

# 东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十五日

## § 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	39
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	41
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>

12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴增鑫宝货币市场基金	
基金简称	东吴增鑫宝	
基金主代码	003588	
交易代码	003588	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 7 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,878,488,900.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B
下属分级基金的交易代码：	003588	003589
报告期末下属分级基金的份额总额	11,067,110.12 份	5,867,421,790.67 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	朱巍
	联系电话	021-50509888-8308	0571-87659806
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95527
传真		021-50509888-8211	0571-87659965
注册地址		上海浦东源深路 279 号	杭州市庆春路 288 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	杭州市庆春路 288 号
邮政编码		200135	310006

法定代表人	王炯	沈仁康
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	177,354.58	75,860,867.37
本期利润	177,354.58	75,860,867.37
本期净值收益率	1.8958%	2.0171%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	11,067,110.12	5,867,421,790.67
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	2.3212%	2.4786%

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

东吴增鑫宝 A

阶段	份额净值收益率	份额净值收益率标准差	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	0.3378%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.2268%	0.0004%
过去三个月	1.0081%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.6715%	0.0004%
过去六个月	1.8958%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	1.2263%	0.0010%
自基金合同生效起至今	2.3212%	0.0020%	0.8729%	0.0000%	1.4483%	0.0020%

东吴增鑫宝 B

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基	-	-



	收益率	收益率标准差	基准收益率	准收益率标准差		
过去一个月	0.3576%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.2466%	0.0004%
过去三个月	1.0686%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.7320%	0.0004%
过去六个月	2.0171%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	1.3476%	0.0010%
自基金合同生效起至今	2.4786%	0.0020%	0.8729%	0.0000%	1.6057%	0.0020%

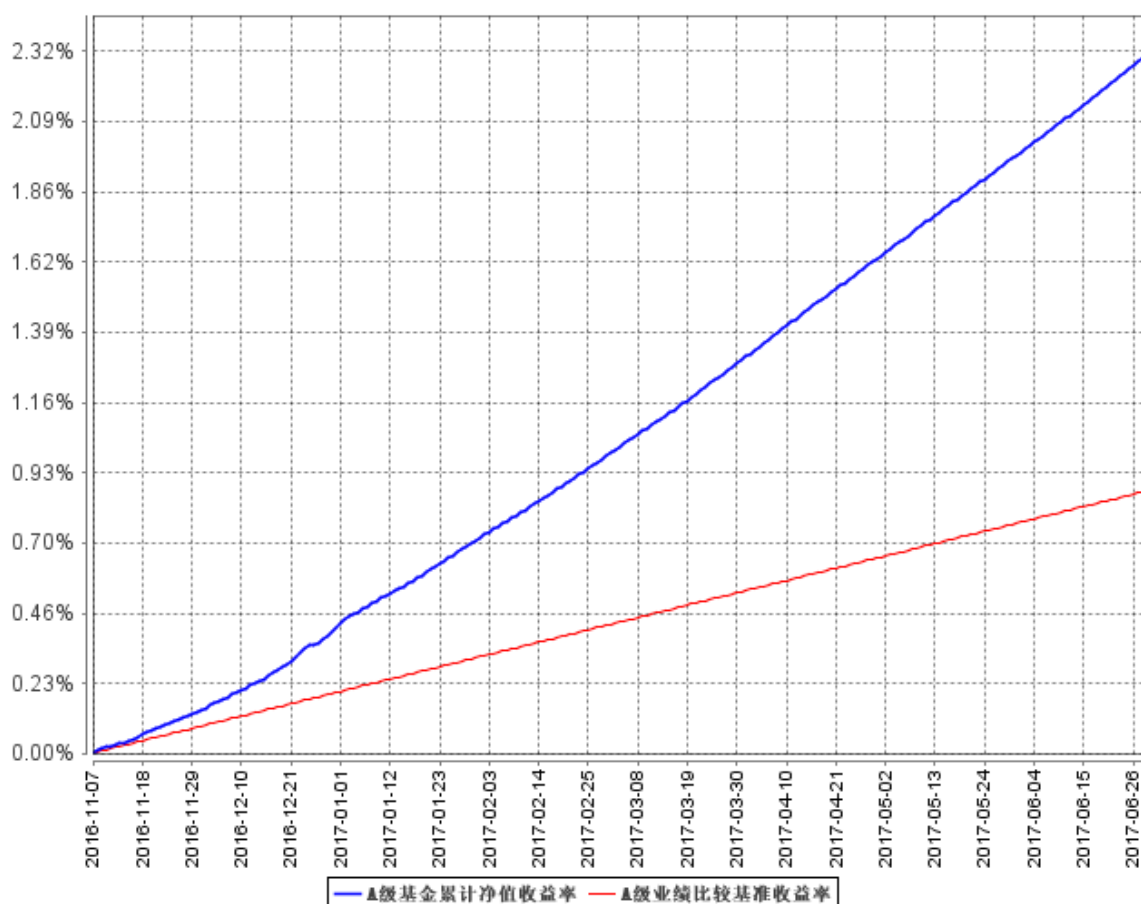
注：1、比较基准=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配按日结转份额。

