

# 东吴增鑫宝货币市场基金

## 更新招募说明书摘要

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

### 重要提示

本基金根据 2016 年 10 月 9 日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴增鑫宝货币市场基金募集的批复》（证监基金字【2016】2292 号）的注册募集,本基金的基金合同于 2016 年 11 月 7 日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《东吴增鑫宝货币市场基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险等等。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。

基金投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并自行承担投资风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2017 年 5 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

- 1.名称：东吴基金管理有限公司
- 2.住所：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)
- 3.办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)
- 4.法定代表人：王炯
- 5.成立日期：2004 年 9 月 2 日
- 6.批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号
- 7.组织形式：有限责任公司（国内合资）
- 8.注册资本：1 亿元人民币
- 9.联系人：贾云鹏
- 10.电话：(021) 50509888
- 11.传真：(021) 50509884
- 12.客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666
- 13.公司网址：www.scfund.com.cn
- 14.股权结构：

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	7000	70%
上海兰生（集团）有限公司	3000	30%
合计	10,000	100%

## 15. 简要情况介绍:

公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司总经理下设风险控制、投资决策、风险管理、产品开发、专户投资五个专门委员会；公司设有固定收益部、绝对收益部、权益投资部、深圳业务总部、专户业务事业部、研究策划部、集中交易室、机构业务部、渠道业务部、金融同业部、营销管理部、苏州分公司、产品策略部、基金事务部、信息技术部、财务管理部、综合管理部、合规风控部共 18 个部门。

### (二) 主要人员情况

#### 1、董事会成员

范力先生，董事长，硕士，高级经济师，中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长，苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理；东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、公司副总裁、常务副总裁；东吴证券股份有限公司党委副书记、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

陈辉峰先生，副董事长，大学学历，高级国际商务师，中共党员。历任上海轻工国际（集团）有限公司五金分公司总经理、上海轻工国际发展有限公司副总经理、上海兰生股份有限公司常务副总经理、总经理、上海兰生（集团）有限公司营运管理部总经理。现任上海东浩兰生国际服务贸易（集团）有限公司投资发展部总经理。

王炯先生，董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长，现任东吴证券股份有限公司副总裁、总规划师兼资产管理总部总经理。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

倪雪梅女士，董事，大学本科，高级会计师，中共党员。历任浙江省嘉兴市审计局工交审计科科员，上海上工会计师事务所项目经理，上海万隆会计师事务所有限公司高级项目经理、合伙人，上海市国际展览有限公司财务部经理。现任上海东浩兰生国际贸

易服务有限公司计财部副总经理。自 2016 年 12 月 28 日起在公司第二届董事会任职。

贝政新先生，独立董事，大学，教授，博士生导师。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

陈如奇先生，独立董事，大专学历，中共党员，高级经济师。历任新疆人民银行巴州中心支行科员，新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长，交通银行上海分行处长、副行长，交通银行广州分行行长，交通银行香港分行总经理等职。

## 2、监事会成员

顾锡康先生，监事会主席，硕士学位，高级工程师、经济师，中共党员。历任苏州电子计算机厂工程师、室主任，苏州人民银行科技科硬件组组长，苏州证券电脑中心经理、技术总监，东吴证券技术总监兼信息技术总部总经理，东吴证券股份有限公司合规总监、监事会主席。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵，员工监事，本科，学士学位，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，合规风控部总经理，现任东吴基金管理有限公司合规副总监兼合规风控部总经理。

## 3、高管人员

范力先生，董事长，硕士，高级经济师，中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长，苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理；东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、公司副总裁、常务副总裁；东吴证券股份有限公司党委副书记、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

王炯先生，总经理，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

徐军女士，督察长，大学，会计师、审计师，中共党员。历任苏州市审计局财政、金融审计处科员、副处长，东吴证券财务部总经理，东吴基金管理有限公司财务负责人、

公司总裁助理等职务，现任东吴基金管理有限公司督察长。

吕晖先生，副总经理，大专，历任苏州商业大厦业务员，苏州证券公司交易员，苏州证券登记公司总经理助理，东吴证券资产管理总部副总经理，东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理，东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监等职，现任东吴基金管理有限公司副总经理。

