-	-	32,707.16
东吴证券	393.53	-	-	-	-	393.53
合计	33,949.93	14,254.24	0.78	-	-	48,204.95

注：自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 8 月 3 日，本基金 A 级基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。根据《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金 A 级基金份额开展销售费率优惠活动的公告》，自 2025 年 8 月 4 日起至 2025 年 11 月 10 日，本基金 A 级基金份额的年销售服务费率由 0.25% 调整为 0.18%。根据《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金 A 级基金份额销售费率优惠活动结束的公告》，自 2025 年 11 月 11 日起，本基金 A 级基金份额的销售服务费率由 0.18%/年恢复为原费率 0.25%/年。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 级基金份额持有人的费率。B 级基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 级升级为 B 级的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 级条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 级基金份额持有人的费率。C 级基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，C 级基金份额不进行基金份额升降级。D 级基金份额的销售服务费年费率为 0.18%，D 级基金份额不进行基金份额升降级。E 级基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，E 级基金份额不进行基金份额升降级。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，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金注册登记机构，由基金注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

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

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			本期 2025 年 4 月 17 日（基金合同 生效日）至 2025 年 12 月 31 日	本期 2025 年 7 月 30 日（基金合同 生效日）至 2025 年 12 月 31 日
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E
基金合同生效日	-	-	-	-	-

(2010 年 5 月 11 日)持有的基金份额					
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			上年度可比期间 -	
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E
基金合同生效日 (2010 年 5 月 11 日)持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	50,128,160.57	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	346,235.52	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖	-	50,474,396.09	-	-	-

出总份额					
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-

注：基金管理人赎回/卖出本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

份额单位：份

东吴货币 B

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
上海新东吴优胜资产管理有限公司	17,376,276.71	0.2885	-	-

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

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国农业银行股份有限公司	2,980,526,730.11	1,994,824.09	561,500.83	9,948.73

注：本基金的银行存款由托管人中国农业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

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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

东吴货币 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
19,984,534.94	-	-	19,984,534.94	-
东吴货币 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
14,711,017.86	-	-	14,711,017.86	-
东吴货币 C				
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
5,352,270.03	-	-	5,352,270.03	-
东吴货币 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
422,843.25	-	-	422,843.25	-
东吴货币 E				
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
2,271,003.59	-	-	2,271,003.59	-

7.4.12 期末（2025 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 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 624,974,328.28 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
112508405	25 中信银 行 CD405	2026 年 1 月 5 日	99.62	2,000,000	199,233,779.94
112515335	25 民生银 行 CD335	2026 年 1 月 5 日	99.25	873,000	86,642,532.67
210203	21 国开 03	2026 年 1 月 5 日	103.04	1,000,000	103,042,927.21
210208	21 国开 08	2026 年 1 月 5 日	101.73	1,400,000	142,419,978.17

240322	24 进出 22	2026 年 1 月 5 日	99.94	700,000	69,957,185.61
250409	25 农发 09	2026 年 1 月 5 日	100.08	600,000	60,046,203.79
合计				6,573,000	661,342,607.39

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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允许投资的金融工具,具体如下: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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及法律法规或中国证监会、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

本基金的投资目标为在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式管理及量化分析,为投资者提供稳定的收益。

本基金结合宏观与微观、定性与定量分析,根据国内外宏观经济形势及经济金融政策趋势等因素的分析,对货币市场基金允许投资的金融工具,从收益率、流动性、风险、久期等角度入手,辅以敏感性分析及金融工程技术,进行综合分析,在严格控制风险的前提下,采取积极主动的投资管理,满足投资者对于高流动性和低风险投资的需求。本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会,制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施;在业务操作层面,一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控,公司具体的风险管理职责由合规风控部负责,组织、协调并与其他各业务部门一道,共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理,并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管,配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

7.4.13.2 信用风险

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

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

- 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；
- 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：
 - i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；
 - ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。
- 3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。
- 4) 本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个交易日内对其予以全部减持。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	731,113,154.33	50,464,463.79
合计	731,113,154.33	50,464,463.79

注：未评级债券包括同业存单、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。

7.4.13.2.3 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,080,840,480.25	752,046,605.50
合计	4,080,840,480.25	752,046,605.50

