东吴货币市场证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期	10,176,546,887.43 份

末基金份额总额					
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；在此基础之上，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。				
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				
下属分级基金的	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

基金简称					
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	1,064,593,906.01 份	5,817,612,993.01 份	550,492,567.96 份	1,131,196,230.88 份	1,612,651,189.57 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 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
1.本期已实现收益	3,229,854.04	7,380,385.74	1,808,770.38	2,932,900.51	4,168,184.77
2.本期利润	3,229,854.04	7,380,385.74	1,808,770.38	2,932,900.51	4,168,184.77

3.期末基金资产净值	1,064,593,906.01	5,817,612,993.01	550,492,567.96	1,131,196,230.88	1,612,651,189.57

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	净值收益率①	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	0.2643%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	-0.0760%	0.0007%
过去六个月	0.5422%	0.0008%	0.6769%	0.0000%	-0.1347%	0.0008%
过去一年	1.1497%	0.0010%	1.3501%	0.0000%	-0.2004%	0.0010%
过去三年	4.5340%	0.0017%	4.0504%	0.0000%	0.4836%	0.0017%
过去五年	8.0582%	0.0019%	6.7507%	0.0000%	1.3075%	0.0019%
过去七年	12.3211%	0.0020%	9.4510%	0.0000%	2.8701%	0.0020%
过去十年	22.9577%	0.0027%	13.5005%	0.0000%	9.4572%	0.0027%
自基金合同生效起至今	49.2491%	0.0050%	22.3046%	0.0001%	26.9445%	0.0049%

东吴货币 B

阶段	净值收益率①	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	0.3252%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	-0.0151%	0.0007%
过去六个月	0.6635%	0.0008%	0.6769%	0.0000%	-0.0134%	0.0008%
过去一年	1.3851%	0.0009%	1.3501%	0.0000%	0.0350%	0.0009%
过去三年	5.2690%	0.0017%	4.0504%	0.0000%	1.2186%	0.0017%
过去五年	9.3414%	0.0019%	6.7507%	0.0000%	2.5907%	0.0019%
过去七年	14.2030%	0.0020%	9.4510%	0.0000%	4.7520%	0.0020%
过去十年	25.9208%	0.0027%	13.5005%	0.0000%	12.4203%	0.0027%
自基金合同生效起至今	54.9792%	0.0048%	22.3046%	0.0001%	32.6746%	0.0047%

东吴货币 C

阶段	净值收益率①	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	0.3252%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	-0.0151%	0.0007%
过去六个月	0.6635%	0.0008%	0.6769%	0.0000%	-0.0134%	0.0008%
过去一年	1.3851%	0.0009%	1.3501%	0.0000%	0.0350%	0.0009%
自基金合同生效起至今	4.9750%	0.0016%	3.8914%	0.0000%	1.0836%	0.0016%

东吴货币 D

阶段	净值收益率①	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	0.2822%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	-0.0581%	0.0007%
过去六个月	0.5777%	0.0008%	0.6769%	0.0000%	-0.0992%	0.0008%
过去一年	1.2152%	0.0009%	1.3501%	0.0000%	-0.1349%	0.0009%
自基金合同生效起至今	1.8323%	0.0009%	1.9679%	0.0000%	-0.1356%	0.0009%

