

东吴货币市场证券投资基金 2012 年年度报告 告

2012 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：二〇一三年三月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。

本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 2013 年 3 月 22 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。

本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 2012 年 1 月 1 日起至 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 债券回购融资情况	40
8.3 基金投资组合平均剩余期限	41
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	42
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	43
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	43
8.8 投资组合报告附注	43

§9 基金份额持有人信息	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
§10 开放式基金份额变动	45
§11 重大事件揭示	45
11.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
11.4 基金投资策略的改变	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	48
11.9 其他重大事件	49
§12 影响投资者决策的其他重要信息	53
§13 备查文件目录	53
13.1 备查文件目录	53
13.2 存放地点	53
13.3 查阅方式	53

§ 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	
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	346,234,676.43 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	211,539,803.92 份	134,694,872.51 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	吕晖	李芳菲
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-63201816
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	任少华	蒋超良

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	天衡会计师事务所有限公司	中国南京市正洪街 18 号东宇大厦 8 楼
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、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	2012 年		2011 年		2010 年 5 月 11 日(基金合同生效 日)-2010 年 12 月 31 日	
	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 A	东吴货币 B	东吴货币 A	东吴货币 B
本期 已实 现收 益	6,388,073.21	6,654,507.30	9,050,226.38	25,569,906.12	1,580,843.95	8,129,969.98
本期 利润	6,388,073.21	6,654,507.30	9,050,226.38	25,569,906.12	1,580,843.95	8,129,969.98
本期 净值 收益 率	3.2164%	3.4644%	3.2401%	3.4882%	0.9252%	1.0831%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2012 年末		2011 年末		2010 年末	
期末 基金 资产 净值	211,539,803.92	134,694,872.51	87,126,126.18	387,281,660.61	49,928,631.71	720,963,156.05
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末 指标	2012 年末		2011 年末		2010 年末	
累计 净值 收益 率	7.5465%	8.2332%	4.1952%	4.6091%	0.9252%	1.0831%

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	0.6958%	0.0072%	0.3403%	0.0000%	0.3555%	0.0072%
过去六个月	1.2927%	0.0071%	0.6811%	0.0000%	0.6116%	0.0071%
过去一年	3.2164%	0.0083%	1.4178%	0.0002%	1.7986%	0.0081%
自基金合同 生效起至今	7.5465%	0.0059%	3.7466%	0.0002%	3.7999%	0.0057%

东吴货币 B

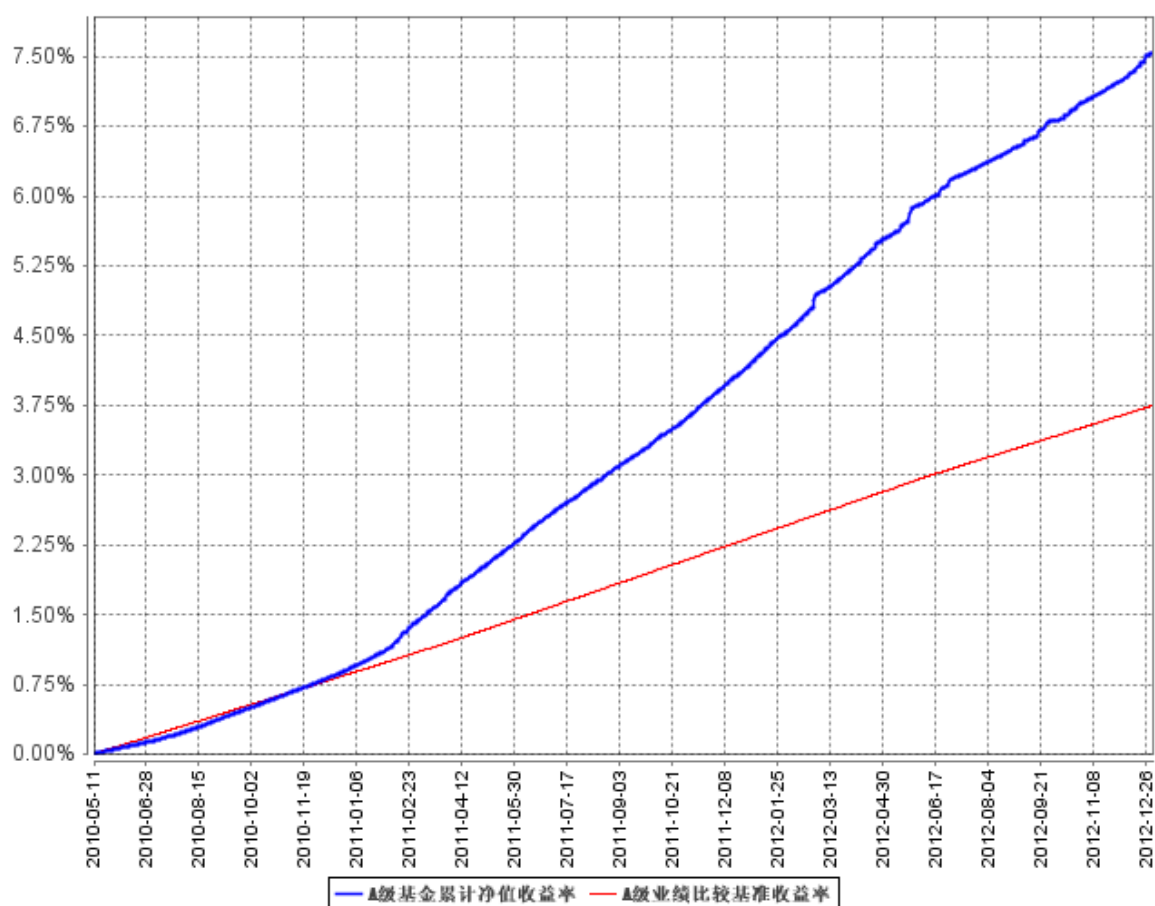
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7572%	0.0072%	0.3403%	0.0000%	0.4169%	0.0072%
过去六个月	1.4152%	0.0071%	0.6811%	0.0000%	0.7341%	0.0071%
过去一年	3.4644%	0.0083%	1.4178%	0.0002%	2.0466%	0.0081%
自基金合同 生效起至今	8.2332%	0.0059%	3.7466%	0.0002%	4.4866%	0.0057%

