

东吴中证可转换债券指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十七日

§ 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 24 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 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.....	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52

§12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴中证可转换债券指数证券投资基金
基金简称	东吴中证可转债指数
基金主代码	165809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 12 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,132,614.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为债券指数基金，对指数投资部分，采用优化复制标的指数的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	李帅帅
	联系电话	021-50509888-8308	0755-25878287

电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	95511-3
传真	021-50509888-8211	0755-82080387
注册地址	上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼 901、902 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	上海浦东新区银城路 117 号 瑞明大厦 9 楼	深圳市福田区益田路 5023 号平安 金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	邓晖	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	312,585.74
本期利润	149,445.97
加权平均基金份额本期利润	0.0290
本期加权平均净值利润率	2.66%
本期基金份额净值增长率	1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-2,621,346.34
期末可供分配基金份额利润	-0.6343
期末基金资产净值	4,574,962.48
期末基金份额净值	1.1070
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.34%

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。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

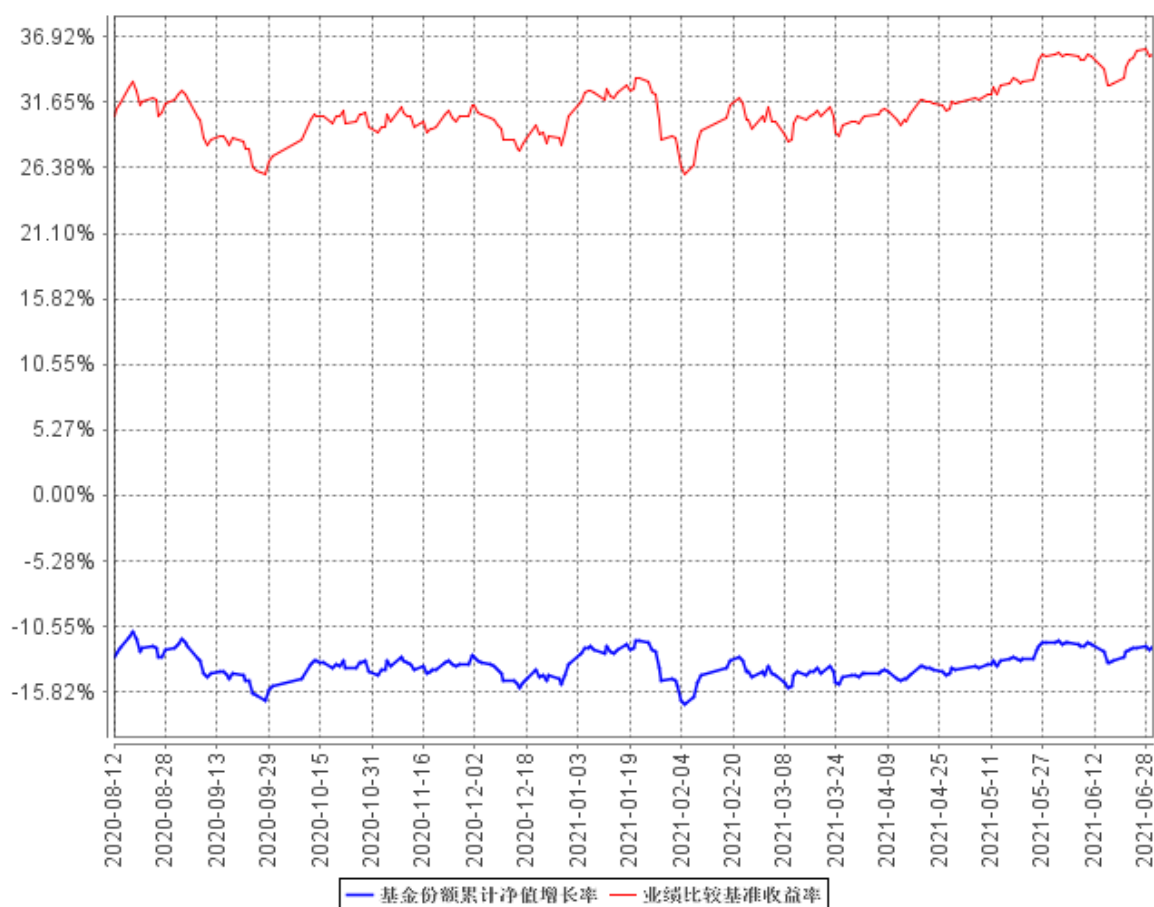
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.35%	0.33%	-0.02%	0.37%	-0.33%	-0.04%
过去三个月	2.84%	0.31%	4.24%	0.32%	-1.40%	-0.01%
过去六个月	1.71%	0.49%	3.85%	0.49%	-2.14%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.34%	0.50%	3.20%	0.49%	-2.86%	0.01%

