

# 东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十一日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	51
8.7 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.....	51

8.8 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 .....	51
8.9 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 .....	51
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.11 投资组合报告附注 .....	52
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
9.3 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 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
11.2 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 .....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
11.4 基金投资策略的改变 .....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>66</b>
12.1 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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金
基金简称	东吴鼎泰纯债债券
基金主代码	006026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	600,047,470.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在对宏观经济和债券市场综合研判的基础上，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券研究，使用主动管理、数量投资和组合投资的投资手段，追求基金资产长期稳健的增值。
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘婷婷	石立平
	联系电话	021-50509888-8308	010-63639180
	电子邮箱	liutt@scfund.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95595
传真		021-50509888-8211	010-63639132
注册地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼 901、902 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		上海浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 楼	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		邓晖	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座（14 幢）20 楼
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2020 年	2019 年	2018 年 11 月 2 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	23,142,942.07	31,935,925.66	7,245,149.35
本期利润	20,900,381.55	35,130,520.59	7,249,598.24
加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.0390	0.0057
本期加权平均净值利润率	2.39%	3.85%	0.57%
本期基金份额净值增长率	2.64%	3.91%	0.57%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	5,836,619.88	23,527,598.90	5,092,580.16
期末可供分配基金份额利润	0.0097	0.0261	0.0057
期末基金资产净值	609,919,489.36	926,797,697.48	905,183,925.49
期末基金份额净值	1.0165	1.0297	1.0057
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	7.27%	4.51%	0.57%

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

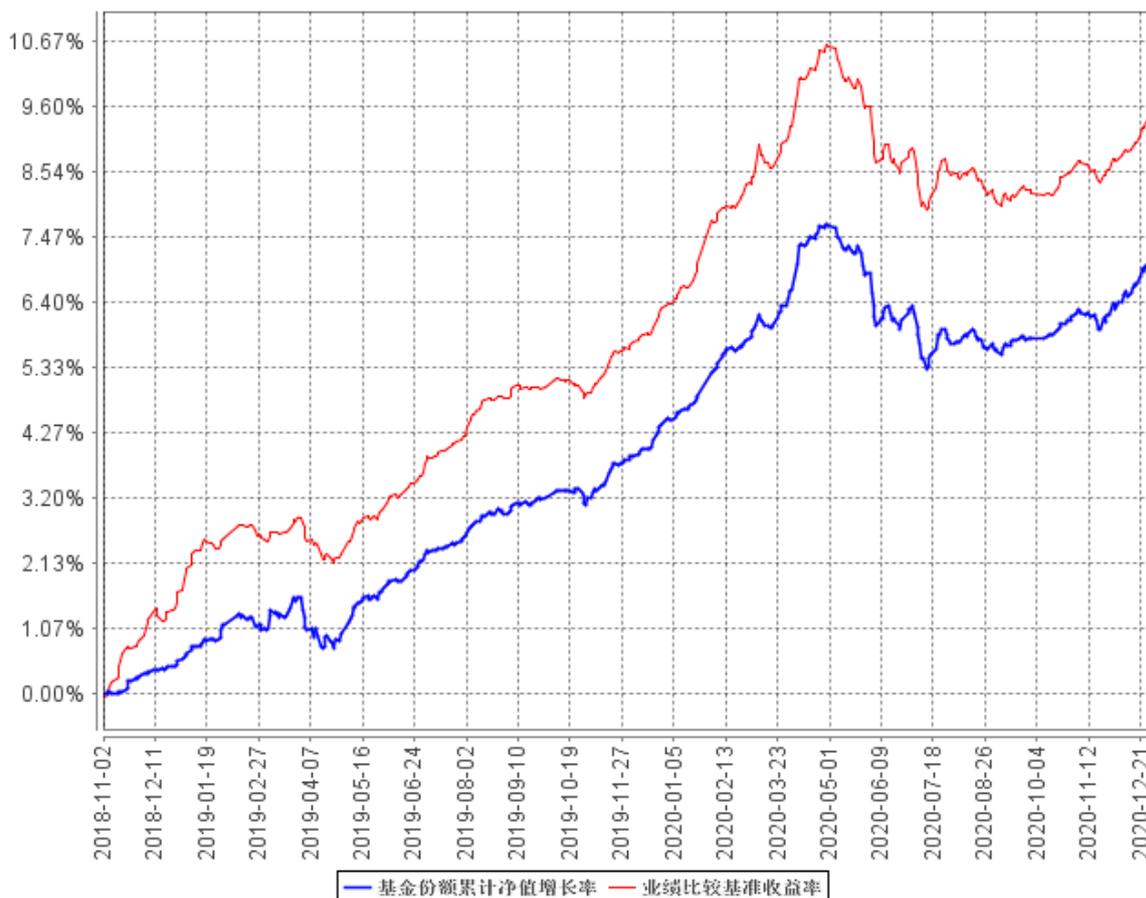
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.37%	0.06%	1.26%	0.05%	0.11%	0.01%
过去六个月	0.90%	0.07%	0.62%	0.07%	0.28%	0.00%
过去一年	2.64%	0.08%	2.98%	0.09%	-0.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.27%	0.06%	9.55%	0.07%	-2.28%	-0.01%