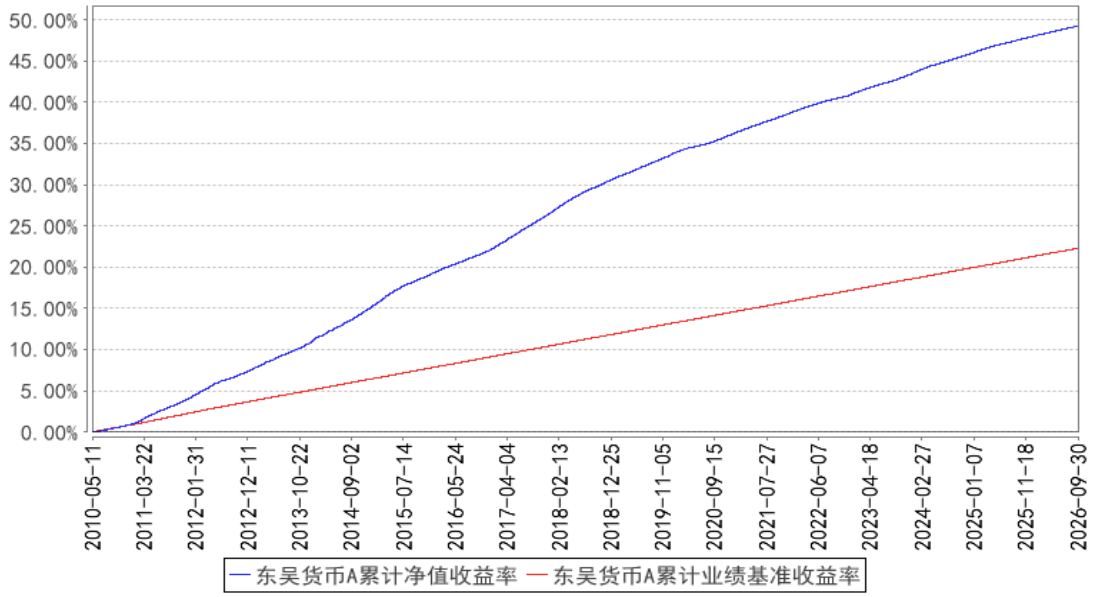
东吴货币 E

阶段	净值收益率①	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	0.3025%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	-0.0378%	0.0007%
过去六个月	0.6182%	0.0008%	0.6769%	0.0000%	-0.0587%	0.0008%
过去一年	1.2944%	0.0009%	1.3501%	0.0000%	-0.0557%	0.0009%
自基金合同生效起至今	1.5372%	0.0012%	1.5832%	0.0000%	-0.0460%	0.0012%

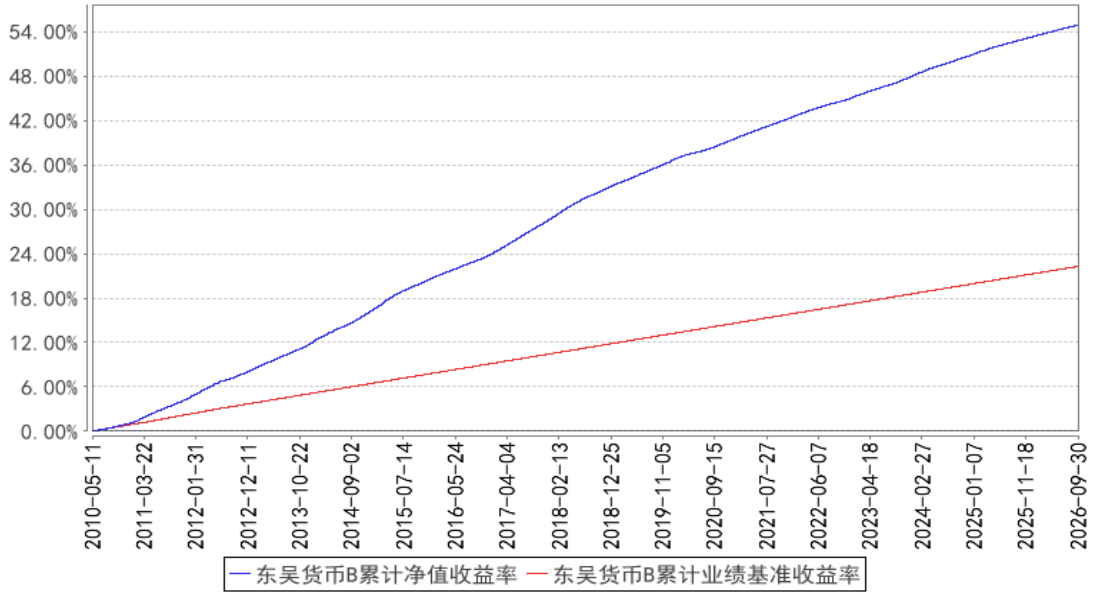
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

