

# 东吴货币市场证券投资基金 2012 年半年度报告

## 摘要

2012 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

报告送出日期：二〇一二年八月二十五日

## 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 2012 年 8 月 15 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	270,352,057.21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	189,727,447.78份	80,624,609.43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	黄忠平	李芳菲
	联系电话	021-50509888-8219	010-66060069
	电子邮箱	huangzhp@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

## 2.4 信息披露方式

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

## 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012年1月1日至2012年6月30日）	
	东吴货币 A	东吴货币 B
本期已实现收益	3,579,367.50	4,783,898.85
本期利润	3,579,367.50	4,783,898.85
本期净值收益率	1.8991%	2.0207%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)	
	东吴货币 A	东吴货币 B
期末基金资产净值	189,727,447.78	80,624,609.43
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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

##### 1. 东吴货币 A：

阶段	份额净值收 益率	净值收益率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去一个月	0.2634%	0.0103%	0.1162%	0.0001%	0.1472%	0.0102%
过去三个月	0.9200%	0.0105%	0.3652%	0.0001%	0.5548%	0.0104%
过去六个月	1.8991%	0.0090%	0.7367%	0.0001%	1.1624%	0.0089%
过去一年	3.5168%	0.0066%	1.4878%	0.0001%	2.0290%	0.0065%
自基金合同 生效起至今	6.1740%	0.0055%	3.0655%	0.0002%	3.1085%	0.0053%

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。

##### 2. 东吴货币 B：

阶段	份额净值收 益率	净值收益率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去一个月	0.2836%	0.0103%	0.1162%	0.0001%	0.1674%	0.0102%
过去三个月	0.9803%	0.0105%	0.3652%	0.0001%	0.6151%	0.0104%
过去六个月	2.0207%	0.0090%	0.7367%	0.0001%	1.2840%	0.0089%
过去一年	3.7667%	0.0066%	1.4878%	0.0001%	2.2789%	0.0065%
自基金合同 生效起至今	6.7229%	0.0055%	3.0655%	0.0002%	3.6574%	0.0053%

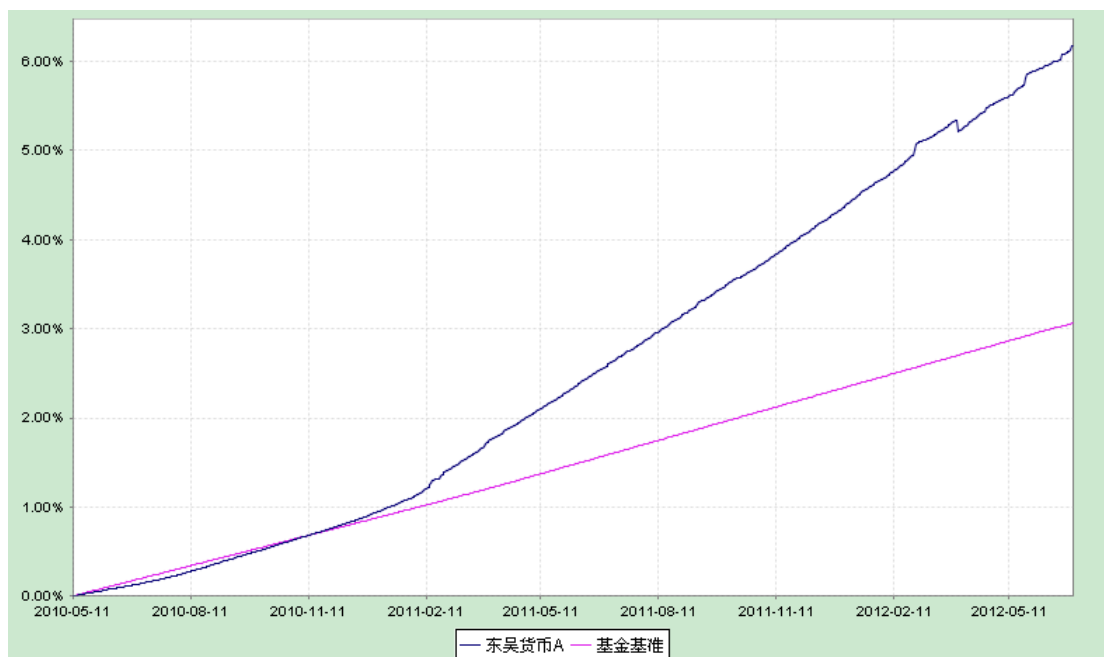
注：1、比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

