

# 东吴货币市场证券投资基金 2016 年半年度 报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

## § 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。本半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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 债券回购融资情况.....	34
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	34
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.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	36
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	36
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	37
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38

8.3 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的情况 .....	38
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	42
10.9 其他重大事件 .....	42
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

## § 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	
场内简称	-	
基金主代码	583001	
交易代码	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	6,385,400,871.55 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
下属分级基金的交易代码:	583001	583101
报告期末下属分级基金的份额总额	75,241,442.86 份	6,310,159,428.69 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	徐军	林葛
	联系电话	021-50509888-8308	010-66060069
	电子邮箱	xuj@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	上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海浦东源深路 279 号	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	200135	100031
法定代表人	王炯	周慕冰

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

## § 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

基金级别	东吴货币 A	东吴货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日 )	报告期( 2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	947,864.10	45,157,807.84
本期利润	947,864.10	45,157,807.84
本期净值收益率	1.2277%	1.3488%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	75,241,442.86	6,310,159,428.69
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	20.6651%	22.2753%

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
过去一个月	0.1916%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.0806%	0.0007%
过去三个月	0.5823%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.2457%	0.0008%
过去六个月	1.2277%	0.0013%	0.6732%	0.0000%	0.5545%	0.0013%
过去一年	2.6477%	0.0028%	1.3537%	0.0000%	1.2940%	0.0028%
过去三年	10.4721%	0.0081%	4.0537%	0.0000%	6.4184%	0.0081%
自基金合同 生效起至今	20.6651%	0.0071%	8.4698%	0.0002%	12.1953%	0.0069%

东吴货币 B

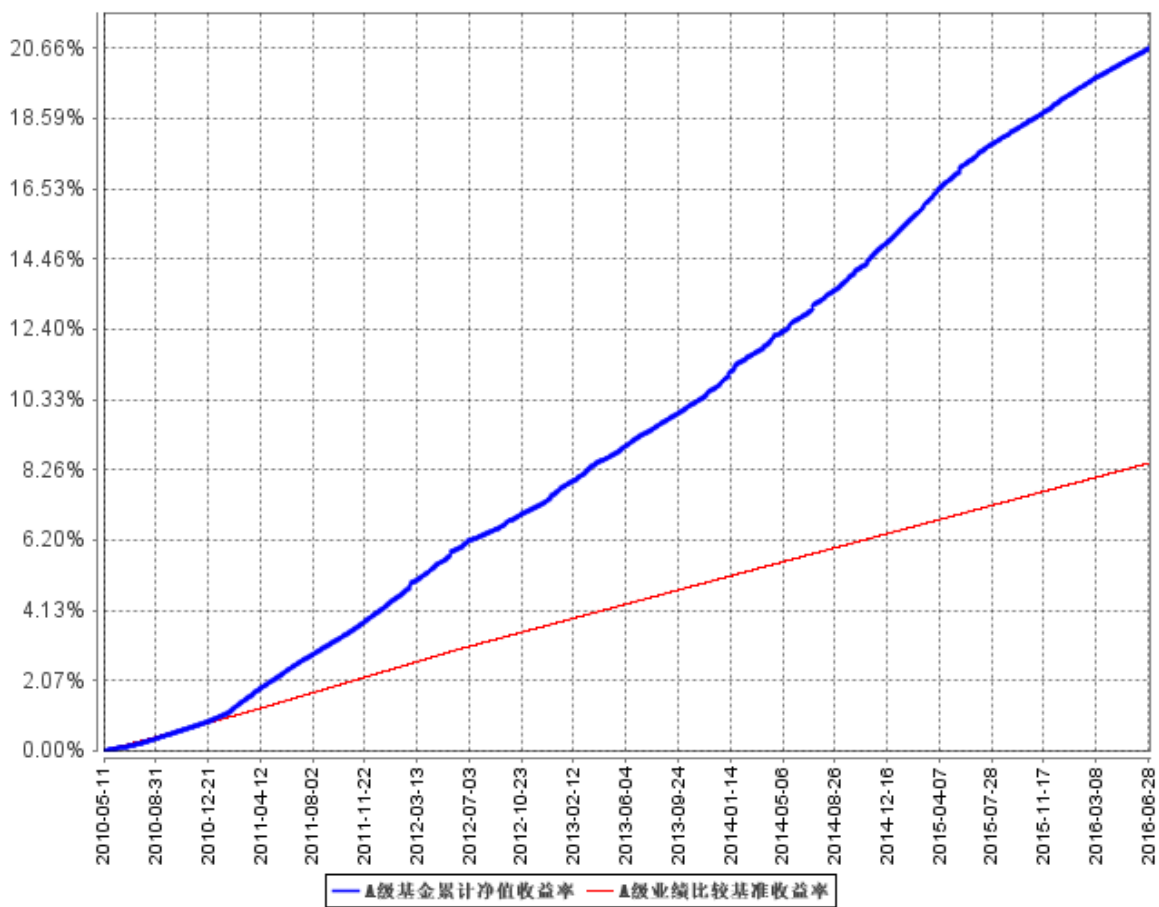
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2114%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.1004%	0.0007%
过去三个月	0.6424%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3058%	0.0008%
过去六个月	1.3488%	0.0013%	0.6732%	0.0000%	0.6756%	0.0013%
过去一年	2.8950%	0.0028%	1.3537%	0.0000%	1.5413%	0.0028%
过去三年	11.1033%	0.0074%	4.0537%	0.0000%	7.0496%	0.0074%
自基金合同 生效起至今	22.2753%	0.0067%	8.4698%	0.0002%	13.8055%	0.0065%