#### 4、基金经理

王文华，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师、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。

陈晨，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。

历任基金经理 无

#### 5、投资决策委员会成员

王 炯 公司总经理；

杨庆定 固定收益部总经理；

刘元海 绝对收益部总经理；

戴 斌 权益投资部副总经理；

王立立 权益投资部副总经理兼研究策划部副总经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基金托管人概况

名称：浙商银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路288号

法定代表人：沈仁康

电话：0571-88269636

传真：0571-88268688

联系人：林彬

成立时间：1993年4月16日

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2013]1519号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。经国家外汇管理局批准，可以经营结汇、售汇业务。

“浙商银行”是经中国银监会批准设立的全国性股份制商业银行，全称为“浙商银行股份有限公司”，英文全称为“CHINA ZHESHANG BANK CO., LTD.”，英文简称“CZBANK”。浙商银行前身为“浙江商业银行”，是一家于1993年在宁波成立的中外合资银行，2004年6月30日，经中国银监会批准，重组、更名、迁址，改制为现在的浙商银行，并于2004年8月18日正式开业，总行设在浙江省杭州市。2016年3月30日，浙商银行在港上市，股票代码为（02016.HK）。

截至2016年12月31日，资产总额13548.55亿元，较上年末增长31.33%，全年实现营业收入336.53亿元，同比增长33.91%，2016年实现净利润101.53亿元，同比增长44.00%。在英国《银行家》杂志2016年公布的“全球银行业1000强”榜单中按总资产位列第117位，2015年中诚信国际给予浙商银行金融机构评级中最高等级AAA主体信用评级。目前，浙商银行已在北京、天津、辽宁、上海、江苏、山东、湖北、广东、重庆、四川、陕西、甘肃等12个省市和浙江省内全部省辖市设立（筹建）了约150家机构，实现了对长三角、环渤海、珠三角以及部分中西部地区的有效覆盖，同时，积极推进香港分行筹建，加快国际化布局步伐。

## （二）主要人员情况

沈仁康先生，男，1963年1月出生，中共党员，硕士研究生学历。历任浙江省丽水市青田县县委常委、副县长，县委副书记、代县长、县长；丽水市副市长，期间兼任丽

水经济开发区管委会党工委书记，并同时担任丽水市委常委；丽水市委副书记，期间兼任市委政法委书记；浙江省衢州市市委副书记、代市长、市长。现任浙商银行股份有限公司党委书记、董事长、执行董事。

刘晓春先生，男，1959年3月出生，中共党员，大学本科学历，高级经济师。历任中国农业银行浙江省分行金融研究所《浙江农村金融研究》编辑部副主任、国际业务部信贷科科长、国际业务部信贷部经理、营业部副总经理、国际业务部总经理，中国农业银行总行国际业务部副总经理，中国农业银行浙江省分行党委委员、副行长，中国农业银行香港分行副总经理、总经理。现任浙商银行行长、党委副书记、副董事长、执行董事。

### （三）基金托管业务经营情况

浙商银行于2013年11月13日中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2013]1519号。

截至2016年年末，公募基金托管产品11个，规模合计200.47亿元，且目前已经与多家公募基金管理公司达成托管合作意向。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

浙商银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### （三）内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作、顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 1、直销机构

(1) 东吴基金管理有限公司直销中心

名称：东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

直销电话：(021) 50509880

传真：(021) 50509884



客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

网站：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

## （2）网上交易

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

## 2. 代销机构：

### （1）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：（0574）89068340

传真：（0574）87050024

客服电话：96528，上海地区 962528

公司网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

### （2）浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号

办公地址：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：唐燕

电话：0571-87659056

传真：0571-87659054

客服热线：95527

公司网址：[www.czbank.com/](http://www.czbank.com/)

