

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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：二〇一九年八月二十七日

§ 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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 2019 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.....	7
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
3.3 其他指标.....	9
§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.....	12
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.....	13
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	错误!未定义书签。
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.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	38
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.....	38
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.11 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 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.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47

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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 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分级证券投资基金		
基金简称	东吴转债		
场内简称	东吴转债		
基金主代码	165809		
交易代码	165809		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2014 年 5 月 9 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	18,898,247.13 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014 年 6 月 6 日		
下属分级基金的基金简称	可转债 A	可转债 B	东吴转债
下属分级基金场内简称	可转债 A	可转债 B	东吴转债
下属分级基金的交易代码	150164	150165	165809
报告期末下属分级基金份额总额	9,205,018.00 份	3,945,007.00 份	5,748,222.13 份

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，采用优化复制法的投资策略，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，采用最优复制法的投资策略，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。		
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，属于较低风险、较低收益的品种。		
下属分级基金的风险收益特征	可转债 A 份额为约定收益，将表现出预期低风险、预期收益相对稳定的明显特征。	可转债 B 份额获得产品剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险高、预期收益高的显著特征。	东吴转债是债券型指数基金，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，属于较低风险、较低收益的品种。

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	吕晖	李帅帅
	联系电话	021-50509888-8206	0755-22168168
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	LISHUAIISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95511 转 3
传真		021-50509888-8211	0755-25878287
注册地址		上海浦东源深路 279 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		200135	518001
法定代表人		王炯	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	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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,005,068.37
本期利润	2,547,771.65
加权平均基金份额本期利润	0.1217
本期加权平均净值利润率	11.98%
本期基金份额净值增长率	12.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-15,497,904.08
期末可供分配基金份额利润	-0.8201
期末基金资产净值	19,358,574.81
期末基金份额净值	1.024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-21.12%

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。

4、本基金于 2014 年 5 月 9 日成立。

3.2 基金净值表现

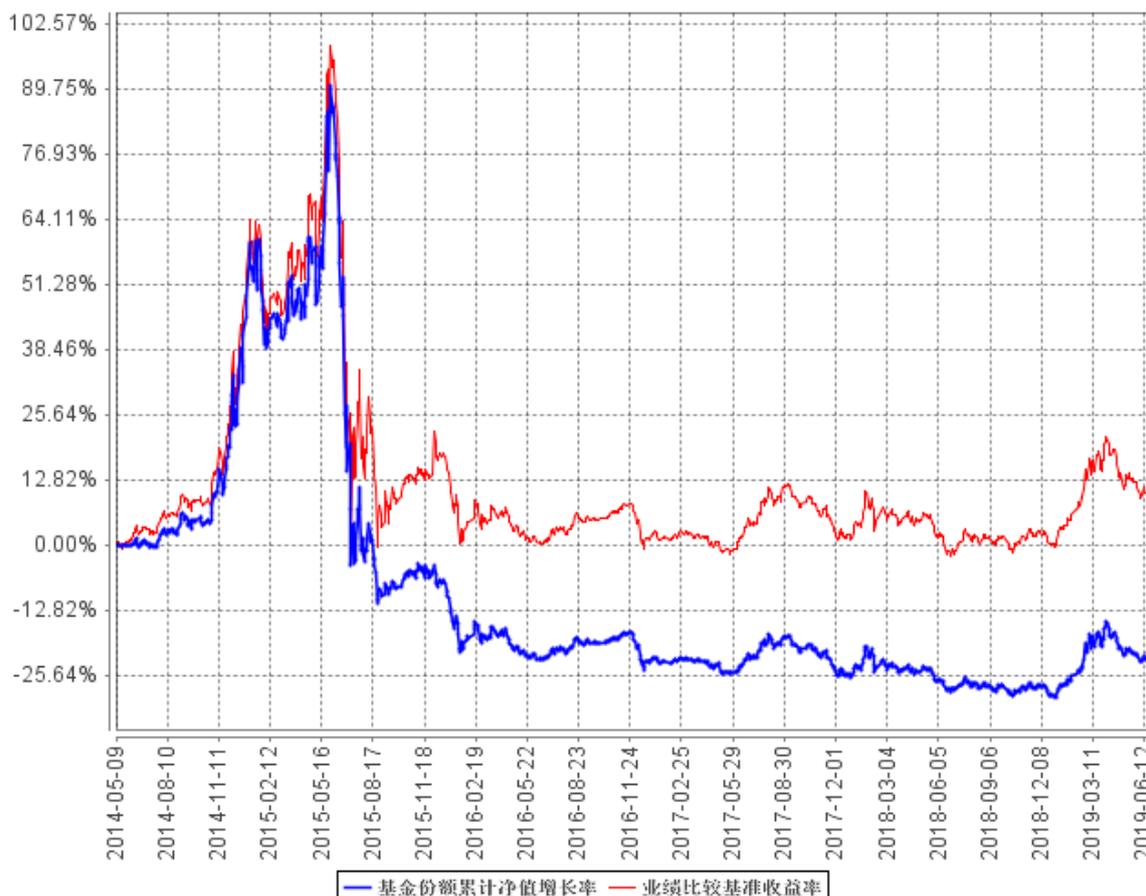
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.69%	0.51%	1.20%	0.63%	-0.51%	-0.12%
过去三个月	-3.40%	0.68%	-3.37%	0.76%	-0.03%	-0.08%
过去六个月	12.04%	0.87%	12.65%	0.86%	-0.61%	0.01%
过去一年	9.61%	0.67%	13.76%	0.68%	-4.15%	-0.01%
过去三年	0.83%	0.56%	11.44%	0.59%	-10.61%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-21.12%	1.28%	12.91%	1.48%	-34.03%	-0.20%