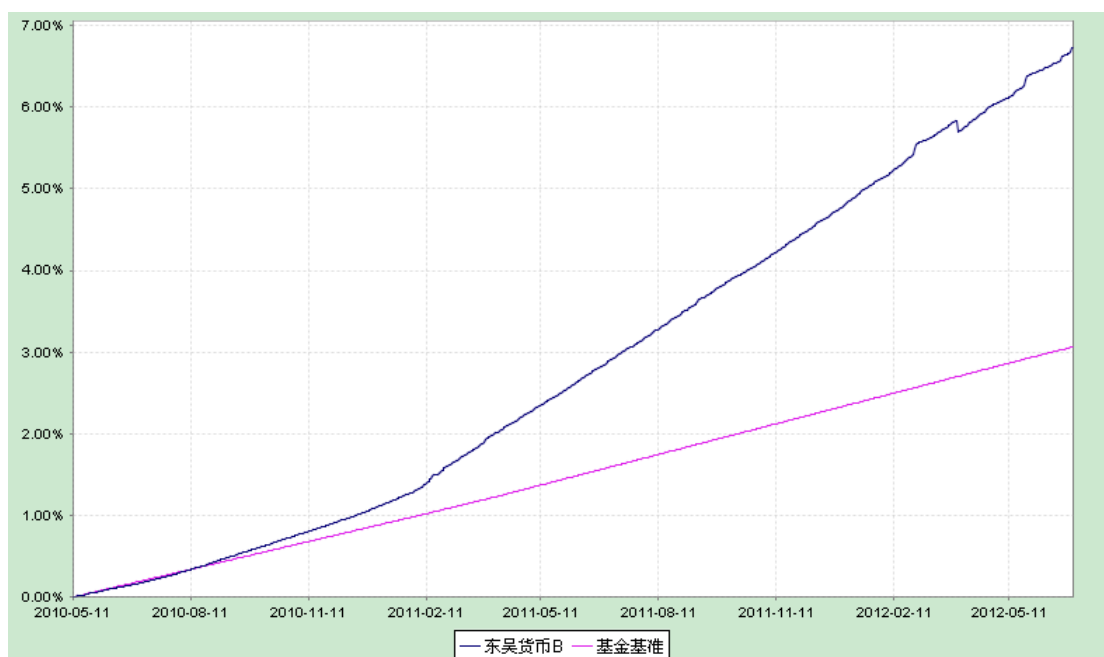
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴货币市场证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2010年5月11日至2012年6月30日)

##### 1、东吴货币 A



## 2、东吴货币 B



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、和而有争、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 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 12 只，其中混合型基金 2 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；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、东吴新产业精选股票型证券投资基金；指数型基金 1 只，为东吴中证新兴产业指数证券投资基金；LOF 基金一只，为东吴深证 100 指数增强型股票投资基金；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 年上半年，上证综指持续下跌，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，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。截至 6 月底，公司基金管理份额 138.01 亿份，资产管理规模 115.53 亿元，较年初有所增长。今年上半年，公司的权益类基金业绩保持稳定，多数股票型基金业绩在同类排名中位于前 1/2 且不乏特色与亮点；公司固定收益类基金业绩则普遍好于往年，以长期稳定的收益获得投资者的青睐。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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	本基金基金经理	2010-05-11	-	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 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来国债、金融债收益率震荡下行，信用产品收益率更是持续回落，整个上半年收益率变动大致经历了从年初由于风险偏好上升债券收益率向上。四月份，银行间市场资金价格一直处于高位，加上 3 月信贷数据反弹以及政策放松预期提高了市场的风险偏好，低评级信用债市场变现较好，与高评级信用利差有所收窄。至五月初降准，收益率出现跳水一样的下行，短端收益率下降尤其剧烈，主要原因还是受益于四月份较差的经济数据，以及资金利率加速下行的配合。六月初的降息再次使得债市收益率大幅下降。

##### 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 1.90%。东吴货币 B 份额净值收益率为 2.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度债券市场，在经济即将局部见底之际，国债、金融债估值优势不明显，中低等级信用债高票息特征使得其持有价值突出，同时在资金面及政策预期波动下，债券市场波段性行情或将频现。资金面对中短期品种也将构成保护。对于未来运作上，将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。