注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

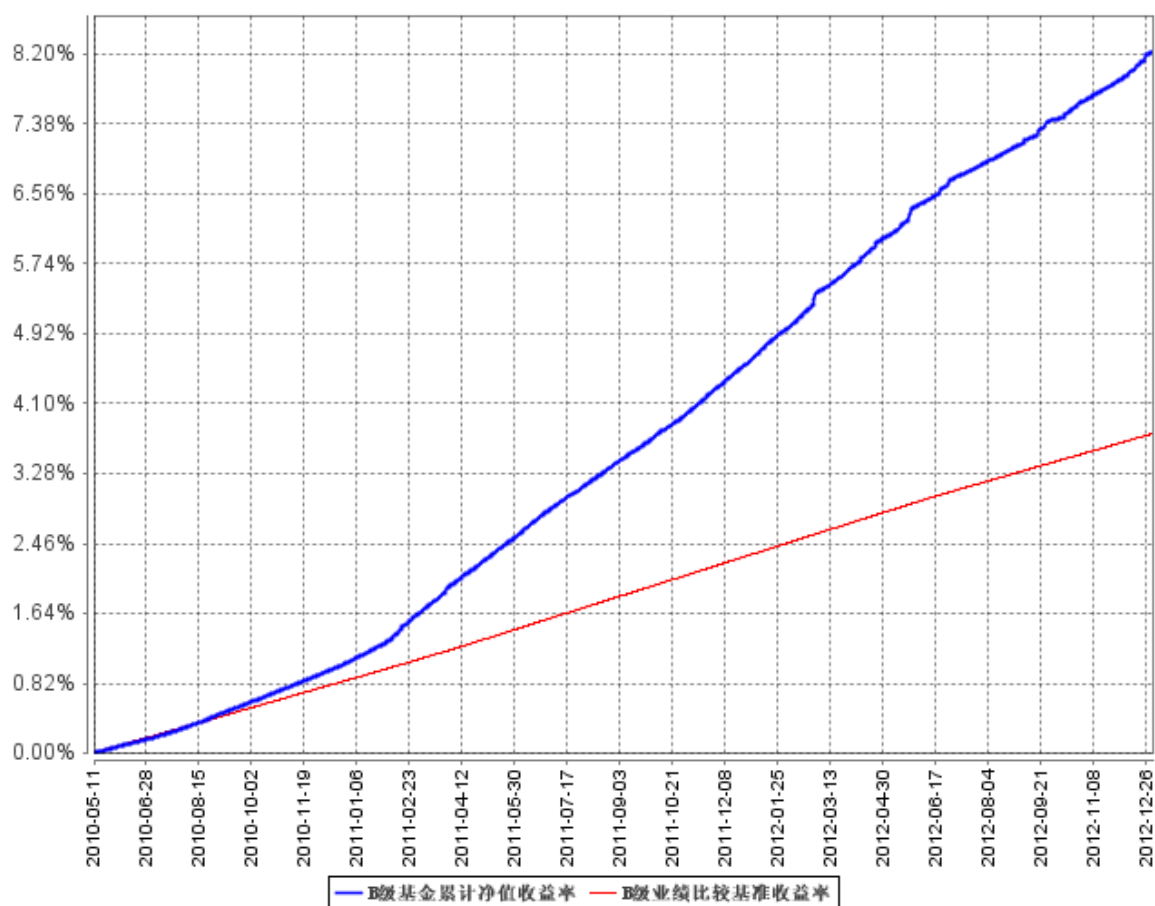
2、本基金收益分配按日结转份额。

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

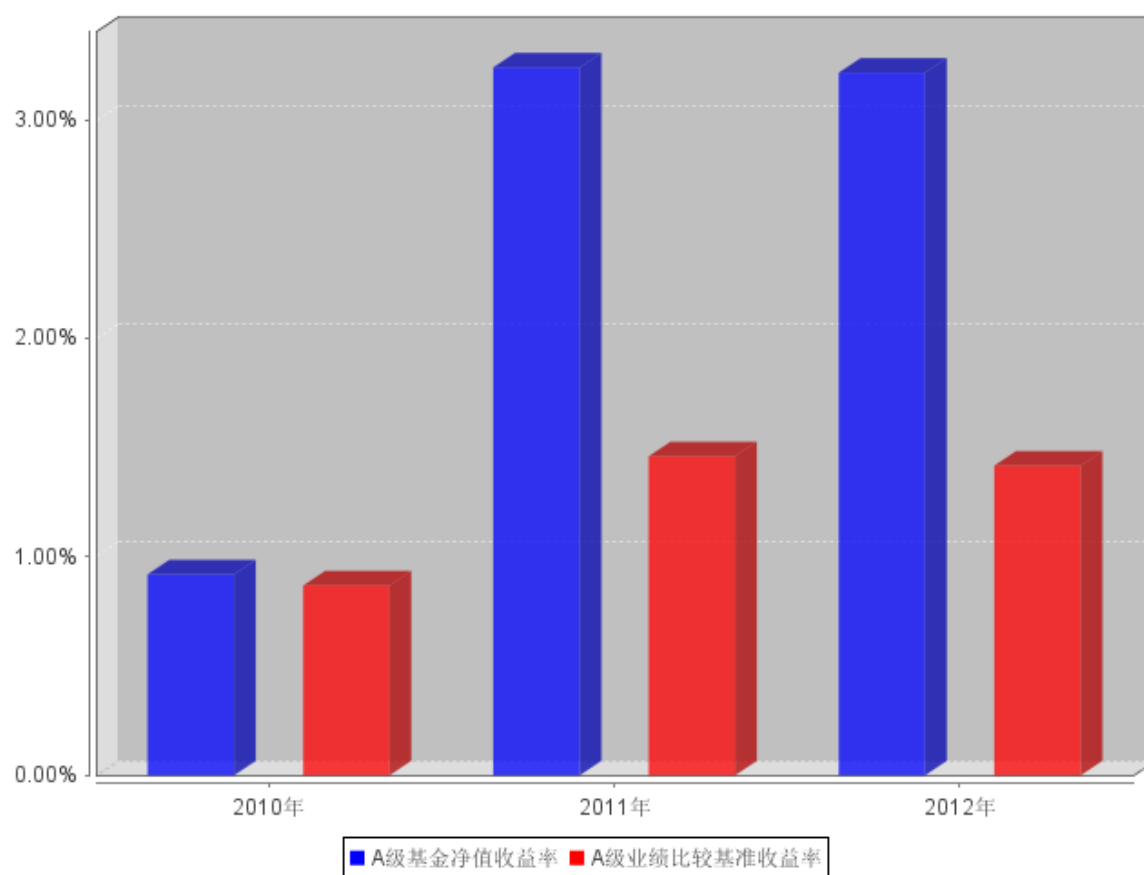


注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

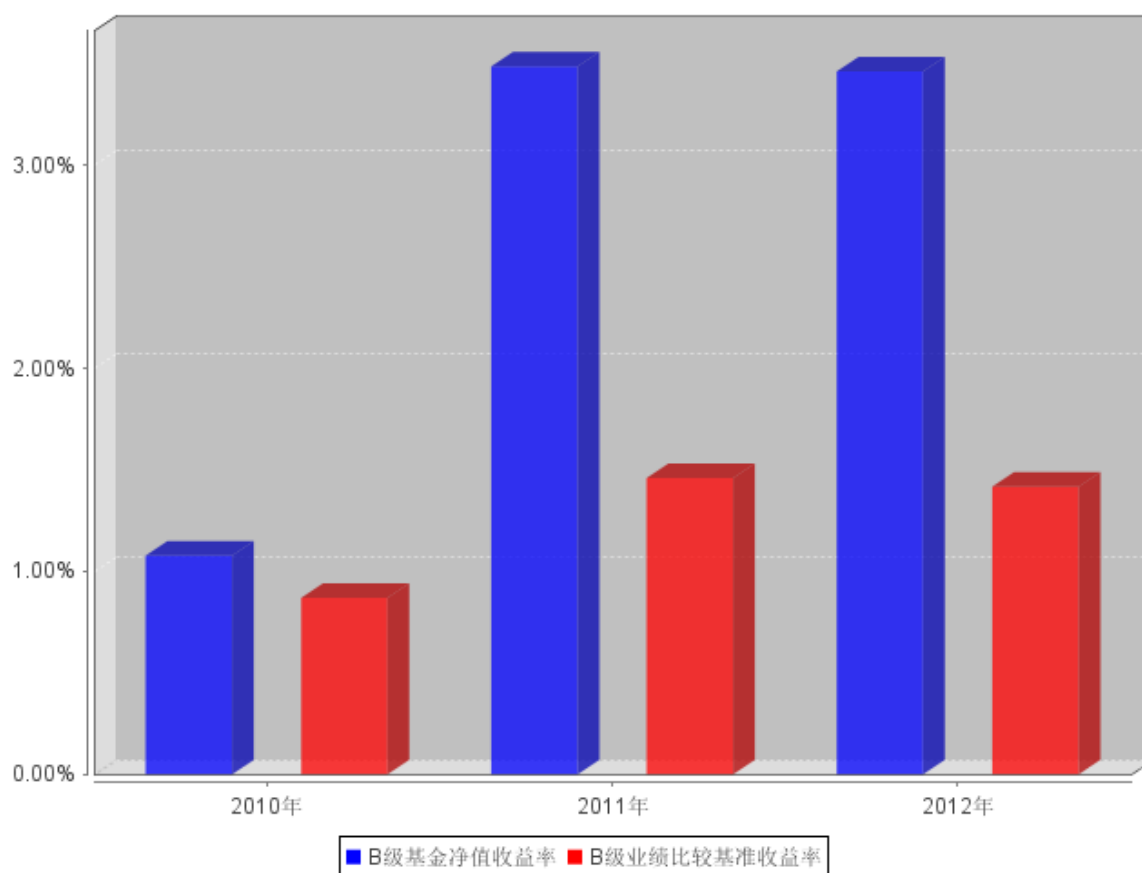
2、本基金于 2010 年 5 月 11 日成立。

3.2.3 自基金合同生效以来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

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2010 年 5 月 11 日成立。

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
2012年	6,388,073.21	-	-	6,388,073.21	
2011年	9,050,226.38	-	-	9,050,226.38	-
2010年	1,580,843.95	-	-	1,580,843.95	-
合计	17,019,143.54	-	-	17,019,143.54	
东吴货币 B					
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
2012年	6,654,507.30	-	-	6,654,507.30	
2011年	25,569,906.12	-	-	25,569,906.12	-
2010年	8,129,969.98	-	-	8,129,969.98	-
合计	40,354,383.40	-	-	40,354,383.40	

§ 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是经中国证监会证监基金字【2003】82 号批准设立的证券投资基金管理公司，于 2004 年 9 月正式成立，注册资本人民币 1 亿元，由东吴证券股份有限公司、上海兰生（集团）有限公司、江阴澄星实业集团有限公司共同发起设立。