注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

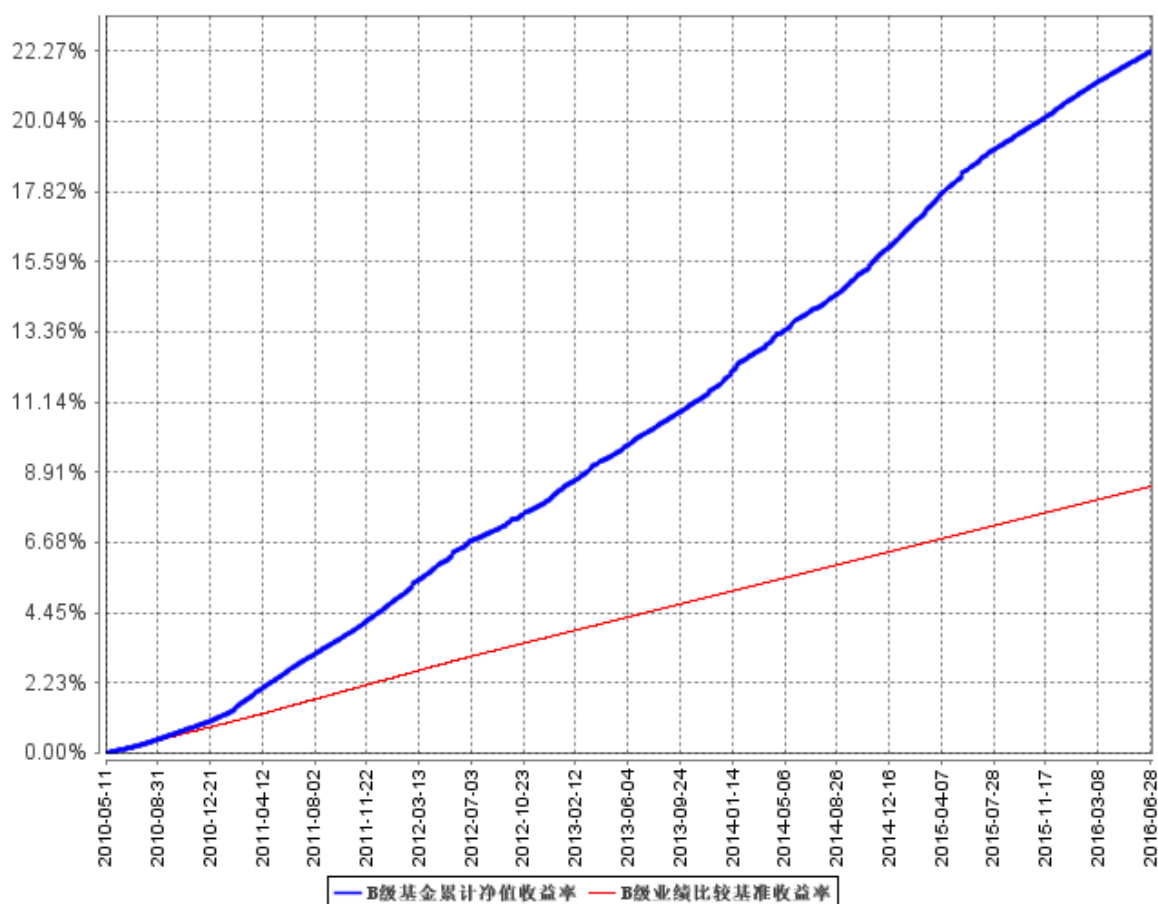
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金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**