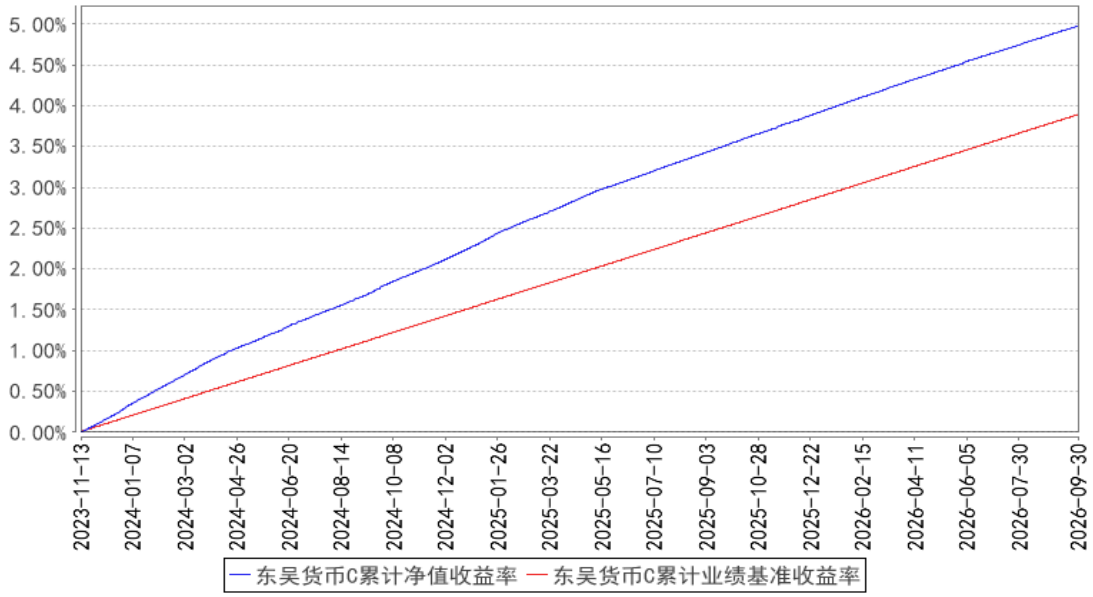
东吴货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



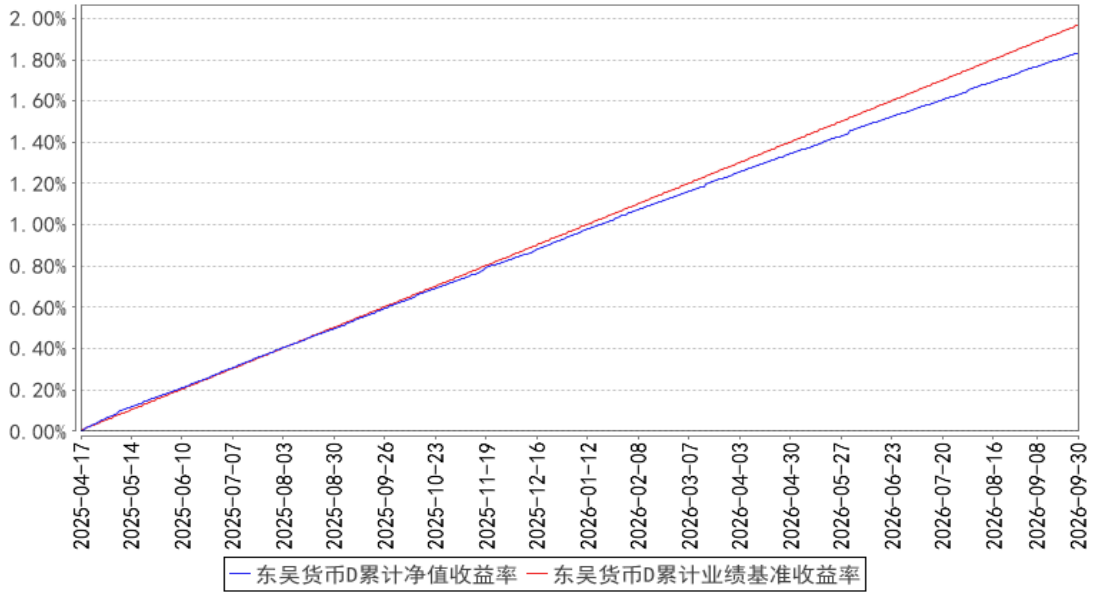
东吴货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