#### 4.7 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 3,579,367.50 元,实际分配收益 3,579,367.50 元;东吴货币 B 级基金应分配收益 4,783,898.85 元,实际分配收益 4,783,898.85 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 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东吴货币市场证券投资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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	79,093,737.48	266,662,535.71
结算备付金	2,318,181.82	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	146,246,142.75	184,718,858.63
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	146,246,142.75	184,718,858.63
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	49,000,273.50	-
应收证券清算款	10,365,219.67	-
应收利息	2,282,325.47	4,560,543.03
应收股利	-	-
应收申购款	1,385,428.43	18,907,125.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	290,691,309.12	474,849,062.74
负 债 和 所 有 者 权 益	本期末 2012 年 6 月 30 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	-	-
卖出回购金融资产款	19,999,850.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	29,866.88	109,479.28
应付管理人报酬	116,760.88	110,025.26
应付托管费	35,382.12	33,340.95
应付销售服务费	62,041.30	21,299.60
应付交易费用	8,896.57	5,492.40

应交税费	-	-
应付利息	6,491.67	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	79,962.49	161,638.46
负债合计	20,339,251.91	441,275.95
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	270,352,057.21	474,407,786.79
未分配利润	-	-
所有者权益合计	270,352,057.21	474,407,786.79
负债和所有者权益总计	290,691,309.12	474,849,062.74

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 270,352,057.21 份。其中东吴货币 A 级的基金份额为 189,727,447.78 份，东吴货币 B 级的基金份额为 80,624,609.43 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>9,981,054.38</b>	<b>30,532,649.75</b>
1.利息收入	8,637,221.85	28,717,359.09
其中：存款利息收入	5,358,754.87	11,086,271.11
债券利息收入	2,740,676.52	13,997,462.91
资产支持证券利息收 入	-	-
买入返售金融资产收入	537,790.46	3,633,625.07
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,343,832.53	1,815,290.66
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,343,832.53	1,815,290.66
资产支持证券投资收 益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	-	-

4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>1,617,788.03</b>	<b>5,519,409.07</b>
1. 管理人报酬	751,687.31	2,377,541.18
2. 托管费	227,784.08	720,467.04
3. 销售服务费	274,839.84	551,829.53
4. 交易费用	80.00	-
5. 利息支出	254,103.89	1,754,495.79
其中：卖出回购金融资产支出	254,103.89	1,754,495.79
6. 其他费用	109,292.91	115,075.53
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>8,363,266.35</b>	<b>25,013,240.68</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>8,363,266.35</b>	<b>25,013,240.68</b>

### 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：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	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)	-	8,363,266.35	8,363,266.35
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)	-204,055,729.58	-	-204,055,729.58
其中：1. 基金申购款	2,848,135,829.71	-	2,848,135,829.71
2. 基金赎回款	-3,052,191,559.29	-	-3,052,191,559.29
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)	-	-8,363,266.35	-8,363,266.35
五、期末所有者权益(基	270,352,057.21	-	270,352,057.21

项目	上年度可比期间		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
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)	-	25,013,240.68	25,013,240.68
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)	102,839,481.75	-	102,839,481.75
其中：1.基金申购款	8,151,736,095.91	-	8,151,736,095.91
2.基金赎回款	-8,048,896,614.16	-	-8,048,896,614.16
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)	-	-25,013,240.68	-25,013,240.68
五、期末所有者权益(基金净值)	873,731,269.51	-	873,731,269.51

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：徐建平，主管会计工作负责人：黄忠平，会计机构负责人：金婕

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则 - 基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、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”）、中国证监会基金部通知[2010]5 号关于发布《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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。

#### 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 差错更正的说明

无。

#### 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[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。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 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。

###### 6.4.8.1.2 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。

###### 6.4.8.1.3 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。

###### 6.4.8.1.4 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6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	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	100.00%

###### 6.4.8.1.5 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。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	751,687.31	2,377,541.18
其中：支付销售机构的客户维护费	187,532.57	550,118.87