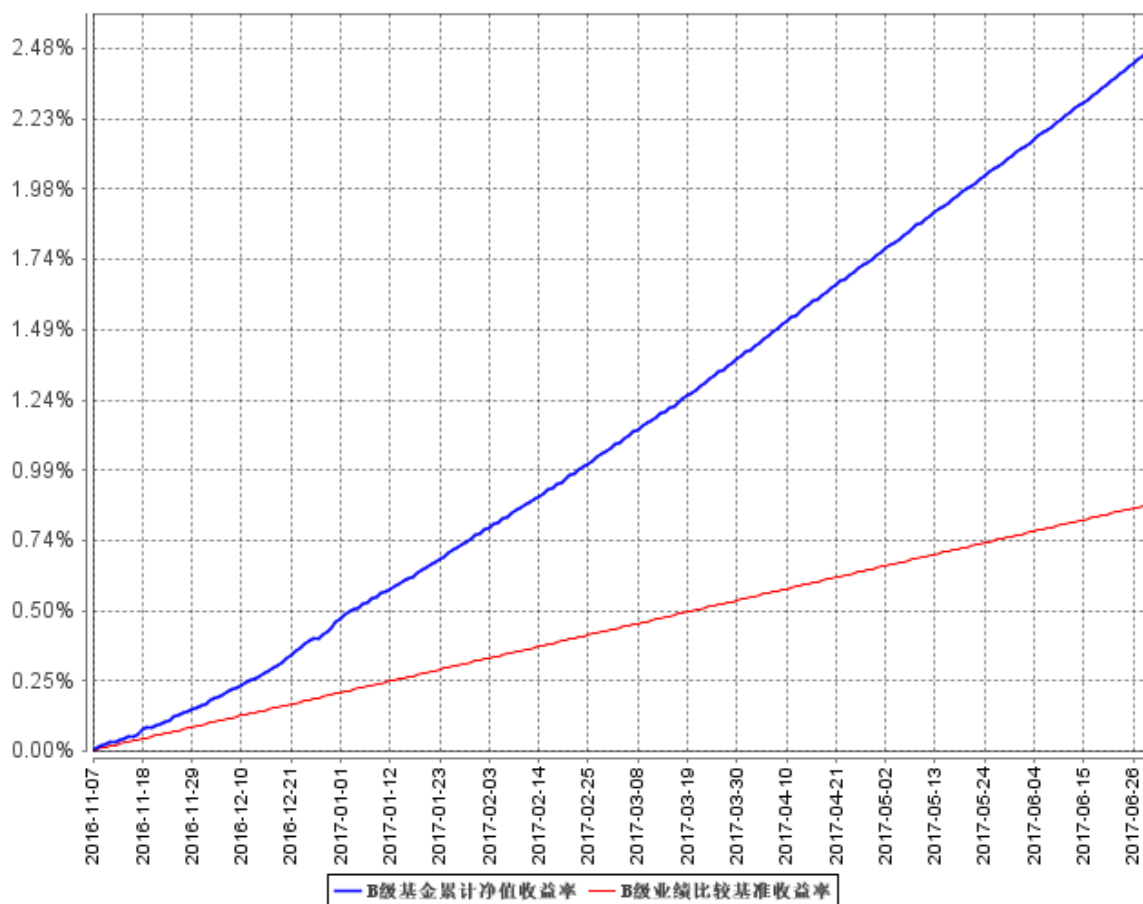
3、本基金于 2016 年 11 月 7 日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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=中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