注：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%。

3.2.2 自基金合同生效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：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%。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019年1月1日 - 2019年6月30日）
可转债 A 与可转债 B 基金份额配比	7:3
其他指标	报告期末（2019年6月30日）
期末可转债 A 份额参考净值	1.026
期末可转债 B 份额参考净值	1.019
报告期末可转债 A 的预计年收益率	0.0450

注：可转债 A 约定年收益率=一年期银行定期存款年利率（税后）+3.0%。

§ 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。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,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,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 2019 年 6 月末,公司旗下管理着 29 只公募基,资产管理总规模 688 亿元(包括专户、专项资产管理规模),涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线,可满足不同类型投资者的投资需求。自 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,进一步引入了量化投资策略,并在业内率先成立了绝对收益部,谋求穿越牛熊的长期业绩回报。

经过多年积累和布局,公司的公募业务已形成三大投研“特色”:1. 权益投资坚持自下而上精选优质成长股,把握中国经济转型升级机遇;2. 绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念,借助量化模型进行择时和选股;3. 固定收益以稳健为本,兼顾流动性与收益率,为大类资产配置提供基础性工具。

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		
杨庆定	固定收益总监兼固定收益总部总经理、基金经理	2014 年 5 月 9 日	-	13 年	杨庆定,博士,上海交通大学管理学专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理;2007 年 7 月至 2010 年 6 月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理;2013 年 4 月再次加入东

					<p>吴基金管理有限公司，现担任公司固定收益总监兼固定收益总部总经理、基金经理，自 2014 年 5 月 9 日起担任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金经理、自 2014 年 6 月 28 日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月 19 日起担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理，其中，2014 年 6 月 28 日至 2018 年 4 月 19 日担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（2017 年 12 月 25 日由原东吴配置优化混合型证券投资基金转型）基金经理，2013 年 6 月 25 日至 2018 年 12 月 5 日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。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、杨庆定为该基金的首任基金经理，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交易进行了相关分析，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