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	405,417,806.57	100,878,585.04
合计	405,417,806.57	100,878,585.04

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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。

7.4.13.2.6 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。

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。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

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

在本报告期内，本基金未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和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 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	2,990,545,746.87	-	-	-	2,990,545,746.87
结算备付金	101,689.10	-	-	-	101,689.10
存出保证金	5,021.92	-	-	-	5,021.92
交易性金融资产	3,816,753,024.53	1,400,618,416.62	-	-	5,217,371,441.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,036,928,402.06	-	-	-	2,036,928,402.06
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,074,114.06	14,074,114.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,844,333,884.48	1,400,618,416.62	-	14,074,114.06	10,259,026,415.16
负债					
卖出回购金融资产款	624,974,328.28	-	-	-	624,974,328.28
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	22,001.08	22,001.08
应付管理人报酬	-	-	-	699,459.55	699,459.55
应付托管费	-	-	-	233,153.17	233,153.17
应付销售服务费	-	-	-	563,304.98	563,304.98
应交税费	-	-	-	26,920.71	26,920.71
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	323,238.28	323,238.28
负债总计	624,974,328.28	-	-	1,868,077.77	626,842,406.05
利率敏感度缺口	8,219,359,556.20	1,400,618,416.62	-	12,206,036.29	9,632,184,009.11
上年度末 2024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	91,350,926.95	-	-	-	91,350,926.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	873,288,877.88	30,100,776.45	-	-	903,389,654.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	435,230,415.55	-	-	-	435,230,415.55
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,345,772.11	5,345,772.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,399,870,220.38	30,100,776.45	-	5,345,772.11	1,435,316,768.94
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	-	-	-	181,197.25	181,197.25
应付托管费	-	-	-	60,399.07	60,399.07
应付销售服务费	-	-	-	245,452.99	245,452.99
应交税费	-	-	-	9,334.25	9,334.25
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	259,939.78	259,939.78
负债总计	-	-	-	756,323.34	756,323.34
利率敏感度缺口	1,399,870,220.38	30,100,776.45	-	4,589,448.77	1,434,560,445.60

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个	5,994,887.00	692,144.49

	基点		
	基准利率增加 25 个基点	-5,977,590.94	-690,893.62

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

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	5,217,371,441.15	903,389,654.33
第三层次	-	-
合计	5,217,371,441.15	903,389,654.33

7.4.14.2.2 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投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌

日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2024 年 12 月 31 日：无）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2025 年 12 月 31 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。

§ 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	5,217,371,441.15	50.86
	其中：债券	5,217,371,441.15	50.86
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	2,036,928,402.06	19.85
	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	2,990,647,435.97	29.15
4	其他各项资产	14,079,135.98	0.14
5	合计	10,259,026,415.16	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	5.90	
	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	624,974,328.28	6.49
	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。

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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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	52.61	6.49
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.93	-
3	60 天（含）—90 天	14.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	35.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.36	6.49

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	405,417,806.57	4.21
	其中：政策性金融债	405,417,806.57	4.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	731,113,154.33	7.59
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,080,840,480.25	42.37
8	其他	-	-
9	合计	5,217,371,441.15	54.17
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	89,997,715.58	0.93

8.6 期末按实际利率计算账面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)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112508405	25 中信银行 CD405	2,000,000	199,233,779.94	2.07
2	112516168	25 上海银行 CD168	2,000,000	199,232,092.59	2.07
3	112506295	25 交通银行 CD295	2,000,000	198,424,389.77	2.06
4	112517278	25 光大银行 CD278	2,000,000	197,602,238.73	2.05
5	210208	21 国开 08	1,400,000	142,419,978.17	1.48
6	210203	21 国开 03	1,000,000	103,042,927.21	1.07
7	112512208	25 北京银行 CD208	1,000,000	99,693,277.00	1.04
8	112505433	25 建设银行 CD433	1,000,000	99,667,305.90	1.03
9	112508395	25 中信银行 CD395	1,000,000	99,660,965.98	1.03
10	112510257	25 兴业银行 CD257	1,000,000	99,393,675.08	1.03