注：1、本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%。

2、本基金转型日为2020年8月12日。

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

2、本基金转型日为 2020 年 8 月 12 日

§ 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银城路 117 号瑞明大厦 901、902 室。目前由东吴证券股份有限公司和海澜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。

公司自成立以来,始终坚守“待人忠、办事诚、共享共赢”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,公司积极推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,构建了涵盖股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、REITS 等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,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 2021 年半年度,公司整体资产管理规模为 399.71 亿元,其中公募基金 261.93 亿元,专户业务 128.82 亿元,子公司 8.96 亿元;旗下管理着 28 只公募基金,40 只存续专户资产管理计划,12 项存续专项资产管理计划。

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		
王文华	基金经理	2019 年 12 月 24 日	-	13 年	王文华女士,中国国籍,南开大学经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职中诚信证券评估有限公司高级分析师;联合证券股份有限公司投资银行高级经理。2012 年 3 月起加入东吴基金管理有限公司,现任基金经理。2014 年 10 月 15 日至 2020 年 7 月 17 日担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理,2016 年 11 月 7 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,2018 年 4 月 11 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金

					经理，2019 年 12 月 24 日至今担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金（原东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金）基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期为公司对外公告日，王文华自 2021 年 7 月 2 日起不再担任该基金基金经理，自 2021 年 7 月 2 日起由邵笛担任该基金基金经理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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权限、研究管理、投资决策制度、投资备选库管理制度和集中交易制度，以保障各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会，并落实交易执行环节公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行交易指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，尽可能确保公平对待各投资组合，保证公平交易制度的执行和实现。

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，开展对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，未发现投资组合之间存在不公平交易现象。

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。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

上半年国内经济持续恢复，稳中向好，GDP 同比增长 12.7%，二季度好于一季度。国外疫情反

复，国内出口数据持续好于市场预期，固定资产投资同比增长 12.6%，居民消费稳步回升。CPI 表现温和，上半年同比上涨 0.5%，但受大宗商品走强影响，PPI 平均上涨 5.1%，引发市场对于通胀风险的担忧。货币政策相对稳定，保持不急转弯，央行也通过一定措施打破市场对资金面过于乐观的预期，提前预防风险。

债券市场上半年呈现先抑后扬的走势，一月份的资金面超预期紧张，将债券收益率全面推高，10 年国债上行 13bp，3 月期存单收益率由低点上行 65bp，1 年期上行 25bp。此后，经过近一个月的震荡，相对宽松的政策环境和较低的风险偏好推动债市进入慢牛，长债收益率下行 17bp，存单利率也回到 1 月中旬的低位附近。上半年信用分化现象显著，信用评级下调数量明显增多，城投及地产行业债券投资谨慎氛围较浓，信用风险引发市场忧虑。经过 1 月份的波动后，市场流动性持续保持宽松，回购利率在政策引导下相对平稳。

上半年可转债市场继续扩容，二月初中证转债指数出现大幅调整，此后震荡抬升，创近几年新高，新能源汽车、光伏等板块表现活跃。

本基金在报告期内，严控投资组合信用风险，做好指数跟踪，进行优化配置，实现基金平稳健康运行，努力为基金持有人获取合理收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1070 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.71%，业绩比较基准收益率为 3.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然有来自外部和自身的压力，我国经济表现出足够的增长韧性，展望下半年，虽然有地产调控和出口不确定性的约束，预计经济可能不会有大幅波动。货币政策方面大概率将坚持以我为主，保持灵活应对，积极对冲各项负面冲击。预计下半年债券供给有望有所增加，通胀风险可能依然存在，信用风险是无法回避的因素，债券市场将跟随经济金融数据表现不断调整方向，可能表现为震荡行情，转债市场依然可能存在结构化差异。