去年 12 月工业增加值小幅超预期，今年 1 月新增信贷和社融超预期且结构好转，1 季度资金面较宽松，仅有一定季节性紧张。开年债券市场收益率在资金面宽松、数据真空期阶段延续去年末的下行态势，但由于预期已得到较为充分的反应，1 季度经济数据的好转及 1 月超预期的金融数据导致 1 月中旬之后收益率出现较为明显的反弹，权益市场大幅上涨也抬升了市场风险偏好，债券收益率震荡上行。4 月权益市场继续上涨，债券市场收益率较大幅上行。4 月央行对市场降准传言予以明确否认澄清，中央政治局会议提出坚持结构性去杠杆，坚决打好三大攻坚战等，市场预期货币政策进一步宽松概率明显降低，权益市场见顶回落，债市收益率小幅波动。“五一”节假日后，美国总统特朗普相关表述引发贸易争端再度升温，权益市场大幅调整，且经济再现走弱迹象，通胀压力也有所放缓，央行重启定向降准并加大公开市场操作投放力度，资金价格下行、债市收益率持续回落。6 月包商事件后，市场风险偏好大幅下降，流动性分层现象明显，央行通过各类操作工具给予对冲，压低资金价格至历史低位，利率债与高等级信用债收益率持续回落，但部分中低等级信用债因被抛售价格有一定波动。整体来看，今年上半年债市收益率呈现倒“V”走势，收益率高点在 4 月下旬，半年末收益率略高于去年末。

本基金在报告期内保持对标的指数的较好跟踪。上半年新发可转债规模超过 1500 亿元，市场继续扩容。二级市场来看，4 月前随着权益市场上涨，多数转债股性价值提升明显，部分品种触发提前赎回条款；4 月转债市场调整先于权益市场，估值压缩，5 月初权益市场快速调整时转债市场表现出一定的抗跌性，随后估值继续处于压缩状态，6 月跟随权益市场小幅回暖而略有上涨。

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 1.024 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.04%，业绩比较基准收益率为 12.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6 月经济数据显示投资增速小幅回落、工业增速有所回升，可选消费拉动下消费数据亮眼，

经济整体下行但韧性仍强，预计地产投资仍有支撑、基建投资仍有空间，经济超预期下滑可能性较低。6 月央行为对冲包商事件进行流动性投放，7 月随着资金逐步回收及缴税期来临，预计资金价格将较有所上行。虽然中长期来看收益率下行概率较大，但短期内债市收益率下行的驱动力略显不足。包商事件对市场影响深远，金融机构主动去杠杆仍在继续，流动性分层情况有所好转后，资产的分层现象还未有明显改善。

操作策略方面，我们将继续保持对标的指数的较好跟踪。

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、绝对收益部、固定收益部、专户投资部）负责人、合规风控部负责人、基金事务部负责人以及至少一名基金事务部估值业务骨干等人员组成，分管运营副总经理担任基金资产估值委员会主席。同时，基金资产估值委员会主席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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日出现基金资产净值低于五千万元的情形，已上报中国证监会，公司正在完善相关应对方案。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。

§ 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 托管人对本半年度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分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,591,373.41	3,334,980.65
结算备付金		4,528.06	-
存出保证金		4,320.91	2,406.76
交易性金融资产	6.4.7.2	18,048,249.31	20,484,789.77
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,048,249.31	20,484,789.77
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
贵金属投资		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,964.60	1,017.60
应收利息	6.4.7.5	56,980.71	119,850.94
应收股利		-	-
应收申购款		999.50	995.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		19,713,416.50	23,944,040.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		202,900.41	-
应付赎回款		57,122.65	91.40
应付管理人报酬		11,259.80	14,417.31
应付托管费		3,217.07	4,119.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		111.47	236.12

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	80,230.29	124,000.00
负债合计		354,841.69	142,864.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	24,561,353.87	33,830,089.64
未分配利润	6.4.7.10	-5,202,779.06	-10,028,912.95
所有者权益合计		19,358,574.81	23,801,176.69
负债和所有者权益总计		19,713,416.50	23,944,040.74

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.024 元，基金份额总额 18,898,247.13 份，其中 A 类基金份额参考净值为人民币 1.026 元，份额总额 9,205,018.00 份；B 类基金份额参考净值为人民币 1.019 元，份额总额 3,945,007.00 份；东吴转债基金份额参考净值为人民币 1.024 元，份额总额 5,748,222.13 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,758,369.10	-208,784.05
1.利息收入		80,353.89	110,399.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,343.99	12,224.94
债券利息收入		72,767.98	98,174.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		241.92	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,129,783.21	-1,574,819.68
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	1,129,783.21	-1,574,819.68
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“-”号填列）	6.4.7.16	1,542,703.28	1,244,941.29
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	5,528.72	10,694.94