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有铮、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”的远大理想，创造性地树立公司独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金管理人旗下共管理基金 13 只，其中混合型基金 3 只，分别为东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金；股票型基金 5 只，分别为东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、东吴新经济股票型证券投资基金、东吴新创业股票型证券投资基金、东吴新兴产业精选股票型证券投资基金；指数型基金 2 只，为东吴中证新兴产业指数证券投资基金、东吴深证 100 指数增强型（LOF）证券投资基金；债券型基金 2 只，为东吴优信稳健债券型证券投资基金、东吴增利债券型证券投资基金；货币型基金 1 只，为东吴货币市场证券投资基金。

2012 年，市场的持续下跌，行业的激烈竞争，渠道资源日渐枯竭。整个基金行业面临较大的经营压力，在此背景下，公司依托品牌特色和投资业绩，进一步完善并构建特色产品线，全面推进公司各项业务发展，取得了一系列经营成果和经营管理经验。

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		
韦勇	本基金的基金经理	2010 年 5 月 11 日	-	17 年	香港公开大学 MBA 毕业，曾任贵州证券有限责任公司交易经理、汉唐证券有限责任公司投资经理、恒泰证券股份有限公司投资经理等职；2009 年 6 月加

					入东吴基金管理有限公司，曾任东吴优信稳健债券基金经理；现担任东吴货币基金经理、东吴增利债券基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、韦勇先生为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金合同生效日。

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据证监会 2011 年发布的《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，持续完善了公司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，公司合理的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

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。