### （3）苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市东吴北路 143 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

联系人：项喻楠

电话：0512-69868389

传真：0512-69868370

客服热线：96067

公司网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

(4) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 邮编：100088

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045529

客服电话：010-66045678

传真：010-66045518

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(5) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于杨

电话：021-20835779

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

(6) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38600735

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

(7) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：张玉静

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(8) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(9) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服热线：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(10) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司  
注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室  
办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层  
法定代表人：张跃伟  
联系人：敖玲  
电话：021-58788678-8201  
传真：021—58787698  
客服电话：400-089-1289  
公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(11) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室  
办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼  
法定代表人：凌顺平  
联系人：杨翼  
电话：0571-88911818 转 8565  
传真：0571—86800423  
客服热线：4008-773-772  
公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(12) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室  
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼  
法定代表人：沈继伟  
联系人：徐鹏  
电话：86-021-50583533  
传真：86-021-50583633  
网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务中心电话：400-067-6266

(13) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室  
办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

联系人：来舒岚

电话：0571-88337888

传真：0571-88337666

客服热线：400-068-0058

公司网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

（14）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

传真：010-85894285

客服热线：400-6099-200

公司网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

（15）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

联系人：祖杰

电话：010-57756159

传真：010-57756199

客服热线：4008980618

公司网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

（16）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服热线：400-619-9059

公司网址：<http://www.fundzone.cn>

(17) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：宋志强

电话：131 2013 1908

传真：010-5817 0840

客服热线：400-818-8866

公司网址：[www.gscaifu.com](http://www.gscaifu.com)

(18) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312885

客服热线：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com>

(19) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

电话：15311484311

传真：010-57569671

客服热线：4008936885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(20) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20F

法定代表人：陈刚

联系人：胡璇

电话：0571-85267500

传真：0571-85269200

客服热线：0571-86655920

公司网址：[www.codi121.com](http://www.codi121.com)

(21) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服热线：400-821-0203

(22) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

(23) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：021-333323830

客服热线：4008202819

公司网址：<http://www.chinapnr.com/>

(24) 北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室

法定代表人：梁洪军

联系人：季长军

电话：010-52609656

传真：010-51957430

客服热线：400-819-6665

公司网址：[www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

(25) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济  
发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：俞申莉

电话：021-65370077-209

传真：021-55085991

客服热线：021-65370077

公司网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(26) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇



电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人邮箱：NINGBOYU657@pingan.com.cn

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（27）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电话：18616752315

传真：021-22268089

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.com/>

（28）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室（邮编：510308）

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629021

传真：020-89629011

联系人邮箱：wuyuhao@yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

（29）奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115-1116室及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服热线：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（30）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-60833754

传真：010-57762999

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（31）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务热线：95521

（32）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝内大街188号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：(010) 65183880

传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(33) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 层

法定代表人：何如

联系人：周扬

电话：0755-821308333066

传真：0755-82133952302

客服电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(34) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服热线：95558

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(35) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008-888-888

公司网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(36) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

联系人: 金芸、李笑鸣

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

客服电话: 021-95553

公司网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(37) 申万宏源证券有限公司

英文名称: Shenwan Hongyuan Securities Co., Ltd.

注册资本: 人民币 330 亿元

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 (邮编: 200031)

法定代表人: 李梅

电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

客服电话: 95523 或 4008895523

电话委托: 021-962505

国际互联网网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人: 黄莹

(38) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福建省福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址: 浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人: 兰荣

联系人: 谢高得

电话: 021-38565785

传真: 021-38565955

客服电话: 400-8888-123

公司网址：[www.xyzq.com](http://www.xyzq.com)

(39) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(40) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(41) 万联证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

电话：020-38286588

传真：020-38286588

客服热线：4008888133

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(42) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

（43）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（44）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

（45）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（46）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（47）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100，021-53686200

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

（48）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：400 888 5288

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(49) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

公司网址：[www.PINGAN.com](http://www.PINGAN.com)

(50) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客服电话：0551-96518 或者 4008096518

公司网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(51) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服电话：0731-84403350

公司网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

(52) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层



办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（53）申万宏源（西部）证券有限公司

英文名称：Shenwan Hongyuan Securities (Western) Co., Ltd.