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，成员由分管运营副总经理、督察长、投研部门（包括但不限于研究策划部、权益投资部、固定收益部、专户投资总部）负责人、合规风控部负责人、产品策

略部负责人、基金事务部负责人等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主任，基金事务部负责人担任基金资产估值委员会秘书。同时，基金资产估值委员会主任指定的其他人员可以列席会议。

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。投研部门相关业务人员负责在基金资产估值委员会要求下提供相关分析及数量模型构建及修改的建议；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，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

本基金本报告期末进行利润分配。

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

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会。本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。2021 年 7 月 27 日本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金自 2021 年 7 月 29 日起进入清算程序。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：东吴中证可转换债券指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,764,598.59	58,238.70
结算备付金		7,876.27	11,974.09
存出保证金		801.91	3,223.12
交易性金融资产	6.4.7.2	4,867,832.38	9,613,758.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,867,832.38	9,613,758.60
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	-	-
应收证券清算款		-	78,568.53
应收利息	6.4.7.5	16,120.13	30,792.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	6,649.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,657,229.28	9,803,205.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	111,291.95
应付赎回款		6,030,777.57	23,309.99
应付管理人报酬		2,104.41	3,311.21
应付托管费		526.12	827.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		54.97	71.84

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	48,803.73	73,006.95
负债合计		6,082,266.80	211,819.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,210,642.90	11,111,186.97
未分配利润	6.4.7.10	-635,680.42	-1,519,801.65
所有者权益合计		4,574,962.48	9,591,385.32
负债和所有者权益总计		10,657,229.28	9,803,205.08

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1070 元，基金份额总额 4,132,614.12 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴中证可转换债券指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		237,977.03
1.利息收入		19,505.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	640.52
债券利息收入		18,865.04
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		370,720.25
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	370,720.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
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“-”号填列）	6.4.7.16	-163,139.77
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	10,890.99
减：二、费用		88,531.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,183.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,795.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-

4. 交易费用	6.4.7.18	110.53
5. 利息支出		617.14
其中：卖出回购金融资产支出		617.14
6. 税金及附加		20.82
7. 其他费用	6.4.7.19	73,803.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		149,445.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		149,445.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴中证可转换债券指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	11,111,186.97	-1,519,801.65	9,591,385.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	149,445.97	149,445.97
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）	-5,900,544.07	734,675.26	-5,165,868.81
其中：1.基金申购款	7,015,412.91	-887,111.06	6,128,301.85
2.基金赎回款	-12,915,956.98	1,621,786.32	-11,294,170.66
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）	5,210,642.90	-635,680.42	4,574,962.48

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：

邓晖

基金管理人负责人

徐明

主管会计工作负责人

骆银

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴中证可转换债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型而来，原东吴中证可转换债券指数分级证券投资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[2013]1471号《关于核准东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2014年5月9日正式生效，首次设立募集规模为268,064,983.90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为东吴基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会于2020年7月13日审议并通过《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，同意东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型为东吴中证可转换债券指数证券投资基金。根据《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，自2020年8月12日起，《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效，原《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券及其备选成份券、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债（含分离交易可转债）、地方政府债、政府机构债、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证，须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。

本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公

开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 半年度的经营成果和净值变动情况。

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 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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,764,598.59
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	5,764,598.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,828,811.69	39,020.69
	银行间市场	-	-
	合计	4,828,811.69	39,020.69
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,828,811.69	4,867,832.38	39,020.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	366.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3.15
应收债券利息	15,749.88
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.36
合计	16,120.13

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.42
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	25,000.00
应付审计费	23,803.31
合计	48,803.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,812,174.86	11,111,186.97
本期申购	5,563,713.54	7,015,412.91
本期赎回(以“-”号填列)	-10,243,274.28	-12,915,956.98
- 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	4,132,614.12	5,210,642.90