4.3.3 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。

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

2012 年上半年以来国债、金融债收益率震荡下行，信用产品收益率更是持续回落。三季度，利率债受制于资金价格偏高、降准预期未兑现，通胀上行拐点确认，美国 QE3 等因素的影响，各期限品种收益率均有不同程度提高，10 年期国债从 3.33% 上升到 3.45%，同时受资金面偏紧的影响，短期债券收益率也出现大幅上行。四季度，随着经济数据持续好转，企业微观效益数据也有好转迹象，再加上供给冲击的边际影响减弱，利率呈现高位震荡态势并创出今年新高，信用产品利差则保持区间震荡，中低等级信用债利差有一定幅度的下行。经济回暖预期增强及风险偏好上升是 12 月份债券市场面临的两个主题。

报告期内，本基金遵循一贯的以流动性为目标的原则，在满足持有人资金安排需求的同时，努力提高基金的收益。

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 3.2164%，东吴货币 B 份额净值收益率为 3.4644%，同期业绩比较基准收益率为 1.4178%。

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 2013 年债券市场，货币政策的主基调是“稳”，明年央行对货币政策有更多的选择空间，而目前到了利率市场化的攻坚阶段，货币政策宜以稳为主，从宏观层面来看，明年通胀温和，经济复苏，加上流动性并不宽松，中长端收益率有小幅回升的压力；从微观层面出发，由于流动性并不宽松，而且《商业银行资本管理办法（试行）》实施，明年银行扩张或有限，稍微有利的是新的表内风险资产权重提高了同业资产和非银行金融机构资产的风险权重，有利于银行资产配置向债券特别是利率债倾斜。未来策略上主要以防守为主，同时密切注意信用品种风险。本基金将把流动性管理和风险控制放在首位，在严格控制风险的前提下，发挥管理人的综合优势，积极稳健地做好配置策略，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在完善公司治理结构、内部控制制度和流程体系的同时，从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益出发，着力增强公司关键业务的风险识别和控制能力；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期与不定期检查、专项检