2、本基金于2016年11月7日成立，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

在泛资管大背景下,公司近年来推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2017 年二季度末,公司整体资产管理规模为 734.06 亿元,其中公募基金 247.63 亿元,专户业务 180.62 亿元,子公司 305.81 亿元;旗下管理着 25 只公募基金,42 只存续专户资产管理计划,88 项存续专项资产管理计划,形成了高中低不同风险层次的多元化产品线。

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的投资风格,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,兼顾收益率和流动性,为大类资产配置提供基础性工具。

尤其是 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,引入了量化投资策略,发行了多只量化公募产品,并在业内率先成立了绝对收益部。

2017 年,公司对投研模块进行了变革,引进了彭敢等公募行业领军人物,投研磨合红利已开始显现,尤其是固定收益投资崭露头角。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示,截至 2017 年二季度末,东吴基金旗下的固定收益类基金以 2.44%的规模加权平均收益,位列 98 家入选基金公司的第六位。

今年以来,公司在固定收益领域获得了多个奖项,比如 2016 年度积极债券型明星基金\*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金\*东吴鼎利债券基金 L0F(东方财富风云榜)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		
陈晨	本基金基金经理	2016年11月7日	-	5.5年	硕士,2011年6月获厦门大学硕士学位。2011年6月至2013年2月就职于华泰(联合)证券研究所任固定收益研究员,自2013年3月起加入东吴基金管理有限公司,一直从事债券投资研究工作,曾任固定收益部研究员、基金经理助理,自2015年6月8日起担任东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)(原东吴鼎利分级债券型证券投资基金)基金经理,自2016年11月7日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。
王文华	本基金基金经理	2016年11月7日	-	10年	南开大学毕业,金融硕士学位。历任中诚信证券评估有限公司信贷评级分析员、联合证券股份有限公司投银行高级项目经理、中诚信证券评估有限公司债券信用评级高级分析师。2012年3月至今就职于东吴基金管理有限公司,曾任固定收益部研究员、基金经理助理,自2014年10月16日起担任东吴增利债券基金基金经理、自2016年11月7日起担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。

注：1、此处的任职日期为基金成立日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

自去年 12 月美联储加息之后，央行分别于 2 月春节后和 3 月中旬上调常备借贷便利利率，货币市场利率上行。4 月中下旬开始，市场对季度末的资金面情况持极度悲观的态度，3 个月的 SHIBOR 进一步走高，6 月中旬达到 4.8%左右，较年初上行了约 150 个 BP。10 年期国债收益率自 2 月初上行至 3.49%之后开始震荡，并于 3 月末再次快速上行，最高达到 3.69%附近。6 月中上旬，央行超量续作到期的 MLF，季末资金面平稳，市场认为监管层对金融去杠杆力度趋缓，货币政策已经由原来的偏紧转为不松不紧。10 年期国债收益率下行最低到 3.49%左右。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东吴增鑫宝 A 份额净值收益率为 1.8958%。东吴增鑫宝 B 份额净值收益率为 2.0171%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际环境来看，下半年美联储有可能进行缩表和进一步加息，而国内房地产等资产价格仍在高位，外储流失及人民币贬值的压力仍在。在国际主流货币逐步收缩的大背景下，国内货币政策大幅宽松的可能性较小。