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,020,291.48	4,500,489.83	-1,519,801.65
本期利润	312,585.74	-163,139.77	149,445.97
本期基金份额交易产生的变动数	3,086,359.40	-2,351,684.14	734,675.26
其中：基金申购款	-3,539,594.97	2,652,483.91	-887,111.06
基金赎回款	6,625,954.37	-5,004,168.05	1,621,786.32
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,621,346.34	1,985,665.92	-635,680.42
-----	---------------	--------------	-------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	588.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	42.83
其他	9.39
合计	640.52

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	370,720.25
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	370,720.25

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,829,723.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,434,310.60
减：应收利息总额	24,692.82
买卖债券差价收入	370,720.25

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-163,139.77
——股票投资	-
——债券投资	-163,139.77
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-163,139.77

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,890.99
基金转换费收入	-
合计	10,890.99

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	110.53
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	110.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	50,000.00
合计	73,803.31

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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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、基金销售机构
平安银行股份有限公司	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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	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	8,342,380.53	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 2021年1月1日至2021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
东吴证券股份有限公司	2,730,000.00	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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,183.35
其中：支付销售机构的客户维护费	2,018.79

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算, 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,795.91

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算, 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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	5,764,598.59	588.30

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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暂时停牌等流通受限股票。

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 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖

出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型指数证券投资基金，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券及其备选成份券、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债（含分离交易可转债）、地方政府债、政府机构债、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证，须在达到可交易状态日起 10 个交易日内卖出。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。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。

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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金基金合同约定投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。另外，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；本基金管理人建立了交易对手审批制度，并定期对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	278,000.00	549,780.00
合计	278,000.00	549,780.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	2,290,613.40	4,522,180.10
AAA 以下	2,299,218.98	4,541,798.50
未评级	-	-
合计	4,589,832.38	9,063,978.60

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规，制定了《东吴基金管理有限公司开放式基金流动性风险管理办法》，建立了开放式基金流动性风险管理的内部控制体系。本基金管理人严格遵守相关要求，开展压力测试，对流动性风险量化指标开展监测和分析。针对被动超标的情形，开展每日监控与提示，保持投资组合整体良好的流动性，切实维护基金份额持有人的利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

在本报告期内，未发生流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	5,764,598.59	-	-	-	-	-	5,764,598.59

结算备付金	7,876.27	-	-	-	-	-	7,876.27
存出保证金	801.91	-	-	-	-	-	801.91
交易性金融资产	278,000.00	-	44,308.70	2,394,310.89	2,151,212.79	-	4,867,832.38
应收利息	-	-	-	-	-	16,120.13	16,120.13
资产总计	6,051,276.77	-	44,308.70	2,394,310.89	2,151,212.79	16,120.13	10,657,229.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,030,777.57	6,030,777.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,104.41	2,104.41
应付托管费	-	-	-	-	-	526.12	526.12
应交税费	-	-	-	-	-	54.97	54.97
其他负债	-	-	-	-	-	48,803.73	48,803.73
负债总计	-	-	-	-	-	6,082,266.80	6,082,266.80
利率敏感度缺口	6,051,276.77	-	44,308.70	2,394,310.89	2,151,212.79	-6,066,146.67	4,574,962.48
上年度末 2020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	58,238.70	-	-	-	-	-	58,238.70
结算备付金	11,974.09	-	-	-	-	-	11,974.09
存出保证金	3,223.12	-	-	-	-	-	3,223.12
交易性金融资产	-	549,780.00	42,148.00	5,387,831.67	3,633,998.93	-	9,613,758.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	78,568.53	78,568.53
应收利息	-	-	-	-	-	30,792.40	30,792.40
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	9.95	-	-	-	-	6,639.69	6,649.64
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	73,445.86	549,780.00	42,148.00	5,387,831.67	3,633,998.93	116,000.62	9,803,205.08
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	111,291.95	111,291.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	23,309.99	23,309.99
应付管理人	-	-	-	-	-	3,311.21	3,311.21

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	827.82	827.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-	71.84	71.84
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	73,006.95	73,006.95
负债总计	-	-	-	-	-	211,819.76	211,819.76
利率敏感度缺口	73,445.86	549,780.00	42,148.00	5,387,831.67	3,633,998.93	-95,819.14	9,591,385.32