注：业绩比较基准=中国债券综合财富指数收益率

### 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

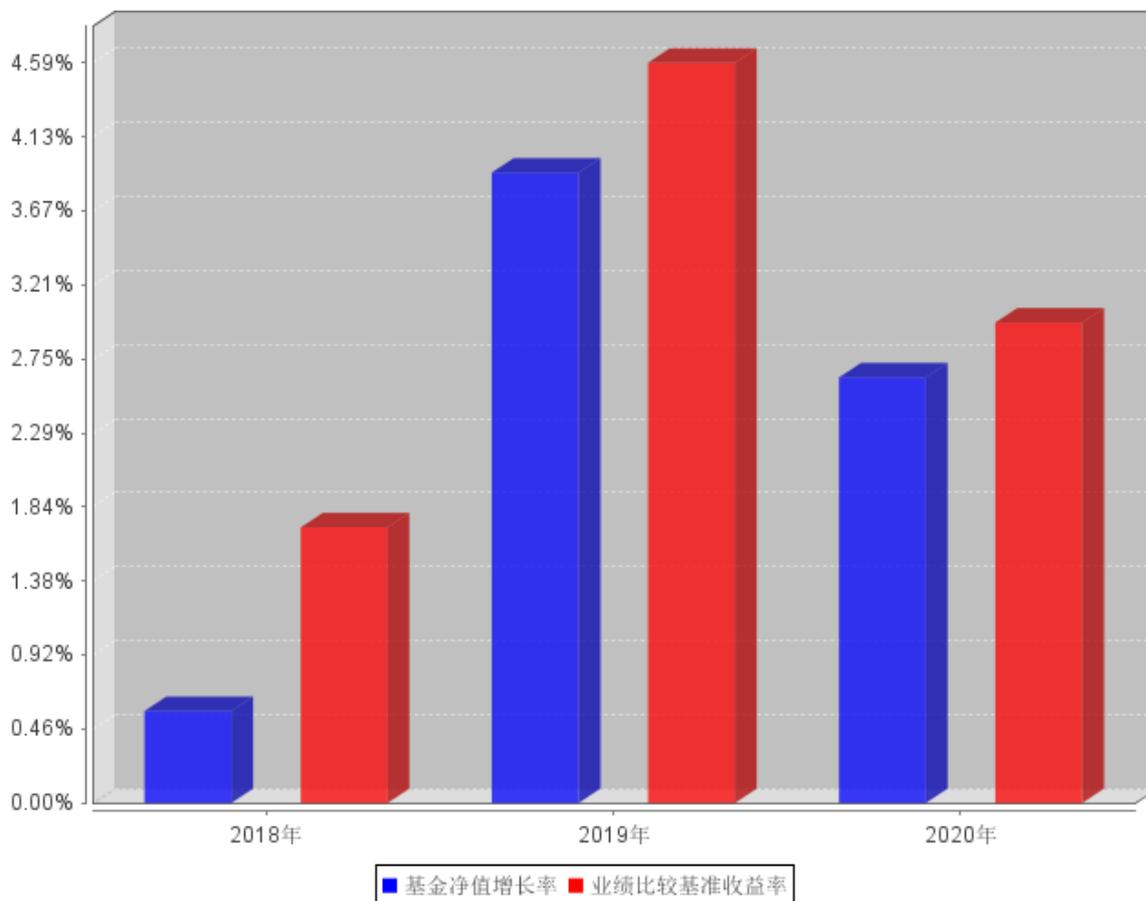


注：1. 业绩比较基准=中国债券综合财富指数收益率。

2. 本基金成立日为 2018 年 11 月 2 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 业绩比较基准=中国债券综合财富指数收益率。