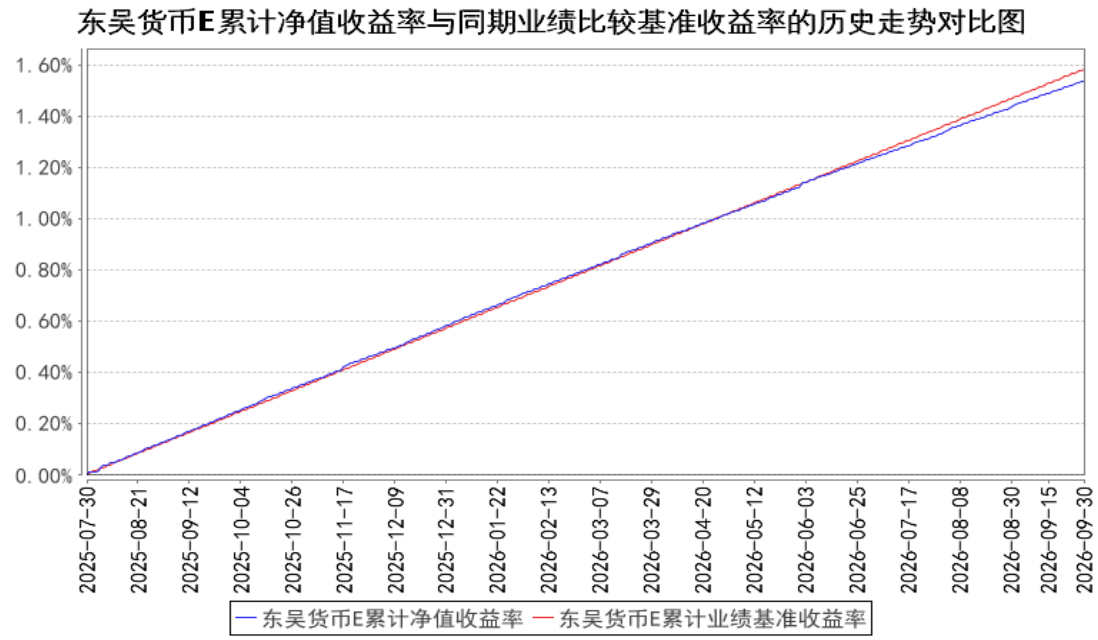


东吴货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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





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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵笛	基金经理	2014 年 10 月 30 日	-	20 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。
姜靖松	基金经理	2025 年 1 月 24 日	-	7 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，2026 年 3 月 27 日至今担任东吴悦秀纯债债券型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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度基本面在出口强劲及低基数的拉动下，经济增速或边际改善，同时 K 型分化延续。国内政府债发行加速叠加新型政策性工具启动，对信贷及社融形成一定支撑，财政发力节奏及实物工作量落地仍是核心。海外全球 AI 链高景气叠加长假前集中出货，出口可能继续加速，同时能源价格上涨推动 PPI 至年内相对高位。

债券市场方面，三季度债券整体震荡走强，收益率曲线进一步平坦化，超长端表现相对更强。Wind 数据显示，30Y 国债由 2.25%水平下行至 2.10%附近，10Y 国债则由 1.74%水平下行至 1.68%附近。核心主线是“资产荒欠配+宽货币预期”，央行在税期、跨月、跨节等关键时点持续增加隔夜逆回购操作、呵护资金面，政策面从 7 月政治局会议到 9 月结构性降息、地产贴息交替催化，供给端政府债发行形成阶段性扰动。信用债收益率同样整体震荡下行，机构配置需求下，以 5Y 为代表的中长期限收益率下行更为明显。

