

东吴货币市场证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：二〇一七年三月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

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 2016 年 01 月 01 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	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	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 债券回购融资情况	45
8.3 基金投资组合平均剩余期限	45
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
8.6 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	46
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47

8.8 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	47
8.9 投资组合报告附注	47
§9 基金份额持有人信息.....	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
9.3 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	49
§10 开放式基金份额变动.....	49
§11 重大事件揭示.....	49
11.1 基金份额持有人大会决议	49
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	53
11.9 其他重大事件	53
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§13 备查文件目录.....	60
13.1 备查文件目录	60
13.2 存放地点	60
13.3 查阅方式	60

§ 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	5,662,323,286.45 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	437,755,089.15 份	5,224,568,197.30 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

注：基金管理人于 2016 年 2 月 3 日发布法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为王炯先生。

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（特殊普通合伙）	南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座（14 幢）20 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	2016 年		2015 年		2014 年	
	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	2,105,998.19	112,414,478.79	3,584,200.18	23,239,294.26	4,467,649.23	1,827,412.50
本	2,105,998.	112,414,478.	3,584,200.	23,239,294.2	4,467,649.2	1,827,412.

期 利 润	19	79	18	6	3	50
本 期 净 值 收 益 率	2.5027%	2.7482%	3.5350%	3.7840%	3.8106%	3.9028%
3.1. 2 期 末 数 据 和 指 标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期 末 基 金 资 产 净 值	437,755,089 .15	5,224,568,19 7.30	103,739,57 0.45	3,096,715,70 6.45	106,382,87 2.09	104,449,391 .70
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	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
累 计	22.1850%	23.9636%	19.2017%	20.6480%	15.1317%	16.2491%

净值 收 益 率						
-------------------	--	--	--	--	--	--

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6611%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.3208%	0.0027%
过去六个月	1.2596%	0.0022%	0.6805%	0.0000%	0.5791%	0.0022%
过去一年	2.5027%	0.0018%	1.3537%	0.0000%	1.1490%	0.0018%
过去三年	10.1703%	0.0080%	4.0537%	0.0000%	6.1166%	0.0080%
过去五年	17.2654%	0.0076%	6.8215%	0.0001%	10.4439%	0.0075%
自基金合同 生效起至今	22.1850%	0.0069%	9.1503%	0.0001%	13.0347%	0.0068%

东吴货币 B

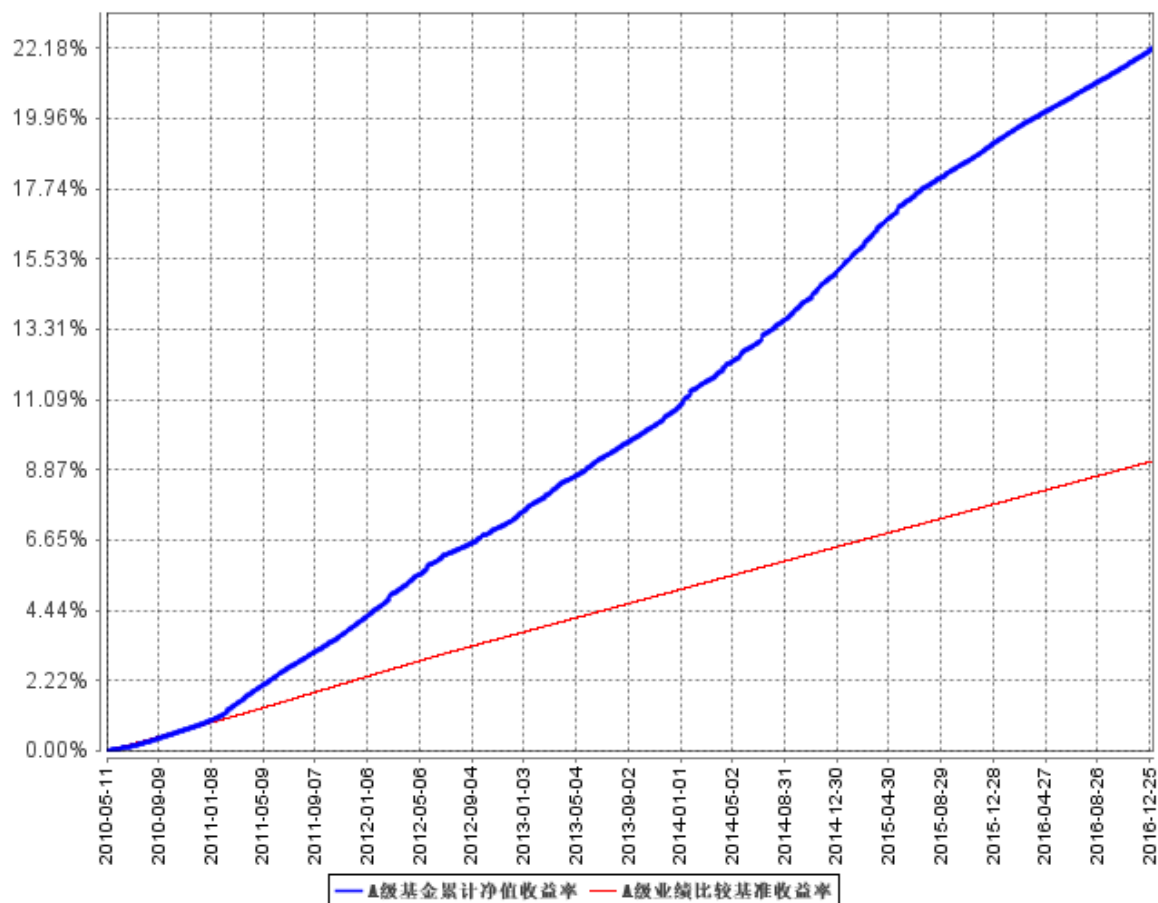
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7206%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.3803%	0.0027%
过去六个月	1.3807%	0.0022%	0.6805%	0.0000%	0.7002%	0.0022%
过去一年	2.7482%	0.0018%	1.3537%	0.0000%	1.3945%	0.0018%
过去三年	10.7980%	0.0072%	4.0537%	0.0000%	6.7443%	0.0072%
过去五年	18.5017%	0.0071%	6.8215%	0.0001%	11.6802%	0.0070%
自基金合同 生效起至今	23.9636%	0.0065%	9.1503%	0.0001%	14.8133%	0.0064%