B级基金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、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

2、本基金于 2010 年 5 月 11 日成立。

## § 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—上海市浦东新区源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生(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、资产管理和经中国证监会批准的其他业务。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、以德兴业”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、专户业务以及子公司业务协同发展,加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2016 年 6 月 30 日,公司旗下管理着 23 只公募基金,27 只专户资产管理计划,137 只存

续专项资产管理计划（子公司），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。

2016 年，公司在成长股投资的传统优势基础上，引入了量化投资策略，在业内率先成立了绝对收益部，更加强化绝对收益理念。

经过多年积累和布局，公司已形成三大投研“特色”：1. 权益投资坚持自下而上精选优质成长股，把握中国经济转型升级机遇；2. 绝对收益首倡“用权益投资做绝对收益”的理念，利用量化模型进行择时和选股操作，严控回撤、优化收益；3. 固定收益回归稳健本源，兼顾流动性管理，为大类资产配置提供基础性产品。

近年来，公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩，斩获了诸多奖项，比如 2015 年度十大风云基金公司（《大众证券报》）、2014 年度最佳投资风格\*金蝉奖（东吴新经济股票型基金，《华夏理财》杂志）、2014 年度新财富最智慧投资机构（《新财富》杂志）等。

#### 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	本基金基金经理	2014 年 10 月 31 日	-	9 年	上海财经大学工商管理硕士。曾就职于上海文筑建筑咨询公司、上海永一房产咨询有限公司，自 2006 年 9 月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事证券投资研究工作，曾任交易员、研究员、基金经理助理，自 2014 年 10 月 31 日起任东吴货币市场证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期为对外公告之日。

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。

#### 4.2 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，无损害基金持有人利益的行为。

### 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

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，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；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。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。

### 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

2016 年上半年 GDP 同比增长 6.7%，较去年有所放缓。经过一季度的巨量信贷投放后，3 月经济数据略有好转，但之后再度变差，民间投资增速不断缩小，企业投资意愿不足。虽然房产刺激政策后，一二线城市房产价格大幅上涨，但固定资产投资增速表现一般。受极端天气影响，CPI 一度连续三月处于 2.3%的位置，5 月才有所回落，仍高于去年水平，PPI 回升趋势更为显著，由年初的-5.3%升至 6 月的-2.6%。

由于汇率和通胀因素的制约，货币政策保持稳健，仅在 2 月底降准一次，但通过 MLF、PSL 及逆回购等方式为市场提供充裕的流动性支持。上半年的债市呈现先抑后扬的走势，先是受通胀与汇率、信用风险爆发、MPA 考核及美国加息等因素影响，债券收益率逐步攀升，10 年期国开收益率在 4 月底上行至 3.5 附近。随后，各项负面因素均有所好转，资产配置压力再现，债券收益率稳步回落，信用风险事件爆发频率显著降低，信用利差再度缩窄。

报告期内，增加了高等级债券配置，防范信用风险，符合新的货币基金管理规定要求。同时新增了同业存单配置，保持充分的流动性。动态调整资产配置与组合久期，以提升收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东吴货币 A 份额净值收益率为 1.2277%。东吴货币 B 份额净值收益率为 1.3488%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济动能依然偏弱，仍将在 L 型底部徘徊，但在国际普遍萧条的背景下，我国社会平稳，经济表现仍有相对优势。随着人民币即将纳入 SDR，债市看多气氛偏浓。汇率、通胀因素的威胁暂时消除，但仍需保持持续关注。M1 与 M2 剪刀差不断扩大，央行采取相对中性策略，逆回购维持在 2.25% 水平，过于宽松的局面预期难以实现。随着供给侧改革的进一步推进，信用风险也不可忽视。配置压力推动的债市，终须保持适当谨慎。

#### 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、季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，成员由公司副总经理、运营负责人、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

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。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营负责人、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、合规风控业务相关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；公司现没有进行任何定价服务的约定。

#### 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、按月支付”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。本报告期东吴货币 A 级基金