减：二、费用		210,597.45	305,012.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	73,749.26	105,927.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	21,071.19	30,264.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	623.81	535.10
5. 利息支出		10,033.86	107.73
其中：卖出回购金融资产支出		10,033.86	107.73
6. 税金及附加		98.42	154.49
7. 其他费用	6.4.7.19	105,020.91	168,022.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,547,771.65	-513,796.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,547,771.65	-513,796.16

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分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	33,830,089.64	-10,028,912.95	23,801,176.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,547,771.65	2,547,771.65
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）	-9,268,735.77	2,278,362.24	-6,990,373.53
其中：1.基金申购款	1,040,426.44	-236,120.36	804,306.08
2.基金赎回款	-10,309,162.21	2,514,482.60	-7,794,679.61
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）	24,561,353.87	-5,202,779.06	19,358,574.81

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	48,880,035.47	-12,608,695.20	36,271,340.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-513,796.16	-513,796.16
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)	-13,853,005.97	3,279,297.18	-10,573,708.79
其中：1.基金申购款	774,261.07	-184,946.68	589,314.39
2.基金赎回款	-14,627,267.04	3,464,243.86	-11,163,023.18
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)	35,027,029.50	-9,843,194.18	25,183,835.32

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：

<u>王炯</u>	<u>徐明</u>	<u>吴婷</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	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分级证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[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。

本基金的基金份额包括东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“东吴转债”)、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之优先收益类份额(以下简称“可转债A”)和东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之进取收益类份额(以下简称“可转债B”)。东吴

转债份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但不上市交易。在满足上市条件的情况下，可转债 A 份额和可转债 B 份额将申请上市交易，但是不开放申购和赎回等业务。

投资者可在场内申购和赎回东吴转债份额，也可选择将其持有的东吴转债份额场内份额按 7:3 的比例分拆成可转债 A 份额和可转债 B 份额后进行二级市场交易。投资者可在二级市场买入或卖出可转债 A 份额和可转债 B 份额，也可以将其持有的上述两类份额按照 7:3 的配比合并为东吴转债份额后进行赎回。投资者可在场外申购和赎回东吴转债份额。场外认购和申购的东吴转债份额不进行份额配对转换，但基金合同另有规定的除外。场外的东吴转债份额可以通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的东吴转债份额配对转换规则进行操作。

本基金的基金份额折算分为定期份额折算和不定期份额折算。每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金根据基金合同的规定对东吴转债份额、可转债 A 份额进行定期份额折算。第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个 11 月 30 日，第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的 12 月 1 日至下一会计年度的 11 月 30 日。可转债 A 份额和可转债 B 份额按照基金合同的规定进行净值计算，对可转债 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份东吴转债份额将按 7 份可转债 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，可转债 A 份额和可转债 B 份额的份额配比保持 7:3 的比例。

对于可转债 A 份额期末的约定应得收益，即可转债 A 份额每个会计年度 11 月 30 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内东吴转债份额分配给可转债 A 份额持有人。东吴转债份额持有人持有的每 10 份东吴转债份额将按 7 份可转债 A 份额获得新增东吴转债份额的分配。持有场外东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外东吴转债份额的分配；持有场内东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内东吴转债份额的分配。经过上述份额折算，东吴转债份额和可转债 A 份额的基金份额净值将相应调整。

本基金还进行不定期份额折算。分为以下两种情况，即：当东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元；当可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元。

当东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元后，基金管理人将根据基金合同的规定对可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额进行份额折算，份额折算后可转债 A 份额和可转债 B 份额的比例仍保持 7:3 不变，份额折算后可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

当可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元后，基金管理人将根据基金合同的规定对可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保可转债 A 份额和可转债 B 份额的比例仍保持 7:3 不变，份额折算后东吴转债份额、可转债 A 份额和可转债 B

份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括可转债（含分离交易可转债）、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、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