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	基准利率减少 25 个基点	50,654.23	102,172.40
基准利率增加 25 个基点	-49,934.88	-100,714.09	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金主要投资于证券交易所上市的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，并且本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。于 2021 年 6 月 30 日，本基金主要投资于证券交易所交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,867,832.38	45.68
	其中：债券	4,867,832.38	45.68
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	5,772,474.86	54.16
8	其他各项资产	16,922.04	0.16
9	合计	10,657,229.28	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	278,000.00	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,589,832.38	100.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,867,832.38	106.40

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	3,430	351,334.90	7.68
2	113021	中信转债	2,810	296,651.70	6.48
3	019640	20 国债 10	2,780	278,000.00	6.08
4	113044	大秦转债	2,260	232,576.60	5.08
5	113011	光大转债	1,700	196,486.00	4.29

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	801.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,120.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,922.04

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	351,334.90	7.68
2	113021	中信转债	296,651.70	6.48
3	113044	大秦转债	232,576.60	5.08
4	113011	光大转债	196,486.00	4.29
5	110053	苏银转债	171,117.60	3.74
6	110075	南航转债	137,636.80	3.01
7	110073	国投转债	62,471.80	1.37
8	113026	核能转债	60,266.10	1.32
9	113013	国君转债	57,533.10	1.26
10	127005	长证转债	42,170.40	0.92
11	127012	招路转债	39,601.10	0.87
12	128129	青农转债	39,538.20	0.86
13	110061	川投转债	37,987.10	0.83
14	113037	紫银转债	34,046.10	0.74
15	110051	中天转债	33,300.70	0.73

16	127020	中金转债	30,716.00	0.67
17	113043	财通转债	29,873.20	0.65
18	128136	立讯转债	26,196.80	0.57
19	128081	海亮转债	26,153.30	0.57
20	110048	福能转债	25,380.20	0.55
21	110043	无锡转债	24,789.60	0.54
22	110062	烽火转债	24,476.60	0.54
23	113611	福 20 转债	24,092.60	0.53
24	113014	林洋转债	23,848.00	0.52
25	110067	华安转债	22,558.20	0.49
26	113024	核建转债	22,543.40	0.49
27	127025	冀东转债	22,463.70	0.49
28	128095	恩捷转债	21,637.20	0.47
29	113009	广汽转债	20,856.30	0.46
30	113508	新凤转债	20,769.60	0.45
31	127027	靖远转债	20,008.00	0.44
32	110047	山鹰转债	19,833.90	0.43
33	128048	张行转债	19,728.00	0.43
34	128107	交科转债	19,540.80	0.43
35	113034	滨化转债	19,010.20	0.42
36	128134	鸿路转债	18,904.20	0.41
37	128035	大族转债	18,802.00	0.41
38	127022	恒逸转债	18,420.00	0.40
39	127006	敖东转债	18,264.60	0.40
40	113602	景 20 转债	17,815.50	0.39
41	128108	蓝帆转债	16,835.00	0.37
42	110063	鹰 19 转债	16,518.60	0.36
43	128109	楚江转债	16,483.60	0.36
44	128034	江银转债	15,780.00	0.34
45	113040	星宇转债	15,583.70	0.34
46	110068	龙净转债	15,096.00	0.33
47	110077	洪城转债	14,948.70	0.33
48	110076	华海转债	14,905.80	0.33
49	128114	正邦转债	14,795.20	0.32
50	110041	蒙电转债	14,750.40	0.32
51	128032	双环转债	14,105.70	0.31
52	113605	大参转债	13,864.80	0.30
53	110057	现代转债	13,417.20	0.29
54	110056	亨通转债	13,360.10	0.29
55	113615	金诚转债	13,161.60	0.29
56	113033	利群转债	13,026.00	0.28