2. 本基金成立日为 2018 年 11 月 2 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2020	0.4000	36,002,045.26	47.88	36,002,093.14	
2019	0.1500	13,500,645.03	263.81	13,500,908.84	
2018	-	-	-	-	
合计	0.5500	49,502,690.29	311.69	49,503,001.98	

## § 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,公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,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,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 2020 年年末,公司整体资产管理规模为 322 亿元,其中公募基金 154 亿元,专户业务 157 亿元,子公司 11 亿元;旗下管理着 26 只公募基金,45 只存续专户资产管理计划,20 项存续专项资产管理计划(子公司)。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晨	固定收益总部总经理助理、基金经理	2018 年 11 月 2 日	-	9 年	陈晨女士,中国国籍,厦门大学经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职华泰(联合)证券研究所研究员。2013 年 3 月起加入东吴基金管理有限公司,现任固定收益总部总经理助理、基金经理。2016 年 11 月 7 日至 2018 年 10 月 13 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理,2015 年 6 月 8 日至 2020 年 7 月 7 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,2020

					年1月9日至2020年7月9日担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理。2017年11月28日至2018年12月7日及2020年7月9日至今担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2018年11月2日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2020年12月16日至今担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理。
黄婧丽	基金经理	2018年11月8日	-	8年	黄婧丽女士，中国国籍，英国帝国理工学院金融学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职世纪证券有限责任公司研究员；国海证券股份有限公司投资助理。2016年11月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2018年5月9日至2020年12月16日担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，2018年1月29日至2021年1月22日担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2019年3月8日至2021年1月22日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2018年11月8日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：1、陈晨为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日，其他日期为对外公告之日；

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。

### 4.1.3 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。

### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

## 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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

报告期内，基金延续了前期的稳健策略，主要持有利率债、少量高等级商业银行存单以及以城投债为主的信用债。2020 年的利率走势呈现出下行-上行-回落的态势；2020 年初，新冠疫情的来袭打断了正常的经济运行轨迹，利率水平在当时已经较低的绝对水平之下“意外”地又下行了超过 20bp，之后随着我国迅速出台应对措施，经济活动逐渐恢复，央行货币政策也从非常态宽松过渡至平衡状态。5 月以来，在货币政策超预期边际收紧及财政政策发力的双重压力下，利率水平出现了剧烈的调整，以 10 年国债为例，从 4 月底低点调整接近 80bp；考虑到央行在 4 月初下调了超额准备金率，我们对于政策转向的迅速在判断上不够精准，基金净值也在市场整体回撤中也受到一定的拖累。

总体上看，基金运作较为稳健，三季度以后管理人及时根据市场走势对策略进行修正，将组合久期和杠杆率控制在中等偏低水平，等候市场走稳。进入四季度，由于判断供需格局有所改善，利率再大幅上行的空间有限，管理人及时增加了组合久期，使得基金净值在四季度逐渐回升。

### 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 1.0165 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.64%，业绩比较基准收益率为 2.98%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，管理人认为，债券市场的整体格局较 2020 年将有明显改善，最低迷的时期或将过去。首先，2020 年是充满了黑天鹅的艰难的一年，在疫情的攻击下，年初经济活动几乎停摆，为托底经济，财政政策需要逆周期发力，对应地方债、国债的加大供给给债券市场带来了较大的冲击；随着经济活动逐渐恢复，疫苗逐渐推进，2021 年赤字率将有望回到 3%附近的正常水平，债券市场供给压力有望大幅减轻。其次，中国率先恢复正常生产活动，国内经济已基本完成 V 型修复，L 型的长期经济走势并未发生根本变化，过去高达两位数的经济增速或将难以再复制；低基数效应下 2021 年一季度 GDP 同比增速大概率达到高点，继而回落至均衡水平。对此市场预期较为充分，目前收益率水平或许已具有配置价值，在此基础上再大幅上行则可能需要经济数据进一步超预期。

回顾 2020 年，出口成为拉动经济回升最超预期的分项，海外疫情加重使得产品供应骤然收缩，作为世界工厂的中国在当次危机中再一次充当了物资输出中心的角色，防疫、机电等物资的海外需求支撑着我国出口一直保持高增速。目前，尽管海外疫情并未完全得到控制，变异病毒使得疫情结束可能进一步延迟，但随着疫苗的同期进行与普及，疫情对生产的活动的影响在消退，管理