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%。

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（以下统称“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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,591,373.41
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：	1,591,373.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 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	18,023,350.81	18,048,249.31
	银行间市场	-	-
	合计	18,023,350.81	18,048,249.31
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,023,350.81	18,048,249.31	24,898.50

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	342.56
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	1.80
应收债券利息	56,634.55
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	-
其他	1.80
合计	56,980.71

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 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	209.38
预提上市年费	29,752.78
应付指数使用费	25,000.00

应付审计费	24,299.25
应付信息披露费	968.88
合计	80,230.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东吴转债		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,027,686.02	33,830,089.64
本期申购	800,427.80	1,040,426.44
本期赎回(以“-”号填列)	-7,929,866.69	-10,309,162.21
- 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	18,898,247.13	24,561,353.87

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。

3、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金在可转债 A 份额、东吴转债份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金将进行定期份额折算。

4、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金在可转债 A 份额、可转债 B 份额、东吴转债份额存续期内，当触发阈值时，将进行不定期折算。

5、根据基金合同规定，投资者可申购、赎回东吴转债份额，可转债 A 份额与可转债 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，上表不再单独披露各分级基金份额情况。

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	-22,624,720.38	12,595,807.43	-10,028,912.95
本期利润	1,005,068.37	1,542,703.28	2,547,771.65
本期基金份额交易产生的变动数	6,121,747.93	-3,843,385.69	2,278,362.24
其中：基金申购款	-696,369.80	460,249.44	-236,120.36

基金赎回款	6,818,117.73	-4,303,635.13	2,514,482.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,497,904.08	10,295,125.02	-5,202,779.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	6,557.52
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	757.77
其他	28.70
合计	7,343.99

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,585,044.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,289,047.01
减：应收利息总额	166,214.22
买卖债券差价收入	1,129,783.21

6.4.7.13.2 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

本基金本报告期未进行其他投资交易。

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

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	1,542,703.28
——股票投资	-
——债券投资	1,542,703.28
——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	1,542,703.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	5,528.72
合计	5,528.72

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	623.81
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	623.81
----	--------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,299.25
信息披露费	968.88
上市年费	29,752.78
指数使用费	50,000.00
合计	105,020.91

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，本基金无其他需要披露的重大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

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	43,071,105.79	100.00%	46,195,938.56	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	92,700,000.00	100.00%	800,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	73,749.26	105,927.04
其中：支付销售机构的客户维护费	5,736.41	6,823.18

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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，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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
当期发生的基金应支付的托管费		21,071.19		30,264.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，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

本基金本报告期内未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 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**

本报告期内及上年度可比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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其它关联方无投资本基金的情况。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国平安银行股份有限公司	1,591,373.41	6,557.52	4,833,814.62	12,032.27

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

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（2019 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暂时停牌等流通受限股票。

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 2019 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 2019 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型指数基金，投资范围为本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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相关规定)，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，采用优化复制法的投资策略，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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,548,730.00	-
合计	2,548,730.00	-

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	8,650,202.50	7,121,890.66
AAA 以下	4,603,348.81	12,062,249.11
未评级	2,245,968.00	1,300,650.00
合计	15,499,519.31	20,484,789.77

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

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，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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 2019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	1,591,373.41	-	-	-	-	-	1,591,373.41
结算备付金	4,528.06	-	-	-	-	-	4,528.06
存出保证金	4,320.91	-	-	-	-	-	4,320.91
交易性金融资产	-	550,330.00	1,998,400.00	6,305,108.77	9,194,410.54	-	18,048,249.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,964.60	6,964.60
应收利息	-	-	-	-	-	56,980.71	56,980.71
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	999.50	999.50
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,600,222.38	550,330.00	1,998,400.00	6,305,108.77	9,194,410.54	64,944.81	19,713,416.50
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	202,900.41	202,900.41
应付赎回款	-	-	-	-	-	57,122.65	57,122.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,259.80	11,259.80
应付托管费	-	-	-	-	-	3,217.07	3,217.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-	111.47	111.47
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	80,230.29	80,230.29
负债总计	-	-	-	-	-	354,841.69	354,841.69
利率敏感度缺口	1,600,222.38	550,330.00	1,998,400.00	6,305,108.77	9,194,410.54	-289,896.88	19,358,574.81
上年度末 2018 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	3,334,980.65	-	-	-	-	-	3,334,980.65
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,406.76	-	-	-	-	-	2,406.76
交易性金融资产	1,300,650.00	-	202.40	14,639,753.75	4,544,183.62	-	20,484,789.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,017.60	1,017.60
应收利息	-	-	-	-	-	119,850.94	119,850.94
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	995.02	995.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,638,037.41	-	202.40	14,639,753.75	4,544,183.62	121,863.56	23,944,040.74
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	91.40	91.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,417.31	14,417.31
应付托管费	-	-	-	-	-	4,119.22	4,119.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-	236.12	236.12
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	124,000.00	124,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	142,864.05	142,864.05
利率敏感度缺口	4,638,037.41	-	202.40	14,639,753.75	4,544,183.62	-21,000.49	23,801,176.69