应分配收益 947,864.10 元, 实际分配收益 947,864.10 元; 东吴货币 B 级基金应分配收益 45,157,807.84 元, 实际分配收益 45,157,807.84 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

本基金本报告期内, 未出现连续二十个工作日出现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《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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作, 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

本托管人认为, 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, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《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 托管人对本半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《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半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, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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: 东吴货币市场证券投资基金

报告截止日: 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,600,187,841.69	1,444,654,438.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,422,812,806.49	565,299,681.97
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,422,812,806.49	565,299,681.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,572,054,088.08	1,186,415,326.12
应收证券清算款		14,525.81	-
应收利息	6.4.7.5	17,766,880.40	10,864,079.05
应收股利		-	-
应收申购款		2,211,020.11	3,111,947.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,615,047,162.58	3,210,345,473.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		227,953,946.02	-
应付证券清算款		-	9,000,000.00
应付赎回款		8,000.00	42,233.68
应付管理人报酬		1,149,569.03	549,368.53
应付托管费		348,354.24	166,475.31
应付销售服务费		49,274.31	33,800.28
应付交易费用	6.4.7.7	37,899.94	27,760.95
应交税费		-	-
应付利息		13,356.91	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,890.58	70,557.71
负债合计		229,646,291.03	9,890,196.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	6,385,400,871.55	3,200,455,276.90
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,385,400,871.55	3,200,455,276.90

负债和所有者权益总计		6,615,047,162.58	3,210,345,473.36
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,385,400,871.55 份。其中东吴货币 A 级的基金份额为 75,241,442.86 份，东吴货币 B 级的基金份额为 6,310,159,428.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
<b>一、收入</b>		55,665,984.31	5,574,046.64
1.利息收入		54,485,419.33	5,009,011.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,499,313.14	2,501,935.20
债券利息收入		17,938,400.25	1,773,302.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,047,705.94	733,774.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,180,564.98	565,034.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,180,564.98	565,034.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		9,560,312.37	929,242.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,708,147.04	375,033.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,729,741.49	113,646.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	266,015.16	145,961.17
4. 交易费用	6.4.7.19	-	35.49
5. 利息支出		1,729,636.89	179,866.78
其中：卖出回购金融资产支出		1,729,636.89	179,866.78
6. 其他费用	6.4.7.20	126,771.79	114,698.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		46,105,671.94	4,644,804.45

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,105,671.94	4,644,804.45

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴货币市场证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,200,455,276.90	-	3,200,455,276.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,105,671.94	46,105,671.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,184,945,594.65	-	3,184,945,594.65
其中：1. 基金申购款	15,753,458,682.44	-	15,753,458,682.44
2. 基金赎回款	-12,568,513,087.79	-	-12,568,513,087.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-46,105,671.94	-46,105,671.94
五、期末所有者权益（基金净值）	6,385,400,871.55	-	6,385,400,871.55
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	210,832,263.79	-	210,832,263.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,644,804.45	4,644,804.45
三、本期基金份额交易	91,479,113.04	-	91,479,113.04





的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自2016年5月1日起营改增后，基金买卖股票、债券的差价收入免收增值税。

2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，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。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1

个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	20,187,841.69
定期存款	2,580,000,000.00
其中:存款期限 1-3 个月	2,580,000,000.00
其他存款	-
合计:	2,600,187,841.69

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,422,812,806.49	2,425,055,000.00	2,242,193.51	0.0351%
	合计	2,422,812,806.49	2,425,055,000.00	2,242,193.51	0.0351%

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

### 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 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	180,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	1,392,054,088.08	-
合计	1,572,054,088.08	-

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	4,102.90
应收定期存款利息	2,651,644.75
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	13,275,974.17
应收买入返售证券利息	1,835,158.58
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	17,766,880.40

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-

银行间市场应付交易费用	37,899.94
合计	37,899.94

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付汇划费	2,400.00
预提费用	83,490.58
合计	85,890.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴货币 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	103,739,570.45	103,739,570.45
本期申购	101,975,339.38	101,975,339.38
本期赎回(以“-”号填列)	-130,473,466.97	-130,473,466.97
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	75,241,442.86	75,241,442.86

金额单位：人民币元

东吴货币 B		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,096,715,706.45	3,096,715,706.45
本期申购	15,651,483,343.06	15,651,483,343.06
本期赎回(以“-”号填列)	-12,438,039,620.82	-12,438,039,620.82
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	6,310,159,428.69	6,310,159,428.69
-----	------------------	------------------