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼  
2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005  
室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195 客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

联系人：李巍

（54）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（55）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

公司网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

（56）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服热线：40018-40028

公司网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

（57）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 单元

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

注册资本：16 亿元人民币

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

邮政编码：200030

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967202

传真电话：021-54967293

华鑫证券公司网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

（58）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-8202 3442

传真：0755-8202 6539

客服热线：400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

（59）国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服热线：95310

公司网址：www.gjqz.com.cn

（60）华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：021-20515589

传真：021-20515593

客服电话：4008209898

3. 基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

**（二）注册登记机构：东吴基金管理有限公司**

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

网站：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

### （三）出具法律意见书的 律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：天衡会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：南京市建邺区江东中路 106 号万达商务楼 B 座 20 楼

办公地址：南京市建邺区江东中路 106 号万达商务楼 B 座 19 楼

法定代表人：余瑞玉

联系人：魏娜

经办注册会计师：谈建忠、魏娜

电话：025-84711188

传真：025-84716883

## 四、基金的名称

本基金名称：东吴增鑫宝货币市场基金

## 五、基金的类型

本基金类型：货币市场型基金

## 六、基金的投资目标

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。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

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。

### （一）资产配置策略

本基金将通过分析宏观经济发展态势、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析，形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上，本基金将根据不同类别资产的收益率水平（不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性），结合各类资产的流动性特征（成交活跃度、发行规模）和风险特征（信用等级、波动性），决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。

### （二）利率品种的投资策略

本基金对利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，结合利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化，据此确定组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，选择合适的期限结构配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

### （三）信用品种的投资策略

本基金根据基金管理人的“内部信用评级体系”，从市场上公开发行的信用债券中筛选投资备选券，形成信用债券投资备选库。从信用债券投资备选库中，本基金管理人结合本基金的投资与配置需要，通过分析比较到期收益率、剩余期限、流动性等特征，挑选适当的信用债券进行投资。

#### （四）资产支持证券投资策略

本基金将综合运用定性方法和定量方法，基本面分析和数量化模型相结合，对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析，并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

#### （五）债券回购投资策略

在有效控制风险的前提下，本基金将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。同时，密切关注央行公开市场操作、季节因素、日历效应、IPO 发行等因素导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。

#### （六）其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪衍生产品等其他金融工具的动向。当监管机构允许基金参与其他金融工具的投资，本基金将按照届时生效的法律法规，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

## 九、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）。

## 十、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。

## 十一、基金投资组合报告

东吴增鑫宝货币市场基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及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责任。

本基金的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4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2017年3月31日(未经审计)。

#### 1、报告期末基金资产组合情况:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	991,892,130.96	19.89
	其中:债券	991,892,130.96	19.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	515,212,092.82	10.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,466,083,034.29	69.52
8	其他资产	12,473,164.35	0.25
9	合计	4,985,660,422.42	100.00

#### 2、报告期债券回购融资情况

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	1.30	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

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。

#### 3、基金投资组合平均剩余期限

##### 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	74
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 个交易日日内调整。

#### 3.2 报告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	22.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	19.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	14.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	29.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	14.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.77	-

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。

#### 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。

#### 5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	20,160,992.26	0.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	309,979,934.43	6.22
	其中：政策性金融债	309,979,934.43	6.22
4	企业债券	6,759,872.94	0.14
5	企业短期融资券	9,973,057.70	0.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	645,018,273.63	12.94