查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察重点开展的工作包括：

（1）完善公司制度体系。2012 年度，公司全面梳理了各项规章制度，并根据基金监管法律法规的重大变化，进一步修订完善了相关规章制度及业务流程，促进公司规范化经营，有效防范和化解风险。

（2）加强合规监察力度。根据公司年度监察稽核工作计划的安排，以防范风险、查补完善为宗旨，着力于公司各项业务关键控制点的监察，对内部管理制度及业务流程的执行情况开展了多项专项稽核工作，并进行定期与不定期地监察及提示，排查隐患，督促整改。

（3）促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过现场授课、专题培训、律师咨询、合规期刊等多种形式进一步加强了内部合规培训力度，深化基金从业人员风险合规意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，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，成员由公司总裁、投资总监、运营总监、基金会计、金融工程人员、监察稽核人员组成，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；运营总监、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、监察稽核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。

4.8 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 6,388,073.21 元，实际分配收益 6,388,073.21 元；东吴货币 B 级基金应分配收益 6,654,507.30 元，实际分配收益 6,654,507.30 元。

§ 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

在托管东吴货币市场证券投资基金的过程中，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《东吴货币市场证券投资基金基金合同》、《东吴货币市场证券投资基金托管协议》的约定，对东吴货币市场证券投资基金管理人—东吴基金管理有限公司 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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东吴货币市场证券投资基金的投资运作、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东吴货币市场证券投资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	天衡审字（2013）00280 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：
引言段	我们审计了后附的东吴货币市场证券投资基金（以下简称“货币基金”）财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是货币基金的基金管理人东吴基金管理有限公司的责任，这种责任包括：(1) 按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 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而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为，货币基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，公允反映了货币基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和所有者权益（基金净值）变动分配情况。
注册会计师的姓名	谈建忠 魏娜
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所有限公司

会计师事务所的地址	中国·南京
审计报告日期	2013 年 3 月 5 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：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	188,739,974.84	266,662,535.71
结算备付金		750,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	145,491,725.13	184,718,858.63
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		145,491,725.13	184,718,858.63
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,517,231.17	4,560,543.03
应收股利		-	-
应收申购款		8,241,460.61	18,907,125.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		346,740,391.75	474,849,062.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		142,055.43	109,479.28
应付管理人报酬		119,155.84	110,025.26
应付托管费		36,107.84	33,340.95

应付销售服务费		55,428.57	21,299.60
应付交易费用	7.4.7.7	11,128.35	5,492.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	141,839.29	161,638.46
负债合计		505,715.32	441,275.95
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	346,234,676.43	474,407,786.79
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		346,234,676.43	474,407,786.79
负债和所有者权益总计		346,740,391.75	474,849,062.74

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 346,234,676.43 份。其中东吴货币 A 级的基金份额为 211,539,803.92 份，东吴货币 B 级的基金份额为 134,694,872.51 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		15,884,738.81	42,155,840.99
1.利息收入		13,454,601.93	41,167,788.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,702,094.93	15,696,023.45
债券利息收入		4,639,609.38	19,744,118.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,112,897.62	5,727,647.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,430,136.88	504,052.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,430,136.88	504,052.31
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-	484,000.00
减：二、费用		2,842,158.30	7,535,708.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,351,880.47	3,364,103.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	409,660.82	1,019,425.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	566,098.35	760,333.75
4. 交易费用	7.4.7.18	80.00	-
5. 利息支出		313,019.47	2,176,551.34
其中：卖出回购金融资产支出		313,019.47	2,176,551.34
6. 其他费用	7.4.7.19	201,419.19	215,294.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,042,580.51	34,620,132.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,042,580.51	34,620,132.50

7.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	474,407,786.79	-	474,407,786.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,042,580.51	13,042,580.51
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）	-128,173,110.36	-	-128,173,110.36
其中：1. 基金申购款	5,078,225,064.28	-	5,078,225,064.28
2. 基金赎回款	-5,206,398,174.64	-	-5,206,398,174.64
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）	-	-13,042,580.51	-13,042,580.51
五、期末所有者权益（基	346,234,676.43	-	346,234,676.43

金净值)			
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	770,891,787.76	-	770,891,787.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,620,132.50	34,620,132.50
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）	-296,484,000.97	-	-296,484,000.97
其中：1. 基金申购款	9,682,166,425.17	-	9,682,166,425.17
2. 基金赎回款	-9,978,650,426.14	-	-9,978,650,426.14
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）	-	-34,620,132.50	-34,620,132.50
五、期末所有者权益（基金净值）	474,407,786.79	-	474,407,786.79

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：

<u>任少华</u>	<u>徐军</u>	<u>金婕</u>
基金管理公司负责人	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《关于核准东吴货币市场证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，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人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《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《东吴货币市场证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为现金；通知存款；短期融资券；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券回购；1 年以内的（含 1 年）银行定期存款、大额存单；期