人认为 2021 年出口超预期程度可能难以与 2020 年齐平。

最后，从货币政策来看，2020 年防疫期间超常态宽松的货币环境，导致信贷过度投放，社融高增，宏观杠杆率上升迅速，监管层意识到持续的宽松可能导致投机过度，因此 2021 年的货币政策将有望呈现出逐渐收紧的趋势，但同时监管层近期的讲话以及举措也表明了不会“急转弯”，疫后脆弱的经济生态脆弱，企业无法承受过高的利率，管理人认为 2021 年流动性有望仍会维持总体稳定。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

(1) 根据法规要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据法律法规及基金业协会的相关要求，结合公司旗下各公募基金的实际运作情况，对公司旗下公募基金开展了情景压力测试，形成压力测试分析报告，加强流动性风险管理。公司根据法规要求持续关注流动性法规执行情况，从制度建设、系统控制、指标监测、部门间协作等方面，不断优化流动性管理工作流程，建立健全公司流动性风险管理内部控制体系。

(2) 以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

(3) 加强宣传推介材料审核，保证合规推介。公司根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》等法规及相关监管要求，严格审核对外宣传材料，包括但不限于宣传单页、一页通、海报、PPT、视频、文章等，重点对宣传材料中涉及到的业绩引用、基金评价引用、风险揭示等内容作出合规风险提示。

(4) 跟踪监管动态，及时落实新规。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求进行内部讨论，成立工作小组，制订落实方案。及时开展内部培训，修改相关制度与流程，升级业务系统并设置风控阈值，保障基金投资符合监管要求。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2020 年 6 月 9 日发布分红公告，向截至 2020 年 6 月 10 日止在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人发放红利，每 10 份基金份额派发红利 0.40 元，共计分配利润为 36,002,093.14 元，符合基金合同的有关约定。

#### 4.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日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，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资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金 2020 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天衡审字（2021）00453 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理层计划清算东吴鼎泰纯债债券型</p>

	<p>证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金不能持续经营。</p>

	<p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	史文明	谢文彬
会计师事务所的地址	中国 南京	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	57,734.35	2,020,099.44
结算备付金		-	-
存出保证金		-	3,602.02
交易性金融资产	7.4.7.2	635,608,900.00	1,103,062,900.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		635,608,900.00	1,103,062,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	11,077,535.25	22,272,796.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	6,496.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		646,744,169.60	1,127,365,894.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		36,374,861.81	199,999,580.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	102.55
应付管理人报酬		154,139.93	235,181.45
应付托管费		51,379.98	78,393.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	19,434.29	15,707.91
应交税费		23,039.27	30,541.09
应付利息		2,824.96	18,690.14

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,000.00	190,000.00
负债合计		36,824,680.24	200,568,196.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	600,047,470.80	900,063,396.80
未分配利润	7.4.7.10	9,872,018.56	26,734,300.68
所有者权益合计		609,919,489.36	926,797,697.48
负债和所有者权益总计		646,744,169.60	1,127,365,894.45

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0165 元，基金份额总额 600,047,470.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		28,599,214.33	41,206,197.20
1. 利息收入		44,618,644.06	41,122,782.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,641.70	95,415.71
债券利息收入		44,550,460.93	38,558,959.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,541.43	2,468,407.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-13,776,869.21	-3,111,937.98
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-13,776,869.21	-3,111,937.98
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,242,560.52	3,194,594.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	757.70
<b>减：二、费用</b>		7,698,832.78	6,075,676.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,635,434.65	2,739,738.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	878,478.20	913,246.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	10,950.00	24,512.69
5. 利息支出		3,905,253.92	2,126,729.54
其中：卖出回购金融资产支出		3,905,253.92	2,126,729.54
6. 税金及附加		32,516.01	50,449.66
7. 其他费用	7.4.7.19	236,200.00	221,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		20,900,381.55	35,130,520.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		20,900,381.55	35,130,520.59