8.7 “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	0.0463%

报告期内偏离度的最低值	-0.0278%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0169%

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。

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 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 中信银行 CD405（证券代码：112508405）、25 上海银行 CD168（证券代码：112516168）、25 交通银行 CD295（证券代码：112506295）、25 光大银行 CD278（证券代码：112517278）、21 国开 08（证券代码：210208）、21 国开 03（证券代码：210203）、25 北京银行 CD208（证券代码：112512208）、25 建设银行 CD433（证券代码：112505433）、25 中信银行 CD395（证券代码：112508395）、25 兴业银行 CD257（证券代码：112510257）”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。

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	5,021.92
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	14,074,114.06
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	14,079,135.98

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 (%)
东吴货币 A	753,481	2,425.74	17,546,402.01	0.96	1,810,203,807.28	99.04
东吴货币 B	5,589	1,077,500.00	5,670,454,104.89	94.16	351,693,415.17	5.84
东吴货币 C	61,826	8,023.46	0.00	0.00	496,058,743.46	100.00
东吴货币 D	29,547	15,760.56	0.00	0.00	465,677,193.28	100.00
东吴货币 E	68,543	11,971.32	0.00	0.00	820,550,343.02	100.00
合计	918,986	10,481.32	5,688,000,506.90	59.05	3,944,183,502.21	40.95

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）。

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	其他机构	1,160,065,818.87	12.04
2	信托类机构	500,042,927.27	5.19
3	其他机构	500,000,000.00	5.19
4	银行类机构	400,179,116.57	4.15
5	信托类机构	350,015,273.66	3.63
6	信托类机构	350,000,000.00	3.63
7	银行类机构	150,037,772.74	1.56
8	银行类机构	100,139,228.11	1.04
9	券商类机构	100,135,847.78	1.04

10	银行类机构	100,079,464.35	1.04
----	-------	----------------	------

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	东吴货币 A	24,866.09	0.0014
	东吴货币 B	-	-
	东吴货币 C	5,030.17	0.0010
	东吴货币 D	-	-
	东吴货币 E	1,015.37	0.0001
	合计	30,911.63	0.0003

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	东吴货币 A	0
	东吴货币 B	0
	东吴货币 C	0
	东吴货币 D	0
	东吴货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴货币 A	0
	东吴货币 B	0
	东吴货币 C	0
	东吴货币 D	0
	东吴货币 E	0
	合计	0

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E
基金合同生效日（2010年5月11日）基金	1,474,241,686.52	2,959,332,679.75	-	-	-

份额总额					
本报告期期初基金份额总额	1,046,475,836.98	293,944,300.28	94,140,308.34	-	-
本报告期基金总申购份额	24,865,308,154.77	41,727,278,282.55	5,443,763,157.13	694,338,144.43	1,487,453,199.27
减：本报告期基金总赎回份额	24,084,033,782.46	35,999,075,062.77	5,041,844,722.01	228,660,951.15	666,902,856.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,827,750,209.29	6,022,147,520.06	496,058,743.46	465,677,193.28	820,550,343.02

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

报告期内本基金管理人发生以下人事变动：

1、2025 年 8 月 7 日经东吴基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议通过，聘任薛臻先生为东吴基金管理有限公司董事长，马震亚先生不再担任公司董事长职务。

2、2025 年 8 月 7 日第三十三次股东会审议通过，聘任宋亚辉先生、叶辉先生为东吴基金管理有限公司独立董事，张婉苏女士、方志刚先生不再担任公司独立董事职务。公司不再设立监事会，监事会现有成员的任期自动终止。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门发生以下人事变动：

1、2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2、2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

3、2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

4、2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

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

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）更换为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内应支付的审计费用为人民币 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 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。

11.6.4 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。

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 (%)	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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：

本报告期本基金退租交易单元 4 个，为德邦证券的 2 个交易单元、山西证券的 2 个交易单元。

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。

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(%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	59,991,420.00	72.28	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	23,006,610.00	27.72	4,200,000.00	100.00	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
申万宏 源西部	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