经济基本面方面，PMI 等景气指数仍在高位，供给侧改革提高了行业集中度，工业企业收入利润状况改善。三四线城市地产销售状况良好，房地产库存处于低位，一定程度上支撑下半年地产投资的平稳。价格方面，自 6 月以来，上游煤炭、钢铁等价格又转而上行，南华工业品价格指数也持续上涨，制约下半年 PPI 等价格指数的下行。

总之，下半年经济预计保持平稳，不存在大幅下行的基础。监管层仍然致力于加强金融监管，防范金融风险。债市机会仍需等待。

#### 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，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、每日支付”的方式，即为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本报告期东吴增鑫宝 A 级基金应分配收益 177,354.58 元，实际分配收益 177,354.58 元；东吴增鑫宝 B 级基金应分配收益 75,860,867.37 元，实际分配收益 75,860,867.37 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东吴增鑫宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，东吴增鑫宝货币市场基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴增鑫宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：东吴增鑫宝货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,564,582,353.34	495,695,179.97
结算备付金		-	1,033,450.72
存出保证金		768.04	2,320.09
交易性金融资产	6.4.7.2	1,134,570,697.06	41,955,178.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,134,570,697.06	41,955,178.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,261,787,732.68	301,275,531.93
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	18,237,493.20	1,826,499.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,979,179,044.32	841,788,160.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		98,799,830.60	4,979,872.53
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	88,870.05
应付管理人报酬		1,233,371.35	72,826.95
应付托管费		493,348.55	29,130.78
应付销售服务费		51,398.58	3,159.73
应付交易费用	6.4.7.7	25,739.24	5,295.39



应交税费		-	-
应付利息		8,177.01	964.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,278.20	4,500.00
负债合计		100,690,143.53	5,184,619.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	5,878,488,900.79	836,603,540.87
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		5,878,488,900.79	836,603,540.87
负债和所有者权益总计		5,979,179,044.32	841,788,160.54

注：1.本基金于 2016 年 11 月 7 日成立。

2.报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,878,488,900.79 份。其中东吴增鑫宝 A 级的基金份额为 11,067,110.12 份，东吴增鑫宝 B 级的基金份额为 5,867,421,790.67 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		82,933,202.26	-
1.利息收入		82,863,916.19	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,752,065.96	-
债券利息收入		13,051,043.18	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,060,807.05	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		69,286.07	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	69,286.07	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	-	-

“-”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)	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		6,894,980.31	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,488,538.44	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,795,415.39	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	190,572.53	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		334,275.75	-
其中：卖出回购金融资产支出		334,275.75	-
6. 其他费用	6.4.7.19	86,178.20	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		76,038,221.95	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		76,038,221.95	-

注：本基金于 2016 年 11 月 7 日成立。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东吴增鑫宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	836,603,540.87	-	836,603,540.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	76,038,221.95	76,038,221.95
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)	5,041,885,359.92	-	5,041,885,359.92
其中：1. 基金申购款	9,461,162,001.24	-	9,461,162,001.24
2. 基金赎回款	-4,419,276,641.32	-	-4,419,276,641.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-76,038,221.95	-76,038,221.95

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	5,878,488,900.79	-	5,878,488,900.79
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金于 2016 年 11 月 7 日成立。

报表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：

\_\_\_\_\_ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东吴增鑫宝货币市场基金（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[2016]2292 号文《关于准予东吴增鑫宝货币市场基金注册的批复》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 2016 年 10 月 18 日正式生效，首次设立募集规模为 272,508,411.43 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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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》、《东吴增鑫宝货币市场基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，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：中国人民银行公布的七天通知存款利率（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》、《东吴增鑫宝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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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。