注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

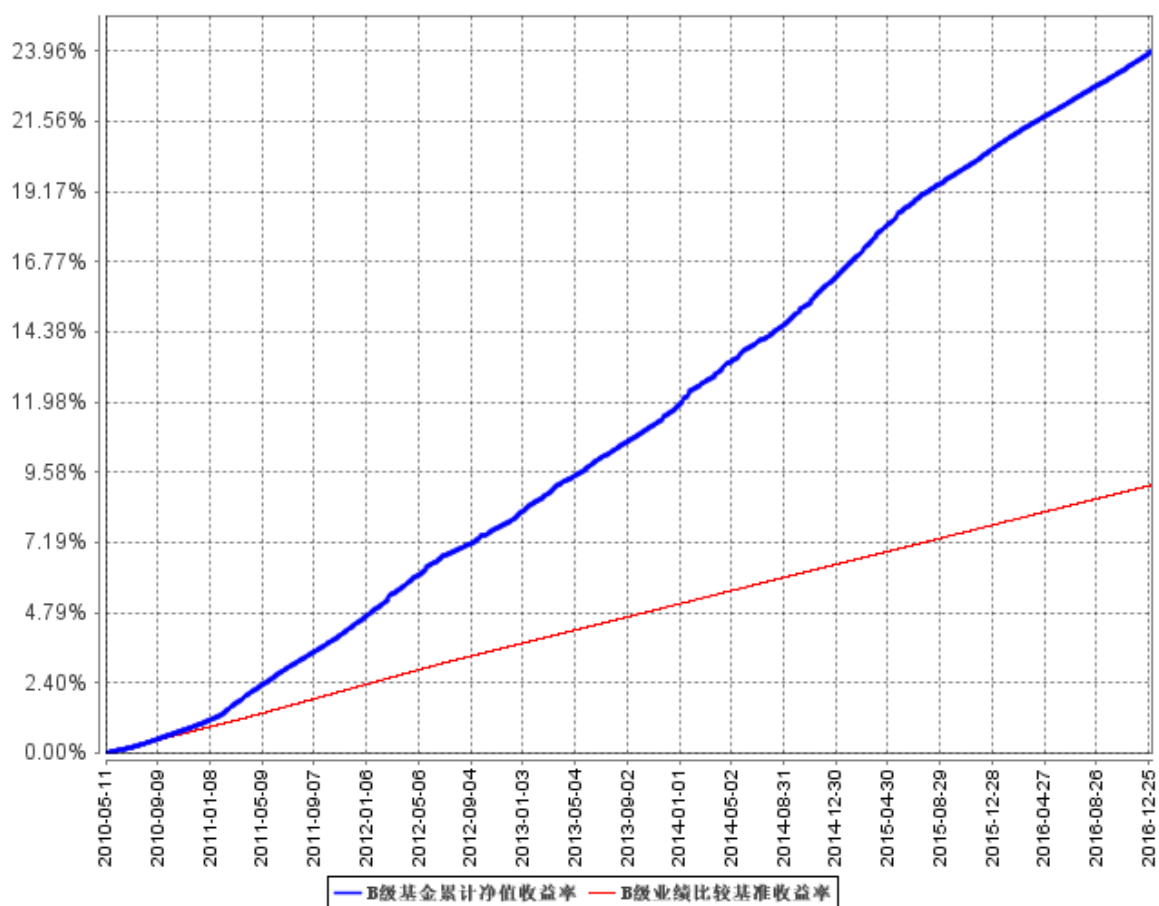
2、本基金收益分配按日结转份额。

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

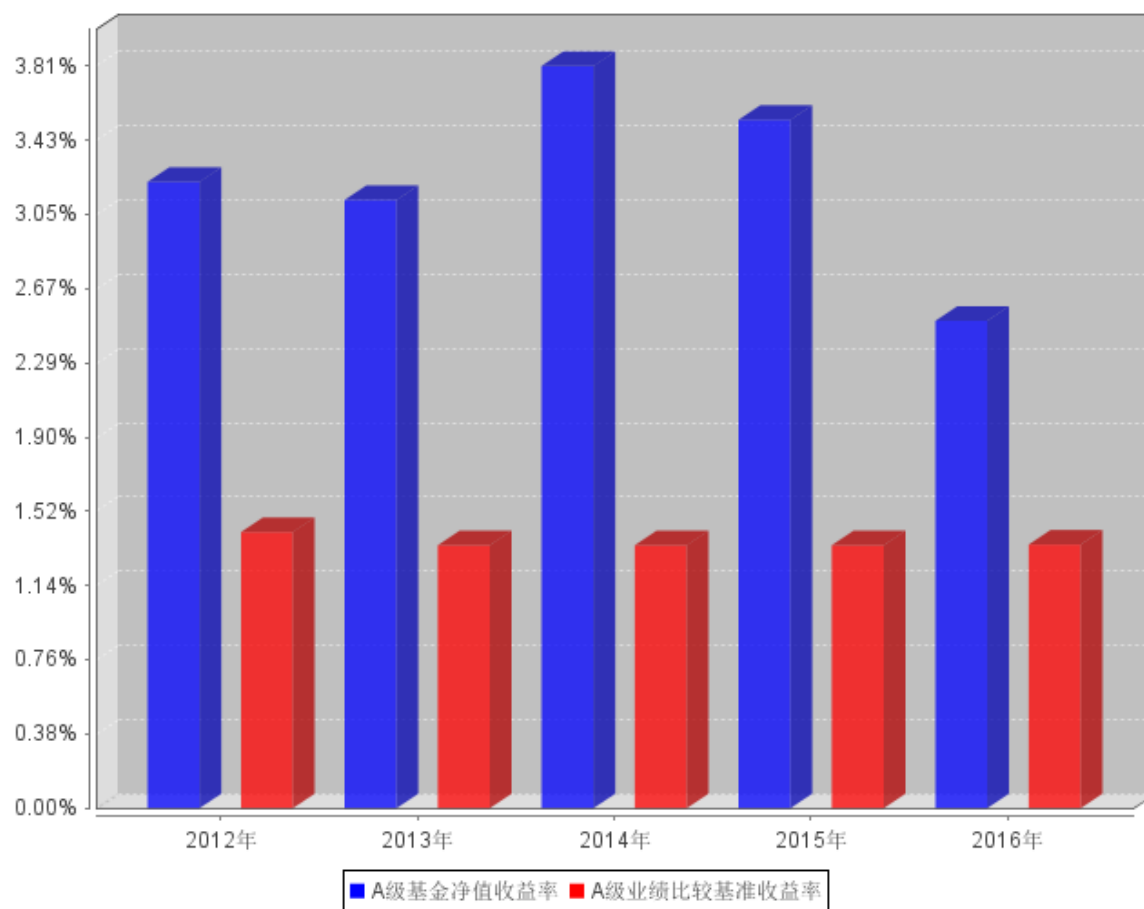


注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

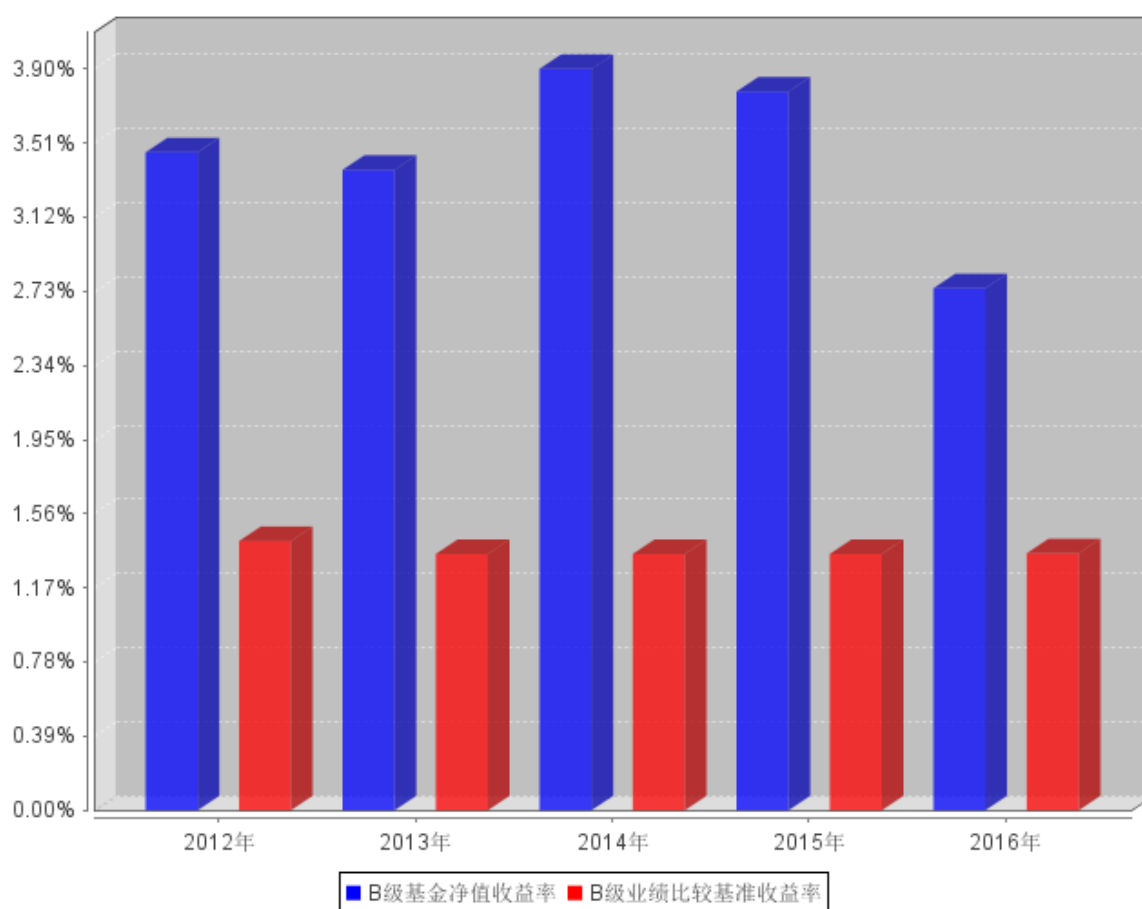
2、本基金于 2010 年 5 月 11 日成立。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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
2016	2,105,998.19	-	-	2,105,998.19	
2015	3,584,200.18	-	-	3,584,200.18	
2014	4,467,649.23	-	-	4,467,649.23	
合计	10,157,847.60	-	-	10,157,847.60	

单位：人民币元

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
2016	112,414,478.79	-	-	112,414,478.79	