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。	
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（2019 年 6 月 30 日）

			日)
	利率下降 25 个基点	190,515.27	210,002.82
	利率上升 25 个基点	-187,679.05	-207,110.68

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或银行间同业市场交易的债券，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 2019 年 6 月 30 日，本基金主要投资于证券交易所和银行间同业市场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

无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,048,249.31	91.55
	其中：债券	18,048,249.31	91.55
	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	1,595,901.47	8.10
8	其他各项资产	69,265.72	0.35
9	合计	19,713,416.50	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买入股票资产。

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卖出股票资产。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票投资交易。

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	1,998,400.00	10.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	550,330.00	2.84
	其中：政策性金融债	550,330.00	2.84
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）	15,499,519.31	80.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,048,249.31	93.23

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	113021	中信转债	21,000	2,182,740.00	11.28
2	019611	19 国债 01	20,000	1,998,400.00	10.32
3	113011	光大转债	16,060	1,740,904.00	8.99
4	127010	平银转债	13,400	1,596,074.00	8.24
5	110053	苏银转债	11,800	1,258,470.00	6.50

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	4,320.91
2	应收证券清算款	6,964.60
3	应收股利	-
4	应收利息	56,980.71
5	应收申购款	999.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,265.72

7.12.4 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	113011	光大转债	1,740,904.00	8.99
2	128024	宁行转债	520,871.00	2.69
3	113013	国君转债	447,298.00	2.31

4	113008	电气转债	407,232.00	2.10
5	127005	长证转债	329,383.20	1.70
6	110046	圆通转债	268,493.60	1.39
7	113020	桐昆转债	244,769.20	1.26
8	113015	隆基转债	217,158.00	1.12
9	123003	蓝思转债	216,958.34	1.12
10	110049	海尔转债	216,576.00	1.12
11	110048	福能转债	189,346.00	0.98
12	128016	雨虹转债	171,687.00	0.89
13	110041	蒙电转债	167,625.00	0.87
14	110043	无锡转债	161,456.00	0.83
15	113014	林洋转债	153,136.00	0.79
16	128048	张行转债	148,147.04	0.77
17	110042	航电转债	147,953.00	0.76
18	110031	航信转债	145,737.60	0.75
19	110047	山鹰转债	141,193.00	0.73
20	113009	广汽转债	138,320.00	0.71
21	127006	敖东转债	136,814.35	0.71
22	110040	生益转债	133,030.00	0.69
23	128045	机电转债	131,712.00	0.68
24	128035	大族转债	124,032.00	0.64
25	110033	国贸转债	119,251.50	0.62
26	113508	新风转债	110,693.00	0.57
27	113019	玲珑转债	109,210.00	0.56
28	113516	吴银转债	107,440.00	0.55
29	128034	江银转债	102,427.71	0.53
30	128013	洪涛转债	95,680.00	0.49
31	128047	光电转债	92,496.00	0.48
32	128029	太阳转债	91,360.88	0.47
33	110034	九州转债	90,182.40	0.47
34	127007	湖广转债	80,256.49	0.41
35	113017	吉视转债	69,993.00	0.36
36	113518	顾家转债	66,462.00	0.34
37	128020	水晶转债	62,502.30	0.32
38	128030	天康转债	13,956.00	0.07

