东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024年3月31日

基金管理人: 东吴基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:二〇二四年四月二十二日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2024 年 4 月 17 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2024年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	016758
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年11月8日
报告期末基金份额总额	101, 209, 261. 67 份
投资目标	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获 得与标的指数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪 误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率 ×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金预期的风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金,高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2024年1月1日 - 2024年3月31日)
1. 本期已实现收益	471, 000. 63
2. 本期利润	446, 916. 14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0046
4. 期末基金资产净值	104, 287, 345. 00
5. 期末基金份额净值	1.0304

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

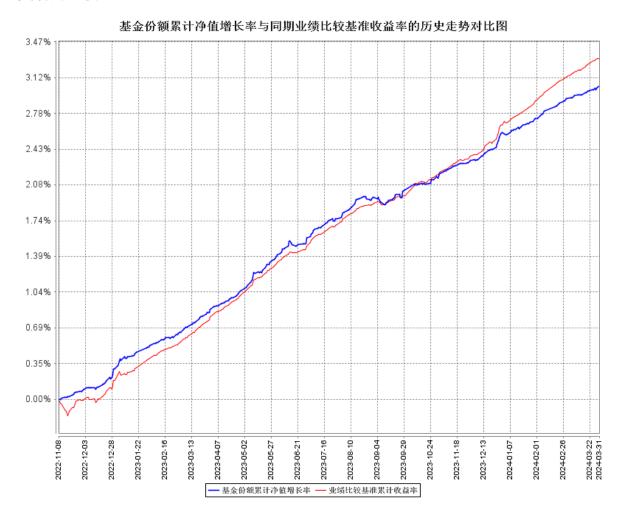
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-(3)	2-4
过去三个月	0. 44%	0.01%	0.63%	0. 01%	-0.19%	0.00%
过去六个月	0.99%	0.01%	1.31%	0.01%	-0.32%	0.00%
过去一年	2. 15%	0.01%	2.49%	0.01%	-0.34%	0.00%
自基金合同 生效起至今	3. 04%	0.01%	3. 31%	0. 01%	-0. 27%	0.00%

注:本基金业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%。

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



注: 本基金业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	任本基金		基金经理期限	证券从业年限	2월 8명
<u> </u>	职务	任职日期	离任日期	业分外业牛 胶	说明
侯慧娣	固收投资 总监收益 定收总 部 总 基 。 基 经 经 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生 生	2023年10月 31日	-	14 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