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	东吴货币市场证券投资基金 2025 年春节假期前调整部分代销大额申购（含定期定额）、大额转换转入业务限额的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 1 月 22 日
2	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2025 年 1 月 22 日
3	东吴货币市场证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 1 月 22 日
4	东吴货币市场证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 1 月 25 日
5	东吴货币市场证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2025 年 1 月 27 日
6	东吴基金管理有限公司关于在浙江同花顺基金销售有限公司“爱基金”平台开通东吴货币市场证券投资基金 C	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 3 月 25 日

	级“T+0 快速赎回业务”的公告		
7	东吴货币市场证券投资基金恢复部分代销机构大额申购业务的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 3 月 26 日
8	东吴基金管理有限公司旗下基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
9	东吴货币市场证券投资基金 2024 年年度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 3 月 31 日
10	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	公司网站、中证信息网站	2025 年 3 月 31 日
11	东吴货币市场证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 3 日
12	东吴基金管理有限公司关于参加浙商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、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 7 日
13	东吴货币市场证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 8 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	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	2025 年 4 月 9 日
15	东吴基金管理有限公司关于东吴货币市场证券投资基金增加 D 级基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 16 日
16	东吴货币市场证券投资基金更新基金合同及托管协议	公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 16 日
17	东吴基金管理有限公司关于东吴货币市场证券投资基金 D 级基金份额新增部分销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 16 日
18	东吴货币市场证券投资基金调整大额申购（含定期定额）、大额转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 17 日
19	东吴货币市场证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 17 日
20	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
21	东吴货币市场证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 22 日

22	东吴货币市场证券投资基金 2025 年五一假期前调整部分代销大额申购（含定期定额）、大额转换转入业务限额的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 25 日
23	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2025 年 4 月 28 日
24	东吴基金管理有限公司关于参加中国邮政储蓄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	2025 年 5 月 12 日
25	东吴基金管理有限公司关于参加腾安基金销售（深圳）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	2025 年 5 月 19 日
26	东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台部分业务服务的公告	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	2025 年 5 月 21 日
27	东吴基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）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	2025 年 5 月 27 日
28	东吴货币市场证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2025 年 6 月 13 日
29	东吴基金管理有限公司旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	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	2025 年 6 月 13 日
30	东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台部分业务服务的提示性公告	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	2025 年 6 月 18 日
31	东吴货币市场证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务限额的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 7 月 14 日
32	东吴货币市场证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 7 月 15 日
33	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025 年 7 月 21 日
34	东吴基金管理有限公司关于东吴货币	中国证券报、公司网站、	2025 年 7 月 30 日

	市场证券投资基金增加 E 级基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中证信息网站	
35	东吴货币市场证券投资基金更新基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2025 年 7 月 30 日
36	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金 A 级基金份额开展销售服务费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 8 月 1 日
37	关于东吴货币市场证券投资基金在中国工商银行股份有限公司暂停 A 级、B 级基金份额申购（含定期定额投资）业务的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 8 月 8 日
38	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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	2025 年 8 月 9 日
39	东吴基金管理有限公司关于董事长变更的公告	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	2025 年 8 月 9 日
40	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025 年 8 月 29 日
41	东吴货币市场证券投资基金 2025 年中期报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 8 月 29 日
42	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增方正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	2025 年 9 月 1 日
43	东吴货币市场证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务限额的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 9 月 5 日
44	东吴货币市场证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务限额的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 9 月 23 日
45	东吴基金管理有限公司关于参加世纪证券有限责任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	2025 年 9 月 23 日
46	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证达通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	2025 年 9 月 23 日

47	东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 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	2025 年 10 月 28 日
48	东吴货币市场证券投资基金 2025 年 第 3 季度报告	公司网站、中证信息网站	2025 年 10 月 28 日
49	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴货币市场证券投资基金 A 级基金份额销售费率优惠活动结束的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 11 月 6 日
50	东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台的公告	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	2025 年 11 月 25 日
51	东吴基金管理有限公司关于终止北京微动利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	2025 年 11 月 28 日
52	东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台的提示性公告	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	2025 年 12 月 23 日
53	东吴货币市场证券投资基金 2026 年元旦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	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2025 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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货币市场证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴货币市场证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴货币市场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、报告期内东吴货币市场证券投资基金在中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

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

2026年3月31日