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、份额级别调整和转换入份额，基金总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	-	-	-
本期利润	947,864.10	-	947,864.10
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	-947,864.10	-	-947,864.10
本期末	-	-	-

单位：人民币元

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	-	-	-
本期利润	45,157,807.84	-	45,157,807.84
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	-45,157,807.84	-	-45,157,807.84
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	22,293.11
定期存款利息收入	29,475,098.40
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,921.63
其他	-
合计	29,499,313.14

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,365,958,299.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,354,494,843.56
减：应收利息总额	10,282,890.90
买卖债券差价收入	1,180,564.98

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末未进行权证投资。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	61,827.75
合计	61,827.75

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	44,753.80
银行汇划费用	34,101.21
帐户维护费	18,081.52
数字证书服务费	-
合计	126,771.79

**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**

无需要说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无需要说明的日后事项。



## 6.4.9 关联方关系

### 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	基金发起人、基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,708,147.04	375,033.77

其中：支付销售机构的客户维护费	56,568.30	91,699.84
-----------------	-----------	-----------

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

#### 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,729,741.49	113,646.59

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	合计
东吴基金管理有限公司	24,258.06	398.18	24,656.24
中国农业银行股份有限公司	21,532.67	161,016.10	182,548.77
东吴证券股份有限公司	2,443.11	390.41	2,833.52
合计	48,233.84	161,804.69	210,038.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	合计
东吴基金管理有限公司	12,570.72	3,987.16	16,557.88
中国农业银行股份有限公司	47,610.84	269.12	47,879.96
东吴证券股份有限公司	2,707.44	0.00	2,707.44
合计	62,889.00	4,256.28	67,145.28

注：东吴货币 A 级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值 0.25% 的年费率计提；东吴货币 B 级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值 0.01% 的年费率计提；各级基金份额

的销售服务费逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日销售服务费=前一日该级基金份额的基金资产净值 X R / 当年天数；R 为该级基金份额的年销售服务费率。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	东吴货币 A	东吴货币 B
基金合同生效日（2010 年 5 月 11 日）持有的基金份额	-	0.00
期初持有的基金份额	-	0.00
期间申购/买入总份额	-	35,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	3,239.44
减：期间赎回/卖出总份额	-	35,003,239.44
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.0000%

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	东吴货币 A	东吴货币 B
基金合同生效日（2010 年 5 月 11 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

**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**

东吴货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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
东吴证券股份 有限公司	400,000,000.00	6.3390%	-	-

**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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国农业银行股 份有限公司	20,187,841.69	22,293.11	164,865.63	5,638.06

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

金额单位：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
947,864.10	-	-	947,864.10	-

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
45,157,807.84	-	-	45,157,807.84	-

**6.4.12 期末（2016 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/增发证券而流通受限证券。

### 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 2016 年 6 月 30 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证券款余额 227,953,946.02 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
011699692	16 龙源电力 SCP006	2016 年 7 月 1 日	100.08	591,000	59,147,280.00
041667001	16 物美 CP001	2016 年 7 月 1 日	100.19	500,000	50,095,000.00
160209	16 国开 09	2016 年 7 月 1 日	99.83	200,000	19,966,000.00
160401	16 农发 01(总价)	2016 年 7 月 1 日	99.98	1,000,000	99,980,000.00
合计				2,291,000	229,188,280.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。

对于与债券投资的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。报告期末，本基金所持债券为央票、金融债，以及占基金净资产比例较低的企业债和公司债，信用风险程度极低。

本基金的部分银行存款存放于本基金的托管行—中国农业银行股份有限公司，部分定期存款存放在具有托管资格的上海银行股份有限公司及民生银行股份有限公司。本基金认为与银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。

本基金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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

#### **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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日一般不超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本

基金还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，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。除卖出回购金融资产按余额计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	450,054,483.88	2,383,178,315.51	860,000,000.00	-	-	-	3,693,232,799.39
清算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	269,973,538.77	389,976,267.83	669,818,042.19	-	-	-	1,329,767,848.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,572,052,584.93	-	-	-	-	-	1,572,052,584.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,525.81	14,525.81
应收利息	-	-	-	-	-	17,766,880.40	17,766,880.40
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,211,020.11	2,211,020.11
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,292,080,607.58	2,773,154,583.34	1,529,818,042.19	-	-	19,992,426.32	6,615,045,659.43
负债							