限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴货币市场基金基金合同》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。

7.4.3 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况及 2012 年度经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资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。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，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。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了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，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。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

债券投资在持有期间按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。在计算实际利率时，扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税因素。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 每一份基金份额享有同等分配权；
- (2) 收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) 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，每月支付。
- (4) 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) 每日进行收益计算并分配时，每月累计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；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。若投资者赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资者赎回基金款中扣除；

(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) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。

2、基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	18,739,974.84	31,662,535.71
定期存款	170,000,000.00	235,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	188,739,974.84	266,662,535.71

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012 年 12 月 31 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	145,491,725.13	145,759,100.00	267,374.87	0.0772%
	合计	145,491,725.13	145,759,100.00	267,374.87	0.0772%
项目		上年度末 2011 年 12 月 31 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	184,718,858.63	184,545,200.00	-173,658.63	-0.0366%
	合计	184,718,858.63	184,545,200.00	-173,658.63	-0.0366%

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

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应收活期存款利息	5,817.80	12,118.08
应收定期存款利息	485,785.08	746,507.01
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	371.25	-
应收债券利息	3,025,202.74	3,799,917.38
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	54.30	2,000.56
其他	-	-
合计	3,517,231.17	4,560,543.03

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	11,128.35	5,492.40
合计	11,128.35	5,492.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,839.29	1,638.46
预提信息披露费	80,000.00	80,000.00
预提审计费	60,000.00	80,000.00
合计	141,839.29	161,638.46

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴货币 A		
项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,126,126.18	87,126,126.18

本期申购	3,057,775,711.55	3,057,775,711.55
本期赎回(以“-”号填列)	-2,933,362,033.81	-2,933,362,033.81
– 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	211,539,803.92	211,539,803.92

东吴货币 B		
项目	本期	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	387,281,660.61	387,281,660.61
本期申购	2,020,449,352.73	2,020,449,352.73
本期赎回(以“-”号填列)	-2,273,036,140.83	-2,273,036,140.83
– 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	134,694,872.51	134,694,872.51

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。

7.4.7.10 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	6,388,073.21	–	6,388,073.21
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	-6,388,073.21	–	-6,388,073.21
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	–	–	–
本期利润	6,654,507.30	–	6,654,507.30
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	-6,654,507.30	-	-6,654,507.30
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	462,680.14	388,819.45
定期存款利息收入	7,199,382.38	15,229,941.38
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,901.97	29,857.96
其他	21,130.44	47,404.66
合计	7,702,094.93	15,696,023.45

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012 年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	626,685,731.72	2,265,744,474.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	608,112,834.23	2,239,137,319.09
减：应收利息总额	16,142,760.61	26,103,102.90
债券投资收益	2,430,136.88	504,052.31

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未进行资产支持证券投资交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间未进行衍生工具投资交易。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	484,000.00
合计	-	484,000.00

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	80.00	-
合计	80.00	-

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	80,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
其他费用	30.00	240.00
银行汇划费用	26,159.19	36,994.60
数字证书服务费	400.00	-
帐户维护费	34,830.00	18,060.00
合计	201,419.19	215,294.60

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

无需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

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
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
江阴澄星实业集团有限公司	基金管理人的股东

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

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。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东吴证券股份有限公司	-	-	140,000,000.00	3.01%

7.4.10.1.4 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。

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无应支付关联方佣金。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,351,880.47	3,364,103.56
其中：支付销售机构的客户维护费	351,959.11	679,758.43

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	409,660.82	1,019,425.24

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。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	合计
东吴基金管理有限公司	39,687.35	12,753.61	52,440.96

中国农业银行股份有限公司	112,838.61	3,410.37	116,248.98
东吴证券股份有限公司	1,211.35	-	1,211.35
合计	153,737.31	16,163.98	169,901.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	合计
东吴基金管理有限公司	36,051.39	48,488.08	84,539.47
中国农业银行股份有限公司	157,770.45	6,342.75	164,113.20
东吴证券股份有限公司	4,707.74	-	4,707.74
合计	198,529.58	54,830.83	253,360.41

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 $\times$ R / 当年天数；R 为该级基金份额的年销售服务费率。

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

本基金管理人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。

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

本基金报告期末及上年度末基金管理人运用固有资金无投资本基金的情况。

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

本基金报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	18,739,974.84	462,680.14	31,662,535.71	388,819.45

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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 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
6,388,073.21	-	-	6,388,073.21	-

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
6,654,507.30	-	-	6,654,507.30	-

7.4.12 期末（2012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/增发证券而流通受限证券。

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**

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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。

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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

本基金管理人根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的三级风险控制组织体系。董事会层面主要负责公司的风险管理战略和控制政策等事项；公司经营管理层下设投资决策委员会、风险管理委员会和监察稽核部对经营风险进行预防和控制，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。

7.4.13.2 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。

对于与债券投资相关的信用风险，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中信银行股份有限公司。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。