### 6.4.4.4 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。

### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付；
- (4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- (5) 本基金每日进行收益计算并分配时，收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)

额)方式,投资人可通过赎回基金份额获得现金收益;若投资人在收益支付时,其累计收益为正值,则为投资人增加相应的基金份额,其累计收益为负值,则缩减投资人基金份额;

(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个工作日起,不享有基金的收益分配权益;

(7) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 6.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外,一般采用历史成本计量。

##### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起,采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值,根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技

术确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 1、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管



产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	582,353.34
定期存款	3,564,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	3,564,000,000.00
其他存款	-
合计：	3,564,582,353.34

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	240,185.34	239,112.00	-1,073.34	0.0000%
	银行间市场	1,134,330,511.72	1,134,823,000.00	492,488.28	0.0084%
	合计	1,134,570,697.06	1,135,062,112.00	491,414.94	0.0084%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_银行间	1,261,787,732.68	-
合计	1,261,787,732.68	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	205.12
应收定期存款利息	14,096,432.30
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,761,084.18
应收买入返售证券利息	1,379,771.30
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.30
合计	18,237,493.20

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	25,739.24
合计	25,739.24

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	78,278.20
合计	78,278.20

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴增鑫宝 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,586,786.38	5,586,786.38
本期申购	16,677,798.13	16,677,798.13
本期赎回(以“-”号填列)	-11,197,474.39	-11,197,474.39
- 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	11,067,110.12	11,067,110.12

金额单位：人民币元

东吴增鑫宝 B		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	831,016,754.49	831,016,754.49
本期申购	9,444,484,203.11	9,444,484,203.11
本期赎回(以“-”号填列)	-4,408,079,166.93	-4,408,079,166.93
- 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	5,867,421,790.67	5,867,421,790.67

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

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东吴增鑫宝 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	177,354.58	-	177,354.58
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	-177,354.58	-	-177,354.58
本期末	-	-	-

单位：人民币元

东吴增鑫宝 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	75,860,867.37	-	75,860,867.37
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	-75,860,867.37	-	-75,860,867.37
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	24,745.81
定期存款利息收入	57,724,468.27
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,833.92
其他	17.96
合计	57,752,065.96

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期末未进行股票投资。

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,674,985,587.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,661,625,538.71
减：应收利息总额	13,290,762.37
买卖债券差价收入	69,286.07

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末未进行权证投资。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期无股利收入。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
其他费用	400.00
帐户维护费	16,353.84
合计	86,178.20

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	6,822,004.64	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	449,793,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付的关联方佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付	4,488,538.44	-

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	1,056.37	-

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.25%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：日基金管理费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,795,415.39	-

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

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B	合计
东吴基金管理有限公司	10,636.21	178,791.67	189,427.88
浙商银行股份有限公司	153.56	-	153.56
东吴证券股份有限公司	14.34	-	14.34
合计	10,804.11	178,791.67	189,595.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B	合计
-	-	-	-

注：东吴增鑫宝 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；东吴增鑫宝 B 级基金份额的销售服务费按前一日该级基金资产净值 0.01%的年费率计提；各级基金份额的销售服务费逐日累计至每月月底，按月支付。



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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017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
浙商银行股份有限公司	10,340,942.19	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期间基金管理人未持有本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
浙商银行股份有限公司	582,353.34	24,745.81	-	-

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

## 东吴增鑫宝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
177,354.58	-	-	177,354.58	-

## 东吴增鑫宝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
75,860,867.37	-	-	75,860,867.37	-

## 6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时性停牌而流通受限的股票。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 98,799,830.60 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111709229	17 浦发银行 CD229	2017 年 7 月 3 日	99.00	1,000,000	98,997,683.74
合计				1,000,000	98,997,683.74