東京所固定收益分析 朝·高级健 明·高级健 明·高级健 明·高级健 明·高级健 明·高级是 明·公司 基金管理 对家基金管理 对家基金管理 对家基金管理 对家基金管理 是特理 (主持理有限 全经理助理 2022年 1 月 1 月 3 1 日至 1 日至 1 日至 1 日 1 日至 2 2 2 4 1 1 月 3 1 日至 2 2 2 4 1 1 月 3 1 日至 2 2 2 4 1 1 月 3 1 日至 2 2 2 4 1 1 月 3 1 日至 2 2 2 4 1 1 月 3 1 日至 3 4 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 日 2 1 1 1 日 2 1 1 1 日 2 1 1 1 日 2 1 1 1 日 2 1 1 1 1		I				
限公司金经理 图页 电磁流						
员、基金经理、国家国家 安基金经理、国家 安基金经 理、国家 安基金经理、国家 安基金经理、万司基部 经产程 网络常用 经产品 经产品 医二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十						师, 德邦基金管理有
收益經濟理 [] 收益經過 [] 收益經過 [] 收益經過 [] 收益 [限公司高级债券研究
安基金等理,万家基金会理及风金营理和公司基金等理,万家基金会理及风金营理和公司基础副。监生持工作),公司总统理和原。2022年5月加入东吴基金简单有限公司,现在管理内设备总统部。2023年6月28日至今担任场3年9月28日至今担任场3年10月31日至今担任所开放债券整经理。2023年10月31日至今担任东吴帝游差金基金经理。2023年10月31日至今定投资基金基金经理。2023年10月31日至今单组在东吴中证券投资基金基金经理。2023年10月31日至今单组在东吴中证时中全单和AAA指数7天持有绝理,2023年10月31日至今担任东吴中证前中全单和经历,2023年11月6日,30天持有规度债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月月1日至今担任东吴货基金基金经理,2023年11月月1日至今担任东吴货基金基金经理,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2023年11月月1日,2022年11月日,2022年11月月1日,2022年11月月1日,2022年11月日,						员、基金经理、固定
基金经理,万家基金经理及现金管理和限公司基金经理及现金管理和限公司基金经理及现金管理和制度。						收益部副总监, 国联
管理有限公司基础的 监 主持工作》,达显 基金总型 及现金管理和 表面						安基金管理有限公司
理及现金管理部)。						基金经理, 万家基金
理及现金管理部)。						管理有限公司基金经
監(主持工作)、达诚 基金管理有限公司总 经理的理。2022 年 5 月加入东吴基金管政 有限公司,现在收益 总部遗经理,2023 年 9 月 28 日至今担任收益 总部总经理,2023 年 7 月 月 20 日 五字 4 日 月 31 日至今担任东 吴添靖型证券投资基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东 吴添靖型证券投资基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东 吴添靖型证券投资基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东 吴市证 阿业存单 加证券投资基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东 吴市 加证券投资基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东 吳市 加证券投资基金经理,2023 年 10 月 5 日 五字 4 担 任 东 吴市 有 期 版债 债券金经理,2023 年 10 月 5 日 五字 4 担 任 东 吴市 市 场证券投资基金基 理,2023 年 11 月 百 至今担任东 吴市 市 场证券投资基金基 理,2022 年 11 月 五字 4 担 任 东 吴市 计 是 4 是 5 是 5 是 5 是 5 是 5 是 5 是 5 是 5 是 5						
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,现任收益总施兼固定公益年9月28日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。2023年10月31日至今担任东吴添养型证券投资基金经理。2023年10月31日至今担任东吴添养型证券投资基金经理。2023年10月31日至今担任东吴市市场证券型证券投资基金基金经理。2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单和AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有财短债债金经理。2023年11月日至今担任东吴月币第30天持投资基金基金经理。2023年11月日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2023年11月至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。						
经理助理。2022 年 5 月加入东吴基金管理有限公司,现任应检验总部兼固定收益总部总经理,2023 年 9 月 28 日至今担任基金基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴将参型证券投资基金基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴帝和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 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数了天持有期证券投资基金基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数了天持有期证券投资基金基处理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月债债金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月债债金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月债债金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月后债金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月后债金经济基金经理,2023 年 10 月 31 日至今担任东吴月债债金经理。2022 年 11 月 6 年 经济资基金基金经理。2022 年 11 月 6 年 经济资基金从业资格。2017 年 7 月加入						
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日至今担任东吴增鑫金经理,2023年10月31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10月31日至今担任东吴济瑞型工证券投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴中证司业存单 AAA指数7天持有期证专单 AAA指数7天持有期证专为担任东吴月月等3型工券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴月月等3型工券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴贵市市场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴贵市省场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴贵市场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴贵市场证券投资基金基金经理。						
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日至今担任东 吳增鑫室班,2023年 10月31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 10月31日至今担任东 吴冰瑞三个开定期开 放债券型班,2023年 10月31日至今担任东 吴中证同业存单 AAA 指数7天持有期证 大持有期证债 投资基金基金经理,2023年 10月31日至 2023年10月31日至 今担任东吴内野国院债债券型 证券投资基金基金经理,2023年 10月31日至 今担任东吴内市市场证券投资基金基金经理,2023年 10月31日至 今担任东吴内市市场证券投资基金基金经理,2023年 11月6日至今担任东吴人货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国院 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						
投资总监兼固定收益总部总经理,2023年9月28日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴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,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单AAA指数77共有期延费使了基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2022年11月8日年末,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						
总部总经理,2023年9月28日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴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,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单AAA指数7天持有期证费投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。						,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,