2015	23,239,294.26	-	-	23,239,294.26	
2014	1,827,412.50	-	-	1,827,412.50	
合计	137,481,185.55	-	-	137,481,185.55	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基字[2004]32 号开业批文, 并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币, 公司所在地为上海市浦东新区源深路 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, 尤其在公募及专户领域大刀阔斧地进行了事业部制改革和平台化战略尝试, 进一步加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2016 年 12 月 31 日, 公司整体资产管理规模为 631.46 亿元, 其中公募基金 148.47 亿元, 专户业务 101.51 亿元, 子公司 381.48 亿元; 旗下管理着 25 只公募基金, 33 只存续专户资产管理计划, 101 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。

2015 年以来, 公司在成长股投资的传统优势基础上, 进一步引入了量化投资策略, 并在业内率先成立了绝对收益部, 谋求穿越牛熊的正回报。目前已发行多只量化公募产品, 其中东吴安盈量化基金、东吴安鑫量化基金为“量化策略+全市场选股”; 东吴智慧医疗基金为“量化策略+热门主题”。从实战检验角度看, 该系列基金经受住了市场反复震荡的考验, 尤其在严控回撤、优化收益方面成效显著, 初步实现了“下跌时回撤小, 上涨时不掉队”的目标。

经过多年积累和布局, 公司的公募业务已形成三大投研“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. 绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念, 借助量化模型进行择时和选股; 3. 固定收益以稳健为本, 兼顾流动性与收益率, 为大类资产配置提供基础性工具。

2016 年, 公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券 2016 年基金公司固定收益投资能力排行榜显示, 东吴基金固收团队以 3.81%的综合收益率, 位列 85 家入选基金公司的第六位。

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 2016 年度最受欢迎债券类基金*东吴鼎利债券基金 LOF(东方财富风云榜)、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	—	10 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