8	其他	-	-
9	合计	991,892,130.96	19.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 6、报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	160414	16 农发 14	2,350,000	234,971,664.29	4.71
2	111712019	17 北京银行 CD019	1,000,000	99,500,691.30	2.00
3	111794968	17 天津银行 CD048	1,000,000	98,878,589.22	1.98
4	111794934	17 大连银行 CD046	1,000,000	98,878,490.30	1.98
5	111794263	17 锦州银行 CD073	500,000	49,870,294.53	1.00
6	111794698	17 杭州银行 CD086	500,000	49,826,161.18	1.00
7	111708019	17 中信银行 CD019	500,000	49,773,583.51	1.00
8	111707079	17 招商银行 CD079	500,000	49,605,934.02	1.00
9	111794177	17 邯郸银行 CD036	500,000	49,490,566.09	0.99
10	111794863	17 盛京银行 CD050	500,000	49,451,484.09	0.99

## 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	0.0090%
报告期内偏离度的最低值	-0.0094%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0030%

**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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 9、投资组合报告附注

### 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。

### 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。

### 9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,351.54
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,470,812.81
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,473,164.35

### 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。

## 十二、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

(1) 东吴增鑫宝货币市场基金历史时间段净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较

### 东吴增鑫宝 A

时间	净值收 益率①	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
2016.11.07-2016.12.31	0.4175%	0.0028%	0.2034%	0.0000%	0.2141%	0.0028%

2017.01.01-2017.03.31	0.8789%	0.0009%	0.3329%	0.0000%	0.5460%	0.0009%
2016.11.07-2017.03.31	1.3000%	0.0021%	0.5363%	0.0000%	0.7637%	0.0021%

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，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期。

东吴增鑫宝B

时间	净值收 益率①	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
2016.11.07-2016.12.31	0.4524%	0.0028%	0.2034%	0.0000%	0.2490%	0.0028%
2017.01.01-2017.03.31	0.9385%	0.0009%	0.3329%	0.0000%	0.6056%	0.0009%
2016.11.07-2017.03.31	1.3951%	0.0022%	0.5363%	0.0000%	0.8588%	0.0022%