存单方面，央行更加灵活精准开展公开市场操作，三季度资金面保持平稳宽松，税期、跨月和跨季等节点资金面波动继续收窄。据 Wind 数据，1Y 期国股存单在 1.46%-1.49%区间窄幅波动。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、信用债和短期逆回购为主，结合市场走势，灵活调整组合久期和杠杆水平，在流动性和安全性的前提下努力为投资者获取合理收益。

4.5 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 0.2643%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；本报告期东吴货币 B 的基金份额净值收益率为 0.3252%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；本报告期东吴货币 C 的基金份额净值收益率为 0.3252%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；本报告期东吴货币 D 的基金份额净值收益率为 0.2822%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；本报告

期东吴货币 E 的基金份额净值收益率为 0.3025%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	6,842,141,298.91	65.99
	其中：债券	6,842,141,298.91	65.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,123,317,294.65	10.83
	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	2,403,063,933.96	23.18
4	其他资产	173,786.14	0.00
5	合计	10,368,696,313.66	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.30	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	129,991,620.34	1.28
	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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	33.48	1.87
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	6.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.28	-
3	60 天（含）—90 天	21.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	35.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.89	1.87

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	700,159,270.08	6.88
	其中：政策性金融债	261,553,255.30	2.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	502,127,186.60	4.93
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,639,854,842.23	55.42
8	其他	-	-
9	合计	6,842,141,298.91	67.23
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	130,416,040.77	1.28

5.6 报告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

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	112602181	26 工商银行 CD181	3,000,000	296,812,189.52	2.92
2	112610172	26 兴业银行 CD172	2,000,000	199,310,862.83	1.96
3	112608285	26 中信银行 CD285	2,000,000	197,874,633.09	1.94
4	112620113	26 广发银行 CD113	2,000,000	197,832,923.71	1.94
5	112615121	26 民生银行 CD121	1,500,000	149,534,600.65	1.47
6	240322	24 进出 22	1,000,000	101,127,481.17	0.99
7	112517222	25 光大银行 CD222	1,000,000	99,908,753.97	0.98
8	112520302	25 广发银行 CD302	1,000,000	99,717,553.11	0.98
9	112612077	26 北京银行 CD077	1,000,000	99,695,513.62	0.98
10	112697130	26 南京银行 CD160	1,000,000	99,691,513.41	0.98

5.7 “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	0.0405%
报告期内偏离度的最低值	0.0129%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0261%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本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“26 工商银行 CD181（证券代码：112602181）、26 兴业银行 CD172（证券代码：112610172）、26 中信银行 CD285（证券代码：112608285）、26 广发银行 CD113（证券代码：112620113）、26 民生银行 CD121（证券代码：112615121）、24 进出 22（证券代码：240322）、25 光大银行 CD222（证券代码：112517222）、25 广发银行 CD302（证券代码：112520302）、26 北京银行 CD077（证券代码：112612077）”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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,335.35
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	162,450.79
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	173,786.14

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 C	东吴货币 D	东吴货币 E
报告期期初基金	1,281,334,552.06	3,651,326,335.24	535,584,581.75	990,991,244.20	1,083,210,299.76

份额总额					
报告期期间基金总申购份额	5,466,825,032.99	61,456,931,927.40	1,136,770,307.37	624,899,148.56	1,335,120,576.14
报告期期间基金总赎回份额	5,683,565,679.04	59,290,645,269.63	1,121,862,321.16	484,694,161.88	805,679,686.33
报告期期末基金份额总额	1,064,593,906.01	5,817,612,993.01	550,492,567.96	1,131,196,230.88	1,612,651,189.57

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2026-7-8	10,000,000.00	10,000,000.00	-

2	申购	2026-8-6	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3	赎回	2026-8-25	-5,000,000.00	-5,000,000.00	-
4	赎回	2026-9-30	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
5	红利再投	-	237,758.29	-	-
合计			5,237,758.29	5,000,000.00	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“红利再投”项下一并披露。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴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。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：http：//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666/400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日