57	128131	崇达转 2	12,850.00	0.28
58	113607	伟 20 转债	12,733.60	0.28
59	127024	盈峰转债	12,101.10	0.26
60	127016	鲁泰转债	12,000.00	0.26
61	110034	九州转债	11,906.40	0.26
62	110064	建工转债	11,846.40	0.26
63	113017	吉视转债	11,714.40	0.26
64	110033	国贸转债	11,546.00	0.25
65	113039	嘉泽转债	11,451.00	0.25
66	128135	洽洽转债	11,420.00	0.25
67	128029	太阳转债	11,368.70	0.25
68	128046	利尔转债	11,147.20	0.24
69	110052	贵广转债	11,133.10	0.24
70	128141	旺能转债	11,004.00	0.24
71	127011	中鼎转 2	10,912.50	0.24
72	113516	苏农转债	10,595.00	0.23
73	127017	万青转债	10,076.40	0.22
74	113596	城地转债	10,034.20	0.22
75	128140	润建转债	9,932.40	0.22
76	128026	众兴转债	9,592.80	0.21
77	123077	汉得转债	9,217.80	0.20
78	128130	景兴转债	9,160.29	0.20
79	127007	湖广转债	9,153.69	0.20
80	128127	文科转债	8,832.60	0.19
81	127015	希望转债	8,707.20	0.19
82	113614	健 20 转债	8,672.30	0.19
83	123035	利德转债	8,658.30	0.19
84	123049	维尔转债	8,628.80	0.19
85	123083	朗新转债	8,600.90	0.19
86	113563	柳药转债	8,578.40	0.19
87	123078	飞凯转债	8,547.70	0.19
88	128119	龙大转债	8,407.00	0.18
89	128083	新北转债	8,271.20	0.18
90	123067	斯莱转债	8,212.50	0.18
91	128017	金禾转债	8,165.50	0.18
92	128142	新乳转债	8,153.60	0.18
93	128078	太极转债	8,071.00	0.18
94	123076	强力转债	8,069.60	0.18
95	128093	百川转债	8,067.60	0.18
96	113603	东缆转债	7,982.80	0.17
97	113609	永安转债	7,949.90	0.17

98	113504	艾华转债	7,845.50	0.17
99	123086	海兰转债	7,756.00	0.17
100	110066	盛屯转债	7,719.00	0.17
101	128133	奇正转债	7,696.50	0.17
102	123068	弘信转债	7,603.40	0.17
103	128105	长集转债	7,583.80	0.17
104	123070	鹏辉转债	7,577.40	0.17
105	128121	宏川转债	7,555.80	0.17
106	128037	岩土转债	7,520.10	0.16
107	128063	未来转债	7,399.70	0.16
108	128057	博彦转债	7,389.60	0.16
109	113549	白电转债	7,373.80	0.16
110	127013	创维转债	7,367.50	0.16
111	128124	科华转债	7,357.00	0.16
112	113505	杭电转债	7,298.20	0.16
113	123054	思特转债	7,198.80	0.16
114	113530	大丰转债	7,173.60	0.16
115	123064	万孚转债	7,038.00	0.15
116	123050	聚飞转债	6,956.40	0.15
117	113600	新星转债	6,922.30	0.15
118	128113	比音转债	6,876.80	0.15
119	123063	大禹转债	6,804.00	0.15
120	128132	交建转债	6,722.10	0.15
121	113589	天创转债	6,647.20	0.15
122	123087	明电转债	6,598.80	0.14
123	123007	道氏转债	6,567.60	0.14
124	110060	天路转债	6,502.80	0.14
125	123079	运达转债	6,493.00	0.14
126	127026	超声转债	6,459.00	0.14
127	113599	嘉友转债	6,442.20	0.14
128	110071	湖盐转债	6,427.20	0.14
129	123053	宝通转债	6,417.00	0.14
130	128137	洁美转债	6,389.50	0.14
131	127019	国城转债	6,378.40	0.14
132	110038	济川转债	6,298.20	0.14
133	113606	荣泰转债	6,260.00	0.14
134	113591	胜达转债	6,243.60	0.14
135	123091	长海转债	6,154.00	0.13
136	128096	奥瑞转债	6,137.50	0.13
137	113036	宁建转债	6,081.60	0.13
138	113535	大业转债	6,060.00	0.13