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	900,063,396.80	26,734,300.68	926,797,697.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,900,381.55	20,900,381.55
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）	-300,015,926.00	-1,760,570.53	-301,776,496.53
其中：1. 基金申购款	47.61	0.27	47.88
2. 基金赎回款	-300,015,973.61	-1,760,570.80	-301,776,544.41
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）	-	-36,002,093.14	-36,002,093.14
五、期末所有者权益（基金净值）	600,047,470.80	9,872,018.56	609,919,489.36
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	900,079,187.95	5,104,737.54	905,183,925.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,130,520.59	35,130,520.59
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）	-15,791.15	-48.61	-15,839.76
其中：1. 基金申购款	97,204.94	1,360.88	98,565.82
2. 基金赎回款	-112,996.09	-1,409.49	-114,405.58
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）	-	-13,500,908.84	-13,500,908.84
五、期末所有者权益（基金净值）	900,063,396.80	26,734,300.68	926,797,697.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          邓晖          </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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金(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[2018]396 号文《关于准予东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金注册的批复》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 2018 年 11 月 2 日正式生效,首次设立募集规模为 1,830,048,409.49 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与注册登记机构为东吴基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单及其他货币市场工具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)。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80% 本基金 保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准=中国债券综合财富指数收益率。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

### (4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每份基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	57,734.35	2,020,099.44
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:	57,734.35	2,020,099.44

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	1,032,751.00	1,011,900.00
	银行间市场	633,619,665.70	634,597,000.00
	合计	634,652,416.70	635,608,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	634,652,416.70	635,608,900.00	956,483.30
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 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	1,032,751.00	1,027,500.00
	银行间市场	1,098,831,105.18	1,102,035,400.00
	合计	1,099,863,856.18	1,103,062,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,099,863,856.18	1,103,062,900.00	3,199,043.82

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	33.65	286.05
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	-	-
应收债券利息	11,077,501.60	22,272,508.43
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	-	1.76
合计	11,077,535.25	22,272,796.24

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	19,434.29	15,707.91
合计	19,434.29	15,707.91

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付审计费	70,000.00	70,000.00
应付账户维护费	9,000.00	-
合计	199,000.00	190,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	900,063,396.80	900,063,396.80
本期申购	47.61	47.61
本期赎回（以“-”号填列）	-300,015,973.61	-300,015,973.61
- 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	600,047,470.80	600,047,470.80

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	23,527,598.90	3,206,701.78	26,734,300.68
本期利润	23,142,942.07	-2,242,560.52	20,900,381.55
本期基金份额交易产生的变动数	-4,831,827.95	3,071,257.42	-1,760,570.53
其中：基金申购款	0.20	0.07	0.27
基金赎回款	-4,831,828.15	3,071,257.35	-1,760,570.80
本期已分配利润	-36,002,093.14	-	-36,002,093.14
本期末	5,836,619.88	4,035,398.68	9,872,018.56

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	9,630.31	61,348.95
定期存款利息收入	-	30,332.07
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	3,492.14
其他	11.39	242.55
合计	9,641.70	95,415.71

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	-13,776,869.21	-3,111,937.98
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	-13,776,869.21	-3,111,937.98

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,070,967,823.29	1,437,579,174.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,064,637,359.21	1,408,968,461.42
减：应收利息总额	20,107,333.29	31,722,651.12
买卖债券差价收入	-13,776,869.21	-3,111,937.98

### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 衍生工具收益

#### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无权证投资收益。

#### 7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他投资收益。

### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	-2,242,560.52	3,194,594.93
——股票投资	-	-
——债券投资	-2,242,560.52	3,194,594.93
——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	-2,242,560.52	3,194,594.93

### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
基金赎回费收入	-	757.70
合计	-	757.70

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	-	62.69
银行间市场交易费用	10,950.00	24,450.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	10,950.00	24,512.69

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	45,000.00	30,000.00
其他费用	1,200.00	1,000.00
银行汇划费	-	-
合计	236,200.00	221,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	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

海澜集团有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	-	-	61,734,219.79	100.00%

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东吴证券股 份有限公司	-	-	52,972,000.00	100.00%

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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的关联方佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,635,434.65	2,739,738.47
其中：支付销售机构的客户维护费	53.82	65.68

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	878,478.20	913,246.25

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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 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及上年度末均未投资本基金。

### 7.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	57,734.35	9,630.31	2,020,099.44	61,348.95

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2020年度获得的利息收入为人民币0.00元（2019年度：人民币3,492.14元），2020年末结算备付金余额为人民币0.00元（2019年末：人民币0.00元）。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 7.4.10.8 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。

### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020年6 月10日	-	2020年 6月10 日	0.4000	36,002,045.26	47.88	36,002,093.14	
合计	-	-		0.4000	36,002,045.26	47.88	36,002,093.14	

### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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/增发而流通受限的证券。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代 码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
110238	11国开38	2021年1月 4日	100.93	375,000	37,848,750.00
合计				375,000	37,848,750.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、

可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单及其他货币市场工具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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在对宏观经济和债券市场综合研判的基础上，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券研究，使用主动管理、数量投资和组合投资的投资手段，追求基金资产长期稳健的增值。

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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	50,190,000.00	60,078,000.00
合计	50,190,000.00	60,078,000.00

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

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	97,380,000.00	87,634,000.00
合计	97,380,000.00	87,634,000.00

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

#### 7.4.13.2.4 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	123,844,000.00	176,774,400.00
未评级	364,194,900.00	778,576,500.00
合计	488,038,900.00	955,350,900.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

#### 7.4.13.3 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。

### 7.4.13.3.1 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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，本基金未发生流动性风险事件。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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、债券投资及卖出回购资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 0 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	57,734.35	-	-	-	-	-	57,734.35

款							
交易性金融资产		- 48,825,000.00	203,023,900.00	191,659,000.00	192,101,000.00	-	635,608,900.00
应收利息		-	-	-	-	11,077,535.25	11,077,535.25
资产总计	57,734.35	48,825,000.00	203,023,900.00	191,659,000.00	192,101,000.00	11,077,535.25	646,744,169.60
负债							
卖出回购金融资产款	36,374,861.81	-	-	-	-	-	36,374,861.81
应付管理人报酬		-	-	-	-	154,139.93	154,139.93
应付托管费		-	-	-	-	51,379.98	51,379.98
应付交易费		-	-	-	-	19,434.29	19,434.29

用							
应付利息	-	-	-	-	-	2,824.96	2,824.96
应交税费	-	-	-	-	-	23,039.27	23,039.27
其他负债	-	-	-	-	-	199,000.00	199,000.00
负债总计	36,374,861.81	-	-	-	-	449,818.43	36,824,680.24
利率敏感度缺口	-36,317,127.46	48,825,000.00	203,023,900.00	191,659,000.00	192,101,000.00	10,627,716.82	609,919,489.36
上年度末 2019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	2,020,099.44	-	-	-	-	-	2,020,099.44
存出保证	3,602.02	-	-	-	-	-	3,602.02

金							
交易性金融资产	-45,948,000.00	153,017,900.00	815,548,400.00	88,548,600.00	-	1,103,062,900.00	
应收利息	-	-	-	-	22,272,796.24	22,272,796.24	
应收申购款	-	-	-	-	6,496.75	6,496.75	
资产总计	2,023,701.46	45,948,000.00	153,017,900.00	815,548,400.00	88,548,600.00	22,279,292.99	1,127,365,894.45
负债							
卖出回购金融资产款	199,999,580.00	-	-	-	-	199,999,580.00	
应付赎回款	-	-	-	-	102.55	102.55	
应付管理人报酬	-	-	-	-	235,181.45	235,181.45	
应	-	-	-	-	78,393.83	78,393.83	

付 托 管 费							
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	15,707.91	15,707.91
应 付 利 息	-	-	-	-	-	18,690.14	18,690.14
应 交 税 费	-	-	-	-	-	30,541.09	30,541.09
其 他 负 债	-	-	-	-	-	190,000.00	190,000.00
负 债 总 计	199,999,580.00	-	-	-	-	568,616.97	200,568,196.97
利 率 敏 感 度 缺 口	-197,975,878.54	45,948,000.00	153,017,900.00	815,548,400.00	88,548,600.00	21,710,676.02	926,797,697.48

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	基准利率减少 25 个基点	5,507,136.72	5,109,529.70
	基准利率增加 25 个基点	-5,377,948.39	-5,055,585.84

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 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 2020 年 12 月 31 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、买入返售金融资产及卖出回购资产，因此无重大市场价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要披露的其它重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	635,608,900.00	98.28
	其中：债券	635,608,900.00	98.28
	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	57,734.35	0.01
8	其他各项资产	11,077,535.25	1.71
9	合计	646,744,169.60	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.4.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.4.3 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持有股票。

## 8.5 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	109,643,900.00	17.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	304,741,000.00	49.96
	其中：政策性金融债	304,741,000.00	49.96
4	企业债券	73,382,000.00	12.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	50,462,000.00	8.27
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	97,380,000.00	15.97
9	其他	-	-
10	合计	635,608,900.00	104.21