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）。

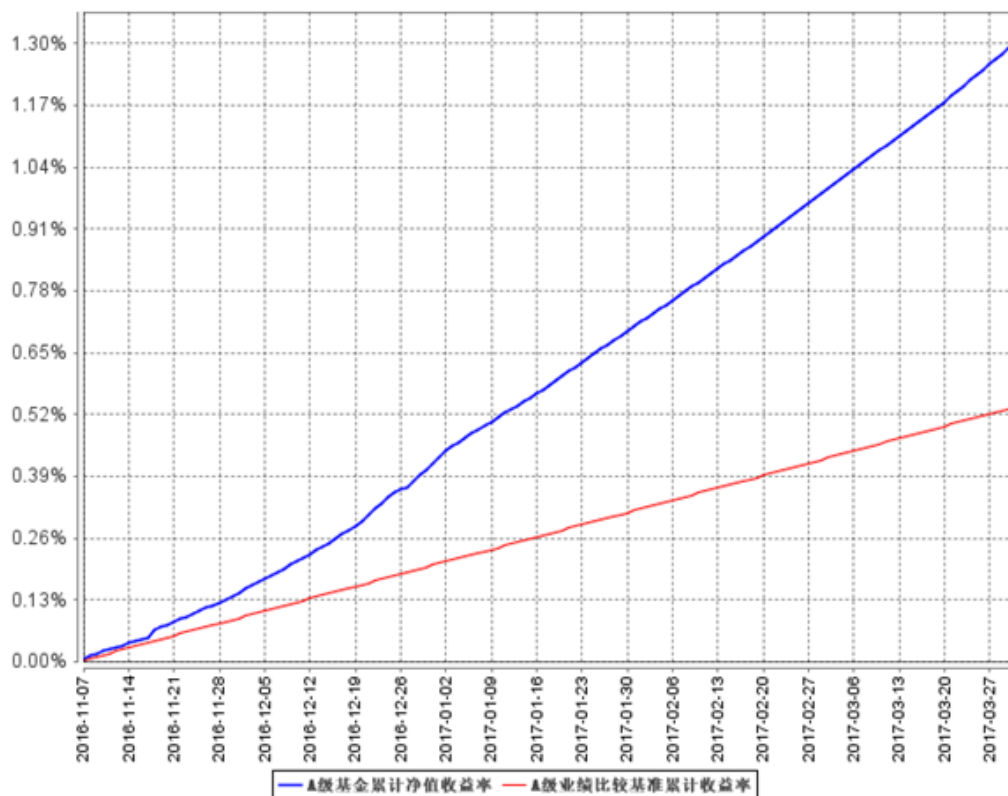
2、本基金收益分配按日结转份额。

3、本基金于2016年11月7日成立，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期。

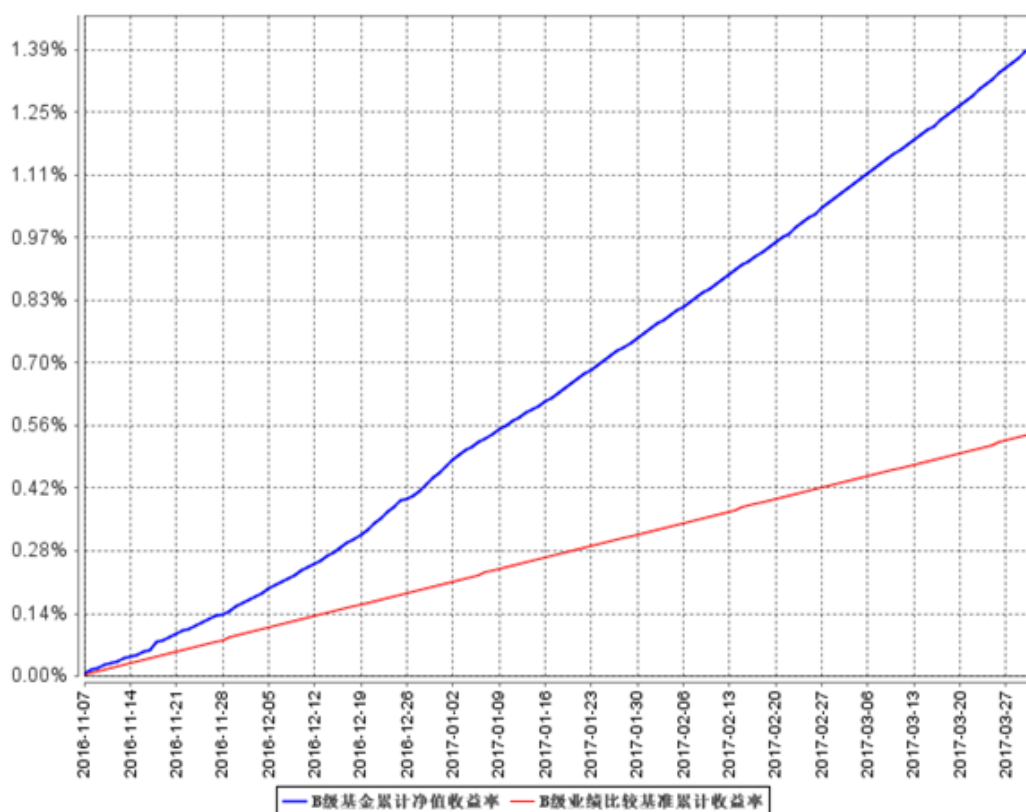
(2) 自基金合同生效以来基金累计净值收益率及其与同期业绩基准收益率变动的比较

(2016年11月7日至2017年3月31日)