139	128075	远东转债	5,906.00	0.13
140	128074	游族转债	5,824.50	0.13
141	113569	科达转债	5,820.00	0.13
142	123071	天能转债	5,815.50	0.13
143	113528	长城转债	5,783.00	0.13
144	127014	北方转债	5,593.00	0.12
145	128106	华统转债	5,573.50	0.12
146	113542	好客转债	5,428.00	0.12
147	128042	凯中转债	5,366.50	0.12
148	123081	精研转债	5,366.00	0.12
149	113604	多伦转债	5,262.50	0.12
150	123059	银信转债	5,261.50	0.12
151	123033	金力转债	5,218.80	0.11
152	123060	苏试转债	5,192.00	0.11
153	123056	雪榕转债	5,172.00	0.11
154	128066	亚泰转债	5,165.00	0.11
155	128138	侨银转债	5,125.00	0.11
156	128116	瑞达转债	5,065.00	0.11
157	123010	博世转债	5,036.50	0.11
158	113612	永冠转债	5,031.20	0.11
159	113012	骆驼转债	5,016.80	0.11
160	113532	海环转债	5,010.00	0.11
161	128139	祥鑫转债	5,005.50	0.11
162	113584	家悦转债	4,925.50	0.11
163	128101	联创转债	4,895.20	0.11
164	113579	健友转债	4,804.80	0.11
165	123090	三诺转债	4,762.00	0.10
166	123066	赛意转债	4,642.50	0.10
167	123069	金诺转债	4,641.60	0.10
168	123073	同和转债	4,603.20	0.10
169	128018	时达转债	4,565.20	0.10
170	113568	新春转债	4,555.20	0.10
171	128082	华锋转债	4,537.60	0.10
172	123074	隆利转债	4,459.60	0.10
173	123082	北陆转债	4,429.20	0.10
174	113030	东风转债	4,411.20	0.10
175	113525	台华转债	4,411.20	0.10
176	128090	汽模转 2	4,393.60	0.10
177	113593	沪工转债	4,388.00	0.10
178	113598	法兰转债	4,315.60	0.09
179	113610	灵康转债	4,314.80	0.09

180	113588	润达转债	4,314.00	0.09
181	113597	佳力转债	4,298.00	0.09
182	128071	合兴转债	4,259.20	0.09
183	123025	精测转债	4,241.70	0.09
184	113585	寿仙转债	4,232.40	0.09
185	128069	华森转债	4,223.20	0.09
186	123011	德尔转债	4,201.60	0.09
187	128014	永东转债	4,187.20	0.09
188	123044	红相转债	4,186.80	0.09
189	127021	特发转 2	4,150.40	0.09
190	128049	华源转债	4,092.40	0.09
191	128123	国光转债	4,079.60	0.09
192	128118	瀛通转债	4,076.80	0.09
193	128125	华阳转债	4,072.00	0.09
194	123028	清水转债	4,062.40	0.09
195	113601	塞力转债	4,058.80	0.09
196	128117	道恩转债	4,054.40	0.09
197	113578	全筑转债	4,036.40	0.09
198	128033	迪龙转债	3,884.10	0.08
199	113541	荣晟转债	3,708.00	0.08
200	113577	春秋转债	3,686.10	0.08
201	128094	星帅转债	3,531.90	0.08
202	123089	九洲转 2	3,504.90	0.08
203	123051	今天转债	3,479.10	0.08
204	123092	天壕转债	3,477.60	0.08
205	128025	特一转债	3,468.30	0.08
206	123048	应急转债	3,447.30	0.08
207	113594	淳中转债	3,360.90	0.07
208	128122	兴森转债	3,359.10	0.07
209	113608	威派转债	3,318.90	0.07
210	123057	美联转债	3,314.70	0.07
211	123002	国祯转债	3,259.80	0.07
212	123075	贝斯转债	3,254.70	0.07
213	128040	华通转债	3,243.00	0.07
214	123065	宝莱转债	3,237.90	0.07
215	113565	宏辉转债	3,224.40	0.07
216	123039	开润转债	3,183.90	0.07
217	128021	兄弟转债	3,154.80	0.07
218	113570	百达转债	3,152.70	0.07
219	113546	迪贝转债	3,149.40	0.07
220	128120	联诚转债	3,146.40	0.07