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理及量化分析，为投资者提供稳定的收益。

本基金结合宏观与微观、定性与定量分析，根据国内外宏观经济形势及经济金融政策趋势等因素的分析，对货币市场基金允许投资的金融工具，从收益率、流动性、风险、久期等角度入手，辅以敏感性分析及金融工程技术，进行综合分析，在严格控制风险的前提下，采取积极主动的投资管理，满足投资者对于高流动性和低风险投资的需求。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的部分银行存款存放于本基金的托管行-浙商银行股份有限公司，部分定期存款存放在具有托管资格的光大银行股份有限公司及民生银行股份有限公司等。本基金认为与银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃

而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日一般不超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

除卖出回购金融资产按余额计息外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	687,582,353.34	2,284,000,000.00	593,000,000.00	-	-	-	3,564,582,353.34

结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	768.04	-	-	-	-	-	768.04
交易性金融资产	479,336,567.92	655,234,129.14	-	-	-	-	1,134,570,697.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,261,787,732.68	-	-	-	-	-	1,261,787,732.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	18,237,493.20	18,237,493.20
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,428,707,421.98	2,939,234,129.14	593,000,000.00	-	-	18,237,493.20	5,979,179,044.32
负债							
卖出回购证券款	98,799,830.60	-	-	-	-	-	98,799,830.60
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,233,371.35	1,233,371.35
应付托管费	-	-	-	-	-	493,348.55	493,348.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,398.58	51,398.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,739.24	25,739.24
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	8,177.01	8,177.01
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	78,278.20	78,278.20
负债总计	98,799,830.60	-	-	-	-	1,890,312.93	100,690,143.53
利率敏感度缺口	2,329,907,591.38	2,939,234,129.14	593,000,000.00	-	-	16,347,180.27	5,878,488,900.79
上年度末 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	397,695,179.97	98,000,000.00	-	-	-	-	495,695,179.97
清算备付金	1,033,450.72	-	-	-	-	-	1,033,450.72
存出保证金	2,320.09	-	-	-	-	-	2,320.09
交易性金融资产	9,994,804.27	14,933,386.80	17,026,987.21	-	-	-	41,955,178.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	301,275,531.93	-	-	-	-	-	301,275,531.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,826,499.55	1,826,499.55
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	710,001,286.98	112,933,386.80	17,026,987.21	-	-	1,826,499.55	841,788,160.54
负债							

卖出回购证券款	4,979,872.53	-	-	-	-	-	4,979,872.53
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	88,870.05	88,870.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,826.95	72,826.95
应付托管费	-	-	-	-	-	29,130.78	29,130.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,159.73	3,159.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,295.39	5,295.39
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	964.24	964.24
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	4,500.00	4,500.00
负债总计	4,979,872.53	-	-	-	-	204,747.14	5,184,619.67
利率敏感度缺口	705,021,414.45	112,933,386.80	17,026,987.21	-	-	1,621,752.41	836,603,540.87

注：表中所示为本基金资产及负债的利率风险敞口，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	32,581.36	25,557.47
	利率上升 25 个基点	-32,495.77	-25,467.65

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

## § 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	1,134,570,697.06	18.98
	其中:债券	1,134,570,697.06	18.98
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,261,787,732.68	21.10
	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	3,564,582,353.34	59.62
4	其他各项资产	18,238,261.24	0.31
5	合计	5,979,179,044.32	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	1.01	
	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	98,799,830.60	1.68
	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

注:本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	52

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	11

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	41.32	1.68
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	32.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	5.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.40	1.68

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。

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	260,122,923.30	4.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,022,905.59	0.85
	其中：政策性金融债	50,022,905.59	0.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-