2016 年世界经济依然在低位徘徊，但美国经济逐步走出低谷，有向好之势，随着新总统当选，市场乐观预期进一步增强，美元指数最高突破 103.8，资金回流美国令其他国家汇率承受压力。国内经济在一季度的天量信贷和房屋销售趋热的作用下有所企稳，全年 GDP 同比增长 6.7%，CPI 同比增长 2%，PPI 则在去产能去库存作用下一路上行，突破 5 年多以来的高点。货币政策全年表现前松后紧，供给侧改革不断推进，防金融系统风险，降杠杆等成为央行的关注点，加之汇率带来的压力，货币政策在年中后转为中性，通过 MLF 等长期资金代替部分逆回购操作等锁短放长方式是较为显著的信号。

债券市场在 11 月前仍表现强劲，虽然 4 月底，受巨量信贷、CPI 走高和大宗商品大幅上涨等因素影响，10 年期国开收益率一度上行至 3.5%，但此后各类数据表现一般，另有英国脱欧等消息支撑，配置预期自我强化，债市收益率震荡下行，10 月中旬再度回到 3.0%，此后货币政策转向信号愈加明显，资金外流、流动性压力、金融机构信用风险、MPA 考核等各项因素迫使债市去杠杆，债市遭遇重挫，10 年国开一举突破 3.9%。信用债的走势和利率债相近，只是在配置压力推动下，收益率下行阶段趋势更加稳定，但短期品种受资金面影响更大。

资金面在 9 月前相对宽松，3、4 月 MPA 考核首次施行，机构准备不足，资金面遭遇短期冲击，9 月后叠加假期节日、锁短放长等因素，资金面略显偏紧，此后各类负面消息不断涌现，12 月一度面临流动性近乎枯竭的紧张局面，回购利率大幅飙升，堪比 2013 年，机构间信用遭受考验，央行及时救市支持方得以缓解。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期东吴货币 A 份额净值收益率为 2.5027%，东吴货币 B 份额净值收益率为 2.7482%，同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年外部环境变化仍然是影响国内政策的重要因素，资金流动、贸易摩擦、国家间纷争等都将引发市场预期的转向或加强。国内看，美元加息进程已然启动，而且央行意在推动金融机构降杠杆，降息几率很低，债市需保持谨慎；汇率贬值压力下，央行坚持通过 MLF、TLF 及逆回购等方式提供流动性以弥补资金外流引发的资金不足，不排除合适时机降准的可能性。

目前状况下，由于基础货币不足，资金面极为不稳定，稍有突发因素即引起资金面大幅波动，宜缩短组合久期。由于此前货币政策关注经济稳增长、大宗商品走强，2016 年信用风险相对可控，但 2017 年仍不可对其轻视。随着银监会对银行理财进一步规范，低评级债有调整压力，而有助于增加高等级债券需求。

2016 年末货币基金遭遇流动性的严峻考验，我们平稳应对，在新的年度，我们仍将坚持做好基金的风险管理，防范信用风险，实现货币基金流动性管理这一最重要的功能，通过合理配置资产组合，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，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强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、定期检查、专项稽核等方式，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，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

（1）紧跟业务要求，完善风险控制手段。本基金管理人结合基金风险管理要求，事前做好系

统风控设置，事中加强监控及跟踪提示，事后积极研究、探索风控手段的优化方案，规范流程，提升效率，构建多维度的风险管理层次，不断提升公司风险管理水平。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 梳理信批流程，促进信息披露规范化。本基金管理人持续关注最新出台的法律法规，根据产品的不同信息披露要求切实做好信息披露要点汇总、节点提示及对外披露等工作，加强流程化、日志化管理，保障了信息披露工作的及时性以及准确性。

(4) 提升合规氛围，推动合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、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合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围。

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，成员由公司副总经理、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；公司副总经理、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。

4.8 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 2,105,998.19 元，实际分配收益 2,105,998.19 元；东吴货币 B 级基金应分配收益 112,414,478.79 元，实际分配收益 112,414,478.79 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，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 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 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（2017）00515 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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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	陆德忠	魏娜
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国·南京	

审计报告日期	2017 年 2 月 28 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	2,236,363,679.54	1,444,654,438.52
结算备付金		638,553.92	-
存出保证金		26,715.54	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,216,792,947.31	565,299,681.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,216,792,947.31	565,299,681.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,116,094,697.65	1,186,415,326.12
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	15,572,200.91	10,864,079.05
应收股利		-	-
应收申购款		156,855,756.02	3,111,947.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,742,344,550.89	3,210,345,473.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		78,084,762.87	-
应付证券清算款		-	9,000,000.00
应付赎回款		54,333.33	42,233.68
应付管理人报酬		1,215,921.33	549,368.53
应付托管费		368,461.02	166,475.31

应付销售服务费		69,337.90	33,800.28
应付交易费用	7.4.7.7	53,256.72	27,760.95
应交税费		-	-
应付利息		12,954.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	162,236.81	70,557.71
负债合计		80,021,264.44	9,890,196.46
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	5,662,323,286.45	3,200,455,276.90
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		5,662,323,286.45	3,200,455,276.90
负债和所有者权益总计		5,742,344,550.89	3,210,345,473.36