9月28日至今担任东 吴增鑫宝货币市场基 金基金经理,2023年 10月31日至今担任东 吴添利三个月定期开 放债券型证券投资基 金基金经理,2023年 10月31日至今担任东 吴添瑞三个月定期资 金基金经理,2023年 10月31日至今担任东 吴中证同业存单 AAA 指数7天持有期证券 投资基金基金经理,2023年10月31日至 今担任东吴月月享30 天持有期短债债券型 证券投资基金基金经理,2023年11月6日 至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理,2023年11月6日 至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理,2021年11月8日至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理,2021年11月8日至今担任东吴货币市						
是增鑫宝货币市场基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴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,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月康参型证券投资基金经理,2023年11月高份债券型证券投资基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2023年11月8日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2023年11月8日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2023年11月8日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2021年11月8日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。2021年11月8日第,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						, ,
金基金经理,2023年10月31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10月31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,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴质币市场证券投资基金基金经理。2023年11月6日至今担任东吴质币市场证券投资基金基金经理。						
工明欣 基金经理 2022年11月 8 日 6 年 10月31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11月31日至今担任东吴贵币市场证券投资基金基金经理。2023年11月8日至今担任东吴贵币市场证券投资基金基金经理。2023年11月8日至今担任东吴贵币市场证券投资基金基金经理。2023年11月6日至今担任东吴贵币市场证券投资基金基金经理。2023年11月6日至今担任东吴贵币市场证券投资基金基金经理。						
世界の と と と と と と と と と と と と と と と と と と と						,
放债券型证券投资基金基金经理,2023年10月31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,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入						
 金基金经理,2023年10月31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,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴内月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣 基金经理 2022年11月8日 						
10月31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,2023年 10月31日至今担任东 吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券 投资基金基金经理, 2023年10月31日至 今担任东吴月月享30 天持有期短债债券型 证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理。						
是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日至今担任东吴中证同业存单 AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。						金基金经理,2023年
放债券型证券投资基金基金经理,2023年 10月31日至今担任东 長中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券 投资基金基金经理,2023年10月31日至 今担任东吴月月享30 天持有期短债债券型 证券投资基金基金经理,2023年11月6日 至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入						10月31日至今担任东
 金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理,2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入 						吴添瑞三个月定期开
王明欣 基金经理 2022年11月 8 日 6 年 10月31日至今担任东 吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券 投资基金基金经理,2023年10月31日至 今担任东吴月月享30 天持有期短债债券型 证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市 场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入						放债券型证券投资基
王明欣 基金经理 2022年11月 8日 6年 長中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券 投资基金基金经理, 2023年10月31日至 今担任东吴月月享30 天持有期短债债券型 证券投资基金基金经理, 2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入						金基金经理,2023年
 上明欣 基金经理 基金经理 2023年10月31日至今担任东吴月月享30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入 						10月31日至今担任东
世子						吴中证同业存单 AAA
王明欣 基金经理 基金经理 2023 年 10 月 31 日至 今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023 年 11 月 6 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017 年 7 月加入						指数 7 天持有期证券
王明欣 基金经理 基金经理 2023 年 10 月 31 日至 今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023 年 11 月 6 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017 年 7 月加入						投资基金基金经理,
王明欣 基金经理 2022年11月 8 日 6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						
王明欣 基金经理 基金经理 2022年11月 8 日 6年 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入						
 正券投资基金基金经理,2023年11月6日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入 						
王明欣 基金经理 2022年11月 8日 - 6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						
王明欣 基金经理 基金经理 2022年11月 8日 - 6年 至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理。 王明欣女士,中国国籍,上海社会科学院经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。2017年7月加入						
王明欣 基金经理 基金经理 2022年11月 8日 6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						, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
王明欣 基金经理 2022年11月 8日 - 6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						
王明欣 基金经理 2022年11月 8日 - 6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						
王明欣 基金经理 2022年11月 8日 - 6年 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						
王明欣 基金经理 2022年11月 8日 - 6年 经济学硕士,具备证 券投资基金从业资 格。2017年7月加入						
王明欣 基金经理 8日 6年 券投资基金从业资格。2017年7月加入						
	王明欣	基金经理		_	6年	
			8 日		_	
						格。2017年7月加入
						东吴基金管理有限公