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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 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	68,739,974.84	120,000,000.00	-	-	-	-	188,739,974.84
结算备付金	750,000.00	-	-	-	-	-	750,000.00

存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	10,861,997.91	64,445,411.00	70,184,316.22	-	-	-	145,491,725.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,517,231.17	3,517,231.17
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	8,241,460.61	8,241,460.61
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	80,351,972.75	184,445,411.00	70,184,316.22	-	-	11,758,691.78	346,740,391.75
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	142,055.43	142,055.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	119,155.84	119,155.84
应付托管费	-	-	-	-	-	36,107.84	36,107.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	55,428.57	55,428.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,128.35	11,128.35
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	141,839.29	141,839.29
负债总计	-	-	-	-	-	505,715.32	505,715.32
利率敏感度缺口	80,351,972.75	184,445,411.00	70,184,316.22	-	-	11,252,976.46	346,234,676.43
上年度末 2011 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	266,662,535.71	-	-	-	-	-	266,662,535.71
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	74,637,218.29	110,081,640.34	-	-	-	184,718,858.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,560,543.03	4,560,543.03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	18,907,125.37	-	-	-	-	-	18,907,125.37
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	285,569,661.08	74,637,218.29	110,081,640.34	-	-	4,560,543.03	474,849,062.74
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	109,479.28	109,479.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,025.26	110,025.26
应付托管费	-	-	-	-	-	33,340.95	33,340.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,299.60	21,299.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,492.40	5,492.40
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	161,638.46	161,638.46
负债总计	-	-	-	-	-	441,275.95	441,275.95
利率敏感度缺口	285,569,661.08	74,637,218.29	110,081,640.34	-	-	4,119,267.08	474,407,786.79

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。

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（2012 年 12 月 31 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	123,800.00	548,400.00
	利率上升 25 个基点	-123,300.00	-538,600.00

7.4.13.4.2 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。

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。

§ 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	145,491,725.13	41.96
	其中：债券	145,491,725.13	41.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	189,489,974.84	54.65
4	其他各项资产	11,758,691.78	3.39
5	合计	346,740,391.75	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	2.17	
	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	-	-
	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
1	2012 年 3 月 28 日	20.08	大额赎回	2012-03-29

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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：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。

本处的 180 天已依照基金合同约定调整为按 120 天予以列示。

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	23.21	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	3.14	—
2	30 天(含)—60 天	23.11	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	30.17	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	6.97	—
4	90 天(含)—180 天	8.70	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	—	—
5	180 天(含)—397 天(含)	11.57	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	—	—
合计		96.75	—

注：本基金合同约定投资组合的平均剩余期限不超过 120 天，本处的 180 天已依照基金合同约定

调整为按 120 天予以列示。

8.4 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	44,987,126.26	12.99
	其中：政策性金融债	44,987,126.26	12.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,504,598.87	29.03
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	145,491,725.13	42.02
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	34,994,493.28	10.11

8.5 期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041258014	12 獐子岛 CP001	200,000	20,169,043.90	5.83
2	110221	11 国开 21	110,000	10,861,997.91	3.14
3	090205	09 国开 05	100,000	10,139,193.13	2.93
4	041259017	12 豫光铅 CP001	100,000	10,112,137.97	2.92
5	041258020	12 天辰化工 CP002	100,000	10,056,577.44	2.90
6	041258021	12 皖交投 CP001	100,000	10,050,784.25	2.90
7	041264008	12 农六师 CP001	100,000	10,043,680.70	2.90
8	041271002	12 苏垦 CP001	100,000	10,031,733.76	2.90
9	041265006	12 瑞水泥 CP002	100,000	10,021,796.23	2.89
10	041263005	12 云煤化 CP001	100,000	10,016,974.42	2.89

8.6 “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	20
报告期内偏离度的最高值	0.3311%
报告期内偏离度的最低值	-0.0214%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1248%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

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。

8.8.2

本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 天浮动利率债券的说明：

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2012 年 2 月 29 日	20.10	大额赎回	2012-03-01
2	2012 年 6 月 27 日	22.27	大额赎回	2012-07-02
3	2012 年 6 月 28 日	20.30	大额赎回	2012-07-02
4	2012 年 6 月 29 日	20.46	大额赎回	2012-07-02
5	2012 年 6 月 30 日	20.46	大额赎回	2012-07-02
6	2012 年 7 月 1 日	20.45	大额赎回	2012-07-02
7	2012 年 7 月 10 日	20.08	大额赎回	2012-07-18
8	2012 年 7 月 11 日	20.29	大额赎回	2012-07-18
9	2012 年 7 月 12 日	20.50	大额赎回	2012-07-18
10	2012 年 7 月 13 日	20.78	大额赎回	2012-07-18

11	2012 年 7 月 14 日	20.78	大额赎回	2012-07-18
12	2012 年 7 月 15 日	20.78	大额赎回	2012-07-18
13	2012 年 7 月 16 日	22.07	大额赎回	2012-07-18
14	2012 年 7 月 17 日	22.43	大额赎回	2012-07-18

8.8.3 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。

8.8.4 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	-
3	应收利息	3,517,231.17
4	应收申购款	8,241,460.61
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,758,691.78