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,662,323,286.45 份。其中东吴货币 A 级的基金份额为 437,755,089.15 份，东吴货币 B 级的基金份额为 5,224,568,197.30 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		138,800,648.42	31,977,042.31
1.利息收入		133,941,892.80	30,234,126.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	67,080,902.63	20,042,591.34
债券利息收入		46,017,004.49	6,850,168.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,843,985.68	3,341,365.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,858,755.62	1,742,916.24
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	4,858,755.62	1,742,916.24
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		24,280,171.44	5,153,547.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,064,029.67	2,860,452.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,261,827.13	866,803.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	620,167.17	336,043.17
4. 交易费用	7.4.7.19	150.00	35.49
5. 利息支出		5,075,357.89	847,221.70
其中：卖出回购金融资产支出		5,075,357.89	847,221.70
6. 其他费用	7.4.7.20	258,639.58	242,991.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		114,520,476.98	26,823,494.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		114,520,476.98	26,823,494.44

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	114,520,476.98	114,520,476.98
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）	2,461,868,009.55	-	2,461,868,009.55
其中：1. 基金申购款	35,024,445,623.91	-	35,024,445,623.91
2. 基金赎回款	-32,562,577,614.36	-	-32,562,577,614.36
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）	-	-114,520,476.98	-114,520,476.98

五、期末所有者权益（基金净值）	5,662,323,286.45	-	5,662,323,286.45
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	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）	-	26,823,494.44	26,823,494.44
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）	2,989,623,013.11	-	2,989,623,013.11
其中：1. 基金申购款	9,014,296,346.97	-	9,014,296,346.97
2. 基金赎回款	-6,024,673,333.86	-	-6,024,673,333.86
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）	-	-26,823,494.44	-26,823,494.44
五、期末所有者权益（基金净值）	3,200,455,276.90	-	3,200,455,276.90

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：

王炯

基金管理人负责人

吕晖

主管会计工作负责人

沈静

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 2016 年 12 月 31 日的财务状况及 2016 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。本报告期为 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金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) 对存在活跃市场的投资品种，如报表日有成交价，应当以当日收盘价作为公允价值。活跃市场中的报价是指易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格。如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应当以最近交易日收盘价作为公允价值；如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应当在谨慎原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定公允价值。

(2) 金融工具不存在活跃市场的，本公司采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考计量日市场参与者在主要市场或最有利市场中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具当前的公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

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[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。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	63,863,679.54	14,654,438.52
定期存款	2,172,500,000.00	1,430,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	2,172,500,000.00	1,430,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	2,236,363,679.54	1,444,654,438.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 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	10,496,303.35	10,434,761.00	-61,542.35	-0.0011%
	银行间市场	1,206,296,643.96	1,206,033,000.00	-263,643.96	-0.0047%
	合计	1,216,792,947.31	1,216,467,761.00	-325,186.31	-0.0057%
项目		上年度末 2015 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	565,299,681.97	566,202,900.00	903,218.03	0.0282%

	合计	565,299,681.97	566,202,900.00	903,218.03	0.0282%
--	----	----------------	----------------	------------	---------

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	600,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	1,158,434,697.65	-
买入返售证券_固定平台	357,660,000.00	-
合计	2,116,094,697.65	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	9,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	1,177,415,326.12	-
合计	1,186,415,326.12	-

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,012.49	415.76
应收定期存款利息	2,123,402.74	4,210,809.11
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	316.14	-

应收债券利息	9,961,216.50	5,657,921.96
应收买入返售证券利息	3,483,239.84	994,932.22
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	13.20	-
合计	15,572,200.91	10,864,079.05

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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	53,256.72	27,760.95
合计	53,256.72	27,760.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	36.81	147.71
应付汇划费	3,200.00	1,410.00
预提审计费	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	90,000.00	-
预提中债账户维护费	4,500.00	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	162,236.81	70,557.71

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	754,846,780.80	754,846,780.80
本期赎回(以“-”号填列)	-420,831,262.10	-420,831,262.10
— 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	437,755,089.15	437,755,089.15

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 12 月 31 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	34,269,598,843.11	34,269,598,843.11
本期赎回(以“-”号填列)	-32,141,746,352.26	-32,141,746,352.26
— 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	5,224,568,197.30	5,224,568,197.30

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	2,105,998.19	—	2,105,998.19
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-2,105,998.19	—	-2,105,998.19
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	112,414,478.79	-	112,414,478.79
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	-112,414,478.79	-	-112,414,478.79
本期末	-	-	-

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	52,645.85	12,757.42
定期存款利息收入	67,010,881.65	20,006,216.87
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	12,015.37	658.09
其他	5,359.76	22,958.96
合计	67,080,902.63	20,042,591.34