卖出回购金融资产款	227,953,946.02						227,953,946.02
应付证券清算款							
应付赎回款						8,000.00	8,000.00
应付管理人报酬						1,149,569.03	1,149,569.03
应付托管费						348,354.24	348,354.24
应付销售服务费						49,274.31	49,274.31
应付交易费用						37,899.94	37,899.94
应交税费							
应付利息						13,356.91	13,356.91
应付利润							
其他负债						85,890.58	85,890.58
负债总计	227,953,946.02					1,692,345.01	229,646,291.03
利率敏感度缺口	2,064,126,661.56	2,773,154,583.34	1,529,818,042.19			-18,300,081.31	6,385,399,368.40
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	274,654,438.52	540,000,000.00	630,000,000.00				1,444,654,438.52
清算备付金							
存出保证金							
交易性金融资产	131,041,577.48	23,996,430.60	410,261,673.89				565,299,681.97
衍生金融资产							
买入返售金融资产	1,186,415,326.12						1,186,415,326.12
应收证券清算款							
应收利息						10,864,079.05	10,864,079.05
应收股利							
应收申购款						3,111,947.70	3,111,947.70
其他资产							
资产总计	1,592,111,342.12	563,996,430.60	1,040,261,673.89			-13,976,026.75	3,210,345,473.36
负债							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款						9,000,000.00	9,000,000.00
应付赎回款						42,233.68	42,233.68
应付管理人报酬						549,368.53	549,368.53
应付托管费						166,475.31	166,475.31
应付销售服务费						33,800.28	33,800.28
应付交易费用						27,760.95	27,760.95
应交税费							
应付利息							
应付利润							
其他负债						70,557.71	70,557.71
负债总计						9,890,196.46	9,890,196.46
利率敏感度缺口	1,592,111,342.12	563,996,430.60	1,040,261,673.89			-4,085,830.29	3,200,455,276.90



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	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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	1,063,419.26	677,682.06
	利率上升 25 个基点	-1,059,536.59	-674,886.54

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

## § 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	2,422,812,806.49	36.63
	其中：债券	2,422,812,806.49	36.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,572,054,088.08	23.76
	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	2,600,187,841.69	39.31
4	其他各项资产	19,992,426.32	0.30
5	合计	6,615,047,162.58	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	4.17	
	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	227,953,946.02	3.57
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期

本基金本报告期无债券正回购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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

### 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	35.90	3.57
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	5.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	31.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	20.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.28	3.57

## 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	299,888,704.37	4.70
	其中：政策性金融债	299,888,704.37	4.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,029,879,144.42	16.13
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,093,044,957.70	17.12
8	其他	-	-
9	合计	2,422,812,806.49	37.94
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111610325	16 兴业 CD325	2,000,000	198,660,424.38	3.11
2	111609230	16 浦发 CD230	2,000,000	198,643,942.60	3.11
3	111609232	16 浦发 CD232	2,000,000	198,627,462.19	3.11
4	111615130	16 民生 CD130	2,000,000	198,528,608.43	3.11
5	150419	15 农发 19	1,000,000	100,049,052.58	1.57
6	011699704	16 厦门航空 SCP002	1,000,000	99,989,186.61	1.57
7	011699706	16 沪电力 SCP003	1,000,000	99,977,661.48	1.57
8	011699692	16 龙源电力 SCP006	1,000,000	99,977,199.69	1.57
9	160401	16 农发 01	1,000,000	99,960,571.66	1.57
10	011699960	16 京能洁能 SCP004	1,000,000	99,943,225.71	1.57

## 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0850%
报告期内偏离度的最低值	0.0165%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0464%

## 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序的所有资产支持证券投资明细

本基金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

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。

报告期内，本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，不存在其摊余成本总计在交易日超过当日基金资产净值 20% 的情况。

### 7.9.2

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	14,525.81
3	应收利息	17,766,880.40
4	应收申购款	2,211,020.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	19,992,426.32

### 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

东吴货币 A	12,984	5,794.94	17,207,717.98	22.87%	58,033,724.88	77.13%
东吴货币 B	66	95,608,476.19	6,149,881,379.20	97.46%	160,278,049.49	2.54%
合计	13,050	489,302.75	6,167,089,097.18	96.58%	218,311,774.37	3.42%