7	同业存单	824,424,868.17	14.02
8	其他	-	-
9	合计	1,134,570,697.06	19.30
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	179915	17 贴现国债 15	1,400,000	139,955,338.65	2.38
2	111780365	17 盛京银行 CD135	1,000,000	99,653,613.27	1.70
3	111709199	17 浦发银行 CD199	1,000,000	99,323,834.27	1.69
4	111720091	17 广发银行 CD091	1,000,000	99,291,019.92	1.69
5	111798465	17 包商银行 CD074	1,000,000	99,282,098.36	1.69
6	111709229	17 浦发银行 CD229	1,000,000	98,997,683.74	1.68
7	111780302	17 中原银行 CD143	1,000,000	98,903,360.50	1.68
8	179916	17 贴现国债 16	800,000	79,943,532.50	1.36
9	111795402	17 宁夏银行 CD027	500,000	49,937,386.70	0.85
10	111795977	17 四川天府银行 CD054	500,000	49,900,717.08	0.85

### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0092%
报告期内偏离度的最低值	-0.0094%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0034%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 元。

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

### 7.9.2

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

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	768.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	18,237,493.20
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	18,238,261.24

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数(户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
东吴 增鑫 宝 A	272	40,687.90	8,312,217.18	75.11%	2,754,892.94	24.89%
东吴 增鑫 宝 B	16	366,713,861.92	5,867,421,790.67	100.00%	-	-
合计	288	20,411,419.79	5,875,734,007.85	99.95%	2,754,892.94	0.05%

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	东吴增鑫宝 A	47,907.20	0.4329%
	东吴增鑫宝 B	-	-
	合计	47,907.20	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：高级管理人员、基金投资和研发部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东吴增鑫宝 A	东吴增鑫宝 B
基金合同生效日（2016 年 11 月 7 日）基金份额总额	485,372.37	272,001,240.00
本报告期期初基金份额总额	5,586,786.38	831,016,754.49
本报告期基金总申购份额	16,677,798.13	9,444,484,203.11
减：本报告期基金总赎回份额	11,197,474.39	4,408,079,166.93
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	11,067,110.12	5,867,421,790.67

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、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

本基金本报告期内无相关诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 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

本基金本报告期内基金管理人、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	
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

本基金本报告期无新增或退租席位。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	6,822,004.64	100.00%	449,793,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过0.5%（含）以上的情况。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东吴基金管理有限公司管理的基金 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）	2017 年 1 月 3 日
2	东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年春节假期前暂停（大额）申购和转换转入业务公告	证券时报、公司网站	2017 年 1 月 23 日
3	东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年清明假期前暂停（大额）申购和转换转入业务公告	证券时报、公司网站	2017 年 3 月 28 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰金融服务（深圳）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）	2017 年 4 月 12 日
5	东吴基金管理有限公司关于参加奕丰金融服务（深圳）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）	2017 年 4 月 12 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增宜信普泽投资顾问	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	2017 年 4 月 14 日

	(北京)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	(巨潮资讯网)	
7	东吴基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问(北京)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)	2017年4月14日
8	东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2017年4月24日
9	东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年劳动假期前暂停(大额)申购和转换转入业务公告	证券时报、公司网站	2017年4月25日
10	东吴增鑫宝货币市场基金 2017 年端午假期前暂停(大额)申购和转换转入业务公告	证券时报、公司网站	2017年5月23日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构的公告	证券时报、公司网站	2017年5月26日
12	东吴增鑫宝货币市场基金更新招募说明书以及摘要	证券时报、公司网站	2017年6月20日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170317-20170630	0.00	5,000,000,000.00	1,168,074,810.00	3,881,460,312.12	66.03
	2	20170101-20170112	500,069,206.13	0.00	500,635,691.16	0.00	0.00
	3	20170113-20170118	0.00	150,000,000.00	150,081,195.71	0.00	0.00
	4	20170209-20170214	0.00	200,000,000.00	202,975,146.68	0.00	0.00
	5	20170215-20170316	0.00	500,000,000.00	200,000,000.00	307,785,307.53	5.24
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

如开放期内上述持有人集中大额赎回，极端情况下本基金可能存在一定的流动性风险以及收益波动等情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴增鑫宝货币市场基金设立的文件；
- 2、《东吴增鑫宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《东吴增鑫宝货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴增鑫宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2017年8月25日