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

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,533,805,667.65	617,090,043.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,480,783,512.59	608,209,504.17
减：应收利息总额	48,163,399.44	7,137,622.87
买卖债券差价收入	4,858,755.62	1,742,916.24

7.4.7.13.2 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**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间未进行权证投资交易。

7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未进行其他投资交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	150.00	35.49
合计	150.00	35.49

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	90,000.00	90,000.00
银行汇划费用	72,279.58	56,631.41
帐户维护费	36,360.00	36,360.00

数字证书服务费	-	-
合计	258,639.58	242,991.41

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

无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、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
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海兰生（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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东吴证券股份有限公司	166,776,245.84	76.21%	-	-

7.4.10.1.3 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。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,064,029.67	2,860,452.38
其中：支付销售机构的客户维护费	164,402.87	194,255.89

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 × 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,261,827.13	866,803.72

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 × 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	44,136.04	398,357.95	442,493.99

中国农业银行股份有限公司	56,427.50	1,620.75	58,048.25
东吴证券股份有限公司	5,632.33	398.56	6,030.89
合计	106,195.87	400,377.26	506,573.13
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 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	27,091.33	68,291.65	95,382.98
中国农业银行股份有限公司	77,489.76	574.52	78,064.28
东吴证券股份有限公司	5,528.16	0.00	5,528.16
合计	110,109.25	68,866.17	178,975.42

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 × 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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	-	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 12 月 31 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	-	-

本基金管理人上年度可比期间未持有本基金份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

东吴货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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	300,000,000.00	5.2982%	100,000,000.00	3.2300%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	63,863,679.54	52,645.85	14,654,438.52	12,757.42

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

无其他需要说明的关联交易事项。

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
2,105,998.19	-	-	2,105,998.19	-

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
112,414,478.79	-	-	112,414,478.79	-

7.4.12 期末（2016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业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指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。

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半月以内且不计息，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 2016 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	518,863,679.54	717,500,000.00	1,000,000,000.00	-	-	-	-2,236,363,679.54
清算备付金	638,553.92	-	-	-	-	-	638,553.92

存出保证金	-	-	-	-	-	26,715.54	26,715.54
交易性金融资产	149,996,738.83	697,818,155.82	368,978,052.66	-	-	-	1,216,792,947.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,116,094,697.65	-	-	-	-	-	2,116,094,697.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	15,572,200.91	15,572,200.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	156,855,756.02	156,855,756.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,785,593,669.94	1,415,318,155.82	1,368,978,052.66	-	-	172,454,672.47	5,742,344,550.89
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	78,084,762.87	-	-	-	-	-	78,084,762.87
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	54,333.33	54,333.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,215,921.33	1,215,921.33
应付托管费	-	-	-	-	-	368,461.02	368,461.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,337.90	69,337.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	53,256.72	53,256.72
应交税费	-	-	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-	12,954.46	12,954.46
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	162,236.81	162,236.81
负债总计	78,084,762.87	-	-	-	-	1,936,501.57	80,021,264.44
利率敏感度缺口	2,707,508,907.07	1,415,318,155.82	1,368,978,052.66	-	-	170,518,170.90	5,662,323,286.45
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、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。	
	2、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。	
	3、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 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	525,198.60	677,682.06
	利率上升 25 个基点	-523,363.36	-674,886.54

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

7.4.14 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。

§ 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	1,216,792,947.31	21.19
	其中：债券	1,216,792,947.31	21.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,116,094,697.65	36.85
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,237,002,233.46	38.96
4	其他各项资产	172,454,672.47	3.00
5	合计	5,742,344,550.89	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	4.93	
	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	78,084,762.87	1.38
	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

报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的 20%。

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	51
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	40

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	50.96	1.38
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	8.79	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	16.21	—

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	12.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	7.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		95.72	1.38

注：本基金合同约定本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	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	219,745,460.85	3.88
	其中：政策性金融债	219,745,460.85	3.88
4	企业债券	10,496,303.35	0.19
5	企业短期融资券	489,016,222.81	8.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	497,534,960.30	8.79
8	其他	-	-
9	合计	1,216,792,947.31	21.49
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	160401	16 农发 01	1,000,000	99,998,950.22	1.77
2	011698463	16 华电江苏 SCP002	1,000,000	99,927,774.49	1.76
3	011698499	16 同方 SCP004	1,000,000	99,600,883.86	1.76
4	111680364	16 南充商行 CD045	1,000,000	99,532,930.45	1.76

5	111680464	16 西安银行 CD051	1,000,000	99,521,174.83	1.76
6	111680517	16 中原银行 CD153	1,000,000	99,518,392.39	1.76
7	111680547	16 厦门银行 CD152	1,000,000	99,511,809.06	1.76
8	111680442	16 德阳银行 CD096	1,000,000	99,450,653.57	1.76
9	160211	16 国开 11	700,000	69,774,044.13	1.23
10	041655028	16 康美 CP001	600,000	59,583,555.14	1.05