7.12.5 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。

7.12.6 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

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
可转债 A	164	56,128.16	6,602,594.00	71.73%	2,602,424.00	28.27%
可转债 B	949	4,157.01	582.00	0.01%	3,944,425.00	99.99%
东吴转债	1,302	4,414.92	391,197.00	6.81%	5,357,025.13	93.19%
合计	2,415	7,825.36	6,994,373.00	37.01%	11,903,874.13	62.99%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

可转债 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金-012G-ZY001 深	2,596,920.00	28.21%
2	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	2,566,242.00	27.88%
3	上海金珀资产管理有限公司—金珀 3 号基金	584,600.00	6.35%
4	彭登梅	450,000.00	4.89%
5	大越期货股份有限公司—大越期货 1 号资产管理计划	438,106.00	4.76%
6	银河期货有限公司—银河期货金珀 8 号资产管理计划	259,892.00	2.82%
7	郭敏丽	255,916.00	2.78%
8	母桂菊	235,100.00	2.55%
9	陈刚	230,000.00	2.50%
10	刘李沁	228,601.00	2.48%

可转债 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李胜华	226,073.00	5.73%
2	杨国庆	197,739.00	5.01%
3	高乃明	196,403.00	4.98%
4	李斌	187,031.00	4.74%

5	陈德桂	146,933.00	3.72%
6	张征	134,408.00	3.41%
7	汪建忠	130,694.00	3.31%
8	涂奎	128,140.00	3.25%
9	陈国富	83,869.00	2.13%
10	蔡福东	70,126.00	1.78%

东吴转债

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	郭敏丽	770,984.00	27.97%
2	万向明	349,454.00	12.68%
3	徐晓玲	270,343.00	9.81%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—万能—个人万能	193,367.00	7.02%
5	陈志彪	170,404.00	6.18%
6	鲁伟	158,531.00	5.75%
7	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	136,131.00	4.94%
8	张冬梅	58,483.00	2.12%
9	太平洋资管—建设银行—太平洋智选债基 FOF 型产品	56,446.00	2.05%
10	余迎广	50,334.00	1.83%

注：以上信息中持有人名称及份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 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	可转债 A	-	-
	可转债 B	-	-
	东吴转债	961.06	0.02%
	合计	961.06	0.00%

8.4 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

项目	可转债 A	可转债 B	东吴转债
基金合同生效日（2014 年 5 月 9 日）基金份额总额	-	-	268,064,983.90
本报告期期初基金份额总额	10,447,497.00	4,477,498.00	11,102,691.02
本报告期期间基金总申购份额	-	-	800,427.80
减：本报告期期间基金总赎回份额	-	-	7,929,866.69
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,242,479.00	-532,491.00	1,774,970.00
本报告期期末基金份额总额	9,205,018.00	3,945,007.00	5,748,222.13

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。

3、报告期间拆分变动包括日常拆分合并和折算产生的份额变动。

§ 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、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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）上海分所。

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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。公司高度重视，按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程，制定相关整改措施，落实整改工作。

本报告期内本基金的基金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	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期新增 2 个交易单元，为国融证券交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	43,071,105.79	100.00%	92,700,000.00	100.00%	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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 2018 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）	2019 年 1 月 2 日
2	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、公司网站	2019 年 1 月 19 日

3	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	中国证券报、公司网站	2019 年 2 月 27 日
4	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证券报、公司网站	2019 年 2 月 27 日
5	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证券报、公司网站	2019 年 3 月 5 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 3 月 8 日
7	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证券报、公司网站	2019 年 3 月 15 日
8	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	中国证券报、公司网站	2019 年 3 月 29 日
9	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、深交所（巨潮资讯网）	2019 年 3 月 30 日
10	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）	2019 年 4 月 12 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 4 月 17 日
12	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2019 年 4 月 20 日
13	东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金更新招募说明书以及摘要	中国证券报、公司网站	2019 年 6 月 21 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	20190101-20190108	6,501,922.00	251,109.00	4,156,111.00	2,596,920.00	12.36%
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、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴中证可转换债券指数分级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

2019年8月27日