221	113524	奇精转债	3,123.30	0.07
222	113573	纵横转债	3,016.50	0.07
223	128072	翔鹭转债	3,008.40	0.07
224	123022	长信转债	2,955.20	0.06
225	123043	正元转债	2,941.40	0.06
226	123047	久吾转债	2,852.40	0.06
227	128079	英联转债	2,646.80	0.06
228	113575	东时转债	2,608.00	0.06
229	128050	钧达转债	2,577.00	0.06
230	123052	飞鹿转债	2,563.20	0.06
231	123062	三超转债	2,341.60	0.05
232	110070	凌钢转债	2,313.40	0.05
233	113572	三祥转债	2,298.00	0.05
234	113536	三星转债	2,292.20	0.05
235	123045	雷迪转债	2,287.00	0.05
236	113561	正裕转债	2,172.40	0.05
237	128056	今飞转债	2,169.20	0.05
238	128070	智能转债	2,165.00	0.05
239	113574	华体转债	2,052.80	0.04
240	113548	石英转债	1,669.80	0.04
241	128103	同德转债	1,602.90	0.04
242	123038	联得转债	1,162.10	0.03

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 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

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
285	14,500.40	2,244,591.00	54.31%	1,888,023.12	45.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

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、基金投资和研究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

基金合同生效日（2020年8月12日）基金份额总额	15,817,641.22
本报告期期初基金份额总额	8,812,174.86
本报告期基金总申购份额	5,563,713.54
减：本报告期基金总赎回份额	10,243,274.28
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	4,132,614.12

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本次基金份额持有人大会于 2021 年 7 月 27 日表决通过了《关于终止东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。本基金管理人已就该事项于 2021 年 7 月 28 日发布了《东吴基金管理有限公司关于东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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

本报告期内管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门发生以下重大人事变动：

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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 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

本报告期内本基金的管理人、托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

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	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金无交易单元变更情况。

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	8,342,380.53	100.00%	2,730,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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 2020 年年度资产净值公告	公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为代销机构、开通定期	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2021 年 1 月 6 日

	定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中证信息网站	
3	东吴基金管理有限公司关于参加平安银行股份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、中证信息网站	2021 年 1 月 8 日
4	东吴基金管理有限公司关于参加华宝证券有限责任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、中证信息网站	2021 年 1 月 12 日
5	东吴基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 20 日
6	东吴基金管理有限公司旗下基金 2020 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 21 日
7	东吴中证可转换债券指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 22 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 23 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在北京植信基金销售有限公司的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、中证信息网站	2021 年 1 月 26 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在光大证券股份有限公司的定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 1 月 27 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 3 日
12	东吴基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 2 月 5 日
13	东吴基金管理有限公司关于旗下东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金新增民生证券股份有限公司	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、	2021 年 3 月 2 日

	限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告	中证信息网站	
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东方财富证券股份有限公司的定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 17 日
15	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 30 日
16	东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议	公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 30 日
17	东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同	公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 30 日
18	东吴中证可转换债券指数证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 31 日
19	东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 31 日
20	东吴中证可转换债券指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 3 月 31 日
21	东吴基金管理有限公司关于暂停中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 1 日
22	东吴基金管理有限公司关于暂停上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 10 日
23	东吴基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 19 日
24	东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 21 日
25	东吴中证可转换债券指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 4 月 21 日
26	东吴基金管理有限公司旗下基金	中国证券报、上海证	2021 年 6 月 11 日

	招募说明书更新的提示性公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	
27	东吴中证可转换债券指数证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 11 日
28	东吴基金管理有限公司关于恢复使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 16 日
29	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台恢复农行网银直连支付开户与签约业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 16 日
30	东吴中证可转换债券指数证券投资基金暂停申购（含定期定额）业务的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 23 日
31	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 24 日
32	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 25 日
33	东吴基金关于在公司直销开展赎回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、中证信息网站	2021 年 6 月 25 日
34	东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示	公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 25 日
35	东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 28 日
36	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2021 年 6 月 30 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	20210101-20210110	2,651,996.00	0.00	2,651,996.00	0.00	0.00%
	2	20210623-20210629	0.00	2,722,156.67	2,722,156.67	0.00	0.00%
	3	20210623-20210629	0.00	2,722,156.67	2,722,156.67	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

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中证可转换债券指数分级证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》；
- 5、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、报告期内东吴中证可转换债券指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

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

2021 年 8 月 27 日