		司,现任基金经理。
		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。

注: 1、此处的任职日期为公司对外公告之日:

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内,本 第 6 页 共 12 页 基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度在资产荒背景下,债市表现相对较强,收益率曲线扁平化。1月资金面平稳,经济数据、金融数据低于预期,经济基本面相对较弱,权益市场下跌,带动债市走强。1月24日央行宣布降准50BP略超市场预期,多重利多共振下,10年期国债1月共下行了12bp至2.43%。春节后资金面边际转松,基本面仍延续较弱格局,同时在资产荒背景下,机构配置需求旺盛,2月20日,央行宣布非对称调降5YLPR25BP,幅度超出预期,后续存款利率降息预期升温,债市继续走强。进入3月季末月,流动性继续延续宽松,资金面波动小于季节性,债市围绕宽货币、特别国债发行、地产等市场传闻震荡,3月经济基本面数据有好转但地产仍较弱,市场仍存在后续降准降息的预期,债市整体仍顺风。但由于当前各期限收益率水平都较低,10年期国债最低下行至2.26%,利差保护较低,市场存在畏高心理,市场波动有所加大。

一季度流动性整体较宽松。2月有前期降准释放万亿资金叠加现金回流,银行体系流动性相对充裕。在央行"均衡投放"贷款指导下,一季度信贷一般,低于季节性。同时政府债发行偏慢,季末广义信贷考核压力较轻,银行向非银融出额度或较为充足,3月资金面波动小于季节性。但在稳汇率和防空转下,回购利率未见大幅下行。在流动性平稳宽松的背景下,存单收益率一路下行,根据万得数据,一年期国股存单从1月的2.45%下行至3月底的2.23%。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0304 元;本报告期基金份额净值增长率为 0.44%,业绩比较基准收益率为 0.63%。

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	权益投资	_	_
	其中: 股票	_	_
2	基金投资	_	
3	固定收益投资	126, 487, 794. 89	93. 51
	其中:债券	126, 487, 794. 89	93. 51
	资产支持证券	_	
4	贵金属投资	I	1
5	金融衍生品投资	_	_
6	买入返售金融资产		
	其中: 买断式回购的买入返售		
	金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	390, 144. 88	0. 29
8	其他资产	8, 388, 105. 00	6. 20
9	合计	135, 266, 044. 77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7, 093, 493. 15	6. 80
2	央行票据		_
3	金融债券	1, 237, 817. 05	1. 19
	其中: 政策性金融债	1, 237, 817. 05	1. 19
4	企业债券	_	_
5	企业短期融资券	22, 180, 503. 16	21. 27
6	中期票据		-

7	可转债(可交换债)	_	_
8	同业存单	95, 975, 981. 53	92. 03
9	其他	-	_
10	合计	126, 487, 794. 89	121. 29

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比 例(%)
1	112411052	24 平安银行 CD052	100, 000	9, 788, 297. 32	9. 39
2	112408115	24 中信银行 CD115	100, 000	9, 787, 660. 58	9. 39
2	112409103	24 浦发银行 CD103	100, 000	9, 787, 660. 58	9. 39
2	112417050	24 光大银行 CD050	100, 000	9, 787, 660. 58	9. 39
3	112415125	24 民生银行 CD125	100, 000	9, 782, 275. 18	9. 38
4	112412043	24 北京银行 CD043	100, 000	9, 781, 664. 44	9. 38
5	112495236	24 徽商银行 CD038	90, 000	8, 806, 298. 13	8. 44

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本报告期内,本基金投资的前十名证券除"24平安银行 CD052(证券代码: 112411052)、24 光大银行 CD050(112417050)、24中信银行 CD115(证券代码: 112408115)、24浦发银行 CD103(证券代码: 112409103)、24民生银行 CD125(证券代码: 112415125)、24北京银行 CD043(证券代码: 112412043)"外,其他证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制目前一年内未受到公开谴责、处罚。

经分析,上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响,本基金对证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8, 388, 105. 00
6	其他应收款	-
7	其他	_
8	合计	8, 388, 105. 00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	129, 007, 508. 43
报告期期间基金总申购份额	418, 599, 632. 86
减:报告期期间基金总赎回份额	446, 397, 879. 62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"	-

填列)	
报告期期末基金份额总额	101, 209, 261. 67

- 注: 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务份额;
 - 2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金 情况	
者类别	序号	持有基金份额比例 达到或者超过 20% 的时间区间	期初 份额	申购份额	赎回 份额	持有份额	份额占 比
机构	1	20240104-20240104	19, 557, 033. 25	0.00	19, 557, 033. 25	0.00	0.00%
个人	_	_	_	_	_	_	_

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

- (1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大,单一投资者的巨额赎回,可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响;
- (2)单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时,在符合基金合同约定情况下,如基金管理人认为有必要,可延期办理本基金的赎回申请,投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险;如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
- 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后,若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的,基金管理人应当向中国证监会提出解决方案,或按基金合同约定,转换运作方式或终止基金合同,其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险;

3. 流动性风险

- 单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;
- 4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小,导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件;
- 2、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》;
- 3、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- 5、报告期内东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

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外。

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 2024年4月22日