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，截至本报告期末成立不满六个月，尚处于建仓期。

### 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 1 基金转换业务的适用范围

本基金已开通与本基金管理人旗下基金：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(基金代码：580001)、东吴价值成长双动力混合型证券投资基金(基金代码：580002)、东吴行业轮动混合型证券投资基金(基金代码：580003)、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金(基金代码：580005)、东吴新经济混合型证券投资基金(基金代码：580006)、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：580007)、东吴新产

业精选混合型证券投资基金(基金代码: 580008)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金(基金代码: 585001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A(基金代码: 582001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C(基金代码: 582201)、东吴增利债券型证券投资基金 A(基金代码: 582002)、东吴增利债券型证券投资基金 C(基金代码: 582202)、东吴货币市场证券投资基金 A(基金代码: 583001)、东吴货币市场证券投资基金 B(基金代码: 583101)、东吴配置优化混合型证券投资基金(基金代码: 582003)、东吴内需增长混合型证券投资基金(基金代码: 580009)、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 000531)、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 A(基金代码: 001323)、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 001322)、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002159)、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002270)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金 A(基金代码: 000958)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金 C(基金代码: 000959)、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002561)、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码: 002919)、东吴增鑫宝货币市场基金 A(基金代码: 003588)、东吴增鑫宝货币市场基金 B(基金代码: 003589) 的基金转换业务。

基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务, 并将另行公告。

## 2. 开通转换的销售机构

投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务:

宁波银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、宜信普泽投资顾问(北京)有限公司北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海万得投资顾问有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、北京微动利投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、大泰金石投资管理有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、奕丰金融服务(深圳)有限公司中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、

申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、申万宏源（西部）证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司。根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

## 十四、费用概览

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费；

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

- 2、基金托管人的托管费；

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如

下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 级降级为 A 级的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类基金份额条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。A、B 两类基金份额销售服务费的计算方法相同，具体如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金登记机构，由给基金登记机构代付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”中，更新了相关内容。
- 2、在“三、基金管理人”中，更新了基金管理人及主要人员情况等内容。
- 3、在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人及主要人员情况等内容。
- 4、在“五、相关服务机构”中，更新了相关内容。
- 5、在“七、基金的募集”中，更新了相关内容。
- 6、在“九、基金份额的申购与赎回”中，更新了相关内容。
- 7、在“十、基金的投资”中，更新了相关内容。
- 8、在“十一、基金的业绩”中，更新了相关内容。
- 9、在“二十三、其他应披露事项”中，增加了其他披露事项：

（1）2016年10月25日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金份额发售公告》；

（2）2016年10月25日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金基金合同内容摘要》；

（3）2016年10月25日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金招募说明书》；

（4）2016年10月25日在公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金托管协议》；

（5）2016年10月25日在公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金基金基金合同》；

（6）2016年10月28日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙商银行股份有限公司为代销机构的公告》；

（7）2016年10月28日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴增鑫宝货币市场基金增加代销机构的公告》；



(8) 2016年10月28日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(9) 2016年11月02日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴增鑫宝货币市场基金增加代销机构的公告》；

(10) 2016年11月08日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金基金合同生效公告》；

(11) 2016年11月14日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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期定额业务及转换业务的公告》；

(12) 2016年11月14日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(13) 2016年11月18日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于东吴增鑫宝货币市场基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》；

(14) 2016年11月21日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(15) 2016年12月07日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(16) 2016年12月07日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(17) 2016年12月07日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(18) 2016年12月16日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《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》；

(19) 2016年12月16日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《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》；

(20) 2016年12月31日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(21) 2017年01月03日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(22) 2017年01月23日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《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》；

(23) 2017年03月28日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《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》；

(24) 2017年04月12日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(25) 2017年04月12日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(26) 2017年04月14日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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（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》；

(27) 2017年04月14日在中国证券报、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）等媒体上公告了《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》；

(28) 2017年04月24日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴增鑫宝货币市场基金2017年第1季度报告》；

(29) 2017年04月25日在证券时报、公司网站等媒体上公告了《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》；

## 十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2017年6月20日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一七年六月二十日