8.8.5 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	14,404	14,686.18	13,253,778.78	6.27%	198,286,025.14	93.73%
东吴 货币 B	14	9,621,062.32	84,191,900.95	62.51%	50,502,971.56	37.49%

合计	14,418	9,635,748.51	97,445,679.73	28.14%	248,788,996.70	71.86%
----	--------	--------------	---------------	--------	----------------	--------

注：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。

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	东吴货币 A	-	-
	东吴货币 B	-	-
	合计	-	-

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§ 10 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	87,126,126.18	387,281,660.61
本报告期基金总申购份额	3,057,775,711.55	2,020,449,352.73
减：本报告期基金总赎回份额	2,933,362,033.81	2,273,036,140.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	211,539,803.92	134,694,872.51

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人东吴基金管理有限公司原总经理徐建平同志因组织安排和个人工作调动原因辞去总经理职务，离任日期 2012 年 9 月 17 日，公司聘任任少华同志为新任基金管理公司总经理。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第一次临时会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2012 年 9 月 18 日进行了披露。

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司原督察长吴威同志因工作需要调任筹建东吴基金子公司辞去公司督察长职务，离任日期 2012 年 12 月 29 日，由公司总经理任少华同志代行督察长职责。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第六次临时会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2012 年 12 月 29 日进行了披露。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司决定改聘江苏天衡会计师事务所有限公司担任公司及旗下基金的会计师事务所。此事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2012 年 12 月 29 日进行了披露。该会计师事务所从 2012 年提供审计服务，本报告期内支付审计费 60000 元。

11.6 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。

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	
华泰联合	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	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

本报告期本基金终止交易单元 3 个，分别为东海证券、中航证券、大通证券交易单元。

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
华泰联合	-	-	890,000,000.00	30.32%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	1,325,000,000.00	45.14%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	720,000,000.00	24.53%	-	-

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	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增财富里昂证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 1 月 5 日
2	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 1 月 6 日
3	东吴货币市场证券投资基金 2012 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	2012 年 1 月 17 日
4	东吴货币市场证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2012 年 1 月 19 日
5	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 2 月 8 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中信证券（浙江）有限责任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、公司网站	2012 年 2 月 16 日
7	东吴基金管理有限公司关于通过东吴基金网上交易平台进行基金转换业务实行转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 2 月 29 日
8	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 3 月 8 日
9	东吴货币市场证券投资基金 2012 年清明假期前暂停（大额） 申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2012 年 3 月 27 日
10	东吴货币市场证券投资基金	上海证券报、公司网站	2012 年 3 月 28

	2011 年年度报告		日
11	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 4 月 6 日
12	东吴货币市场证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	上海证券报、公司网站	2012 年 4 月 20 日
13	东吴货币市场证券投资基金 2012 年五一假期暂停（大额）申 购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2012 年 4 月 24 日
14	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金在中国中投证券有限责 任公司推出定期定额投资业务 并参加其定期定额申购费率优 惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 4 月 24 日
15	东吴货币市场基金收益支付公 告	上海证券报、公司网站	2012 年 5 月 8 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金新增深圳众禄基金销售 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、公司网站	2012 年 6 月 5 日
17	东吴货币市场基金收益支付公 告	上海证券报、公司网站	2012 年 6 月 7 日
18	东吴货币市场证券投资基金 2012 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	2012 年 6 月 18 日
19	东吴货币市场投资基金更新招 募说明书摘要	上海证券报、公司网站	2012 年 6 月 25 日
20	东吴货币市场基金收益支付公 告	上海证券报、公司网站	2012 年 7 月 6 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗	中国证券报、上海证券报、	2012 年 7 月 11

	下基金新增华鑫证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	证券时报、公司网站	日
22	东吴货币市场证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	上海证券报、公司网站	2012 年 7 月 20 日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在财富里昂证券有限责任公司开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 7 月 24 日
24	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 8 月 8 日
25	东吴货币市场证券投资基金 2012 年半年度报告	上海证券报、公司网站	2012 年 8 月 25 日
26	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 9 月 6 日
27	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 9 月 18 日
28	东吴货币市场证券投资基金 2012 年中秋、国庆假期前暂停 (大额) 申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2012 年 9 月 24 日
29	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 10 月 8 日
30	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增国海证券股份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、公司网站	2012 年 10 月 15 日
31	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增浙江同花顺基金销	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 10 月 17 日

	售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		
32	东吴货币市场证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	上海证券报、公司网站	2012 年 10 月 25 日
33	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 11 月 8 日
34	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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、公司网站	2012 年 11 月 21 日
35	东吴货币市场基金收益支付公告	上海证券报、公司网站	2012 年 12 月 6 日
36	关于提请投资者及时更新过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 12 月 17 日
37	东吴货币市场证券投资基金 2013 年元旦假期前暂停（大额） 申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2012 年 12 月 25 日
38	东吴货币市场基金更新招募说明书摘要	上海证券报、公司网站	2012 年 12 月 26 日
39	东吴基金管理有限公司关于改聘会计师事务所公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 12 月 29 日
40	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2012 年 12 月 29 日

§ 12 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指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

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
2013 年 3 月 26 日