8.7 “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	-0.1162%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0515%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,715.54
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,572,200.91
4	应收申购款	156,855,756.02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	172,454,672.47

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
东吴 货币 A	14,255	30,708.88	20,355,611.65	4.65%	417,399,477.50	95.35%
东吴 货币 B	112	46,647,930.33	4,751,222,318.62	90.94%	473,345,878.68	9.06%
合计	14,367	394,120.09	4,771,577,930.27	84.27%	890,745,356.18	15.73%

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
基金管理人所有从业人员 持有本基金	东吴货币 A	149,924.89	0.0342%
	东吴货币 B	-	-

	合计	149,924.89	0.0027%
--	----	------------	---------

9.3 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	—
	东吴货币 B	—
	合计	—
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

§ 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	103,739,570.45	3,096,715,706.45
本报告期基金总申购份额	754,846,780.80	34,269,598,843.11
减:本报告期基金总赎回份额	420,831,262.10	32,141,746,352.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	437,755,089.15	5,224,568,197.30

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。

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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

1、2016 年 1 月 13 日，任少华先生不再担任公司董事一职，由范力、冯玉泉担任公司第二届董事会董事；

2、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。

3、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。

4、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。

5、2016 年 12 月 28 日，全卓伟女士不再担任公司董事一职，由倪雪梅女士担任公司第二届董事会董事。

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。

11.3 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涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2012 年起为本基金提供审计服务至今，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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	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	-	-	-	-	-
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	4	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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

本报告期本基金新增交易单元 4 个，分别为华信证券和中金公司交易单元；退租交易单元 3 个，分别为为爱建证券、华创证券和浙商证券交易单元。

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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰联合	52,047,374.86	23.79%	2,120,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东吴证券	166,776,245.84	76.21%	-	-	-	-

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 1 月 21 日

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 25 日

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	上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 3 日

	额) 申购和转换转入业务公告		
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
32	东吴基金管理有限公司管理的基金 2016 年半年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)	2016 年 7 月 1 日
33	东吴货币市场证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 20 日
34	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构并推	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 8 月 10 日

	出定期定额业务及转换业务的公告		
35	东吴货币市场证券投资基金 2016 年半年度报告以及摘要	上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
36	东吴货币市场证券投资基金 2016 年中秋节假期前暂停（大 额）申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 9 日
37	东吴基金管理有限公司关于旗 下基金上海万得投资顾问有限 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、证券日报、公司 网站	2016 年 9 月 14 日
38	东吴基金管理有限公司关于参 加上海万得投资顾问有限公司 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 9 月 14 日
39	东吴基金管理有限公司更正公 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 9 月 19 日
40	东吴基金管理有限公司关于参 加诺亚正行（上海）基金销售投 资顾问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 9 月 23 日
41	东吴货币市场证券投资基金 2016 年国庆节假期前暂停（大 额）申购和转换转入业务公告	上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 27 日
42	东吴基金管理有限公司关于旗 下部分基金新增上海基煜基金 销售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 9 月 28 日
43	东吴基金管理有限公司关于参	中国证券报、上海证券报、	2016 年 9 月 28

	加上海基煜基金销售有限公司 费率优惠的公告	证券时报、证券日报、公司 网站	日
44	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增一路财富（北京）信息科技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 10 月 14 日
45	东吴基金管理有限公司关于参加一路财富（北京）信息科技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 10 月 14 日
46	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京唐鼎耀华投资咨询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	2016 年 10 月 14 日
47	东吴基金管理有限公司关于参加北京唐鼎耀华投资咨询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、公司网站	2016 年 10 月 14 日
48	东吴基金管理有限公司关于参加浙江同花顺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 10 月 24 日
49	东吴货币市场证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 26 日
50	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 10 月 28 日
51	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京汇成基金销售有限公司为代销机构并推出定	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 11 月 14 日

	期定额业务及转换业务的公告		
52	东吴基金管理有限公司关于参加北京汇成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 11 月 14 日
53	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在公司网上交易开展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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 11 月 21 日
54	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增杭州科地瑞富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、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 12 月 7 日
55	东吴基金管理有限公司关于参加杭州科地瑞富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 12 月 7 日
56	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增北京恒天明泽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、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 12 月 7 日
57	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京微动利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	2016 年 12 月 16 日
58	东吴基金管理有限公司关于参加北京微动利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 12 月 16 日
59	东吴基金管理有限公司关于修	上海证券报、公司网站	2016 年 12 月

	改“东吴货币市场证券投资基金”基金合同和托管协议的公 告		17 日
60	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 12 月 23 日
61	东吴基金管理有限公司管理的 基金 2016 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、深交所（巨潮资讯网）	2016 年 12 月 31 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
2017 年 3 月 27 日