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。

###### 6.4.8.2.2 基金托管费



单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	227,784.08	720,467.04

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。

#### 6.4.8.2.3 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	18,753.84	8,269.33	27,023.17
中国农业银行股份有限公司	39,115.59	1,569.39	40,684.98
东吴证券股份有限公司	691.32	0.00	691.32
合计	58,560.75	9,838.72	68,399.47
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	16,250.92	28,826.22	45,077.14
中国农业银行股份有限公司	-	5,139.37	5,139.37
东吴证券股份有限公司	3,570.01	-	3,570.01
合计	19,820.93	33,965.59	53,786.52

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2012年1月1日至2012年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	

-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行 股份有限公司	20,629,743.76	30,188,804.54	-	-	-	-

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金管理人本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

**6.4.8.4.2 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 A**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**东吴货币 B**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	49,093,737.48	262,910.74	9,918,740.11	216,826.66

**6.4.8.6 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。

**6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.9.1 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。

**6.4.9.2 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。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末，本基金银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 19,999,850.00 元，是以如下债券作为抵押的：

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
090205	09国开05	2012-07-05	101.58	200,000	20,315,820.84
合计		-	-	200,000	20,315,820.84

#### 6.4.9.3.2 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。

#### 6.4.10 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	146,246,142.75	50.31
	其中：债券	146,246,142.75	50.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	49,000,273.50	16.86
	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	81,411,919.30	28.01
4	其他各项资产	14,032,973.57	4.83
5	合计	290,691,309.12	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	3.22	
	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	19,999,850.00	7.40
	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。

### 7.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

金额单位：人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2012-3-28	20.12	大额赎回	2012-3-29

### 7.4 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.4.1 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	83
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

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。

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 7.4.2 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	44.99	7.40
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.01	-
2	30 天(含)—60 天	11.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	16.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	16.45	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	33.64	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	106.18	7.40

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，本处的 180 天实际调整为按 120 天予以分段列示。

### 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	55,307,658.31	20.46
	其中：政策性金融债	55,307,658.31	20.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,938,484.44	33.64
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	146,246,142.75	54.09
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	55,307,658.31	20.46

### 7.6 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	090205	09 国开 05	300,000	30,473,731.26	11.27
2	041164012	11 农六师 CP001	200,000	20,372,553.73	7.54
3	110221	11 国开 21	110,000	10,840,724.17	4.01
4	041263001	12 深燃气 CP001	100,000	10,149,056.31	3.75
5	041259004	12 闽能源 CP001	100,000	10,094,659.32	3.73
6	041259017	12 豫光铅 CP001	100,000	10,085,932.64	3.73
7	041174002	11 厦门港 CP002	100,000	10,077,904.46	3.73
8	041257001	12 中化工 CP001	100,000	10,066,642.72	3.72
9	041153010	11 宁交通	100,000	10,054,895.21	3.72

		CP002			
10	041258021	12 皖交投 CP001	100,000	10,036,840.05	3.71

### 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	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%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1644%

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金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 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.9.2 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，其摊余成本总计在交易日超过当日基金资产净值 20%的情况如下：

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	2012-2-29	20.10	大额赎回	2012-3-1
2	2012-6-27	22.27	大额赎回	2012-7-2
3	2012-6-28	20.30	大额赎回	2012-7-2
4	2012-6-29	20.46	大额赎回	2012-7-2

7.9.3 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。

#### 7.9.4 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	10,365,219.67
3	应收利息	2,282,325.47
4	应收申购款	1,385,428.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	14,032,973.57

**7.9.5 其他需说明的重要事项标题**

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	13,676	13,873.02	10,369,504.15	5.47%	179,357,943.63	94.53%
东吴货币 B	8	10,078,076.18	64,121,866.31	79.53%	16,502,743.12	20.47%
合计	13,684	19,756.80	74,491,370.46	27.55%	195,860,686.75	72.45%

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**

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	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	1,474,169,008.93	2,959,186,789.73
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	1,731,086,698.29	1,117,049,131.42
减：本报告期基金总赎回份额	1,628,485,376.69	1,423,706,182.60

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	189,727,447.78	80,624,609.43

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

本报告期内未召开基金份额持有人大会决议。

### 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 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 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为江苏公证天业会计师事务所，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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

本基金本报告期内无新增交易单元。

### 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		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	-	-	890,000,000.00	49.44%	-	-
齐鲁证券	-	-	720,000,000.00	40.00%	-	-
东兴证券	-	-	190,000,000.00	10.56%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

### 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。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十五日