注：本基金机构、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。

### 8.2 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	415,076.28	0.5517%
	东吴货币 B	-	-
	合计	415,076.28	0.0000%

注：本基金经理、高管持有本基金份额为 10 至 50 万份之间。

### 8.3 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的情况

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	10~50
	东吴货币 B	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	东吴货币 A	10~50
	东吴货币 B	-
	合计	10~50

注：本基金经理、高管持有本基金份额为 10 至 50 万份之间。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东吴货币 A	东吴货币 B
基金合同生效日（2010 年 5 月 11 日）基金份额总额	1,474,241,686.52	2,959,332,679.75
本报告期期初基金份额总额	103,739,570.45	3,096,715,706.45
本报告期基金总申购份额	101,975,339.38	15,651,483,343.06
减：本报告期基金总赎回份额	130,473,466.97	12,438,039,620.82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	75,241,442.86	6,310,159,428.69
-------------	---------------	------------------

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、份额级别调整和转换入份额，基金总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

- 1、2016 年 1 月 16 日，吴永敏先生因退休不再担任公司董事长，由范力先生担任公司董事长。
- 2、2016 年 1 月 16 日，任少华先生因工作调动辞去公司总经理职务，由王炯先生担任公司总经理，同时王炯先生辞去其所担任的公司副总经理职务。
- 3、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无相关诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本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

本基金本报告期内聘用天衡会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
华泰联合	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。



租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

## 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期退租 2 个交易单元：华创证券、爱建证券。

### 10.7.2 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
华泰联合	-	-	421,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

### 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管理的基金 2015 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站	2016 年 1 月 4 日
2	东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 1 月 16 日
3	东吴基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 1 月 16 日
4	东吴货币市场证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 20 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站	2016 年 1 月 21 日
6	东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石投资管理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	2016 年 1 月 21 日
7	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海联泰资产管理	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司	2016 年 1 月 21 日

	有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	网站	
8	东吴基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理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	2016年1月21 日
9	东吴货币市场证券投资基金 2016年春节假期前暂停（大额） 申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2016年2月2 日
10	东吴基金管理有限公司关于公司 法定代表人变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年2月3 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗 下部分基金新增中经北证（北 京）资产管理有限公司为代销机 构并推出定期定额业务及转换 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	2016年2月19 日
12	东吴基金管理有限公司关于参 加中经北证（北京）资产管理有 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	2016年2月19 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金新增北京钱景财富投资 管理有限公司为代销机构并推 出定期定额业务及转换业务的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年3月22 日
14	东吴基金管理有限公司关于参 加北京钱景财富投资管理有限 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、深交所（巨潮资讯网）	2016年3月22 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金新增珠海盈米财富管理	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司	2016年3月25 日

	有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	网站、深交所（巨潮资讯网）	
16	东吴基金管理有限公司关于参加珠海盈米财富管理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、深交所（巨潮资讯网）	2016年3月25 日
17	东吴货币市场证券投资基金 2015年年度报告以及摘要	上海证券报、公司网站	2016年3月26 日
18	东吴货币市场证券投资基金 2016年清明节假期前暂停（大 额）申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2016年3月29 日
19	东吴货币市场证券投资基金 2016年第1季度报告	上海证券报、公司网站	2016年4月22 日
20	东吴货币市场证券投资基金 2016年五一节假期前暂停（大 额）申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2016年4月26 日
21	东吴基金管理有限公司关于公 司副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年5月4 日
22	东吴基金管理有限公司关于网 上交易系统招商银行支付渠道 费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年5月24 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗 下部分基金参加珠海盈米财富 管理有限公司转换费率优惠活 动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站	2016年6月1 日
24	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金新增中信期货有限公司 为代销机构并推出定期定额业 务及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016年6月2 日

25	东吴货币市场证券投资基金 2016 年端午节假期前暂停（大 额）申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 3 日
26	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金新增上海利得基金销售 有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 8 日
27	东吴基金管理有限公司关于参 加上海利得基金销售有限公司 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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 8 日
28	东吴基金管理有限公司关于旗 下部分基金开通在上海陆金所 资产管理有限公司定投业务并 参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 13 日
29	东吴基金管理有限公司关于旗 下部分基金延迟参与开通在上 海陆金所资产管理有限公司定 投业务并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 14 日
30	东吴货币市场证券投资基金更 新招募说明书以及摘要	上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 24 日
31	东吴基金管理有限公司关于旗 下部分基金开通在上海陆金所 资产管理有限公司定投业务并 参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、公司 网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 6 月 30 日

## § 11 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指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 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  
2016年8月25日