## 8.6 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	200215	20 国开 15	800,000	81,088,000.00	13.29
2	180210	18 国开 10	500,000	51,665,000.00	8.47
3	110238	11 国开 38	500,000	50,465,000.00	8.27
4	190208	19 国开 08	500,000	50,460,000.00	8.27
5	200212	20 国开 12	500,000	50,285,000.00	8.24

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 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。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 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

20 农业银行 CD016（代码：112003016）的发行主体“中国农业银行股份有限公司”于 2020 年 8 月 28 日因违规经营、未依法履行职责等原因被银保监会处以警告、没收违法所得、罚款及罚没；

20 平安银行 CD239（代码：112011239）的发行主体“平安银行股份有限公司”于 2019 年 12 月 25 日及 2020 年 8 月 28 日因违规经营被银保监会处以罚款。

本基金投资 20 农业银行 CD016 和 20 平安银行 CD239 的投资决策程序符合公司制度的规定，且相关发行主体的处罚事项并未对其企业经营和投资价值产生实质性影响。

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

#### 8.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,077,535.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,077,535.25

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 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。

### **8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
109	5,505,022.67	600,006,000.00	99.99%	41,470.80	0.01%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,878.50	0.0005%

### 9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年11月2日）基金份额总额	1,830,048,409.49
本报告期期初基金份额总额	900,063,396.80
本报告期基金总申购份额	47.61
减:本报告期基金总赎回份额	300,015,973.61
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	600,047,470.80

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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发生以下人事变动：

2020 年 6 月 18 日经东吴基金管理有限公司第三届董事会 2020 年第 1 次临时会议审议通过，聘任陈军同志为东吴基金管理有限公司常务副总经理，2020 年 6 月 24 日完成相关手续后，正式履职。

2020 年 4 月 16 日经东吴基金管理有限公司第三届董事会第六次会议审议通过，吕晖同志不再担任公司督察长职务；聘任刘婷婷同志为东吴基金管理有限公司督察长，2020 年 8 月 20 日完成相关手续后，正式履职。

2020 年 11 月 18 日经东吴基金管理有限公司第三届董事会第七次会议审议通过，聘任葛艳同志为东吴基金管理有限公司首席信息官，2020 年 12 月 23 日完成相关手续后，正式履职。

本报告期内基金托管人发生以下人事变动：

2020 年 7 月，中国光大银行股份有限公司聘任李守靖先生担任资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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天衡会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内支付审计费 70000 元。

### 11.6 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。截至本报告日，公司已完成整改工作并向监管部门提交了整改报告。

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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

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

#### 2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期无新增或退租席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期间租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## 11.8 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 2019 年年度资产净值公告	公司网站、中证信息网站	2020 年 1 月 1 日
2	东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加部分代销机构费率优惠的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 1 月 4 日
3	东吴基金管理有限公司旗下全部基金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、	2020 年 1 月 18 日

		中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	
4	东吴基金管理有限公司关于延迟开市的温馨提示	公司网站、中证信息网站	2020 年 1 月 31 日
5	东吴基金管理有限公司关于参加华夏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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 2 月 14 日
6	东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购（含定期定额）、转换转入业务的公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 2 月 19 日
7	东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 3 月 16 日
8	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、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 3 月 18 日
9	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2019 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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 3 月 26 日
10	东吴基金管理有限公司关于参加中信建投证券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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 4 月 14 日

11	中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”	中国证监会规定的媒介	2020年4月15日
12	东吴基金管理有限公司旗下全部基金2020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、深交所（巨潮资讯网）	2020年4月22日
13	东吴基金管理有限公司关于参加中信证券华南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、深交所（巨潮资讯网）	2020年4月28日
14	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在中信证券华南股份有限公司的定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站	2020年4月29日
15	东吴基金管理有限公司关于参加华安证券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、深交所（巨潮资讯网）	2020年5月9日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020年5月18日
17	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所	2020年5月21日

		所（巨潮资讯网）	
18	东吴基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	2020年5月27日
19	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	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、深交所（巨潮资讯网）	2020年6月3日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增泛华普益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	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、深交所（巨潮资讯网）	2020年6月5日
21	东吴基金管理有限公司关于参加泛华普益基金销售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、深交所（巨潮资讯网）	2020年6月5日
22	2020年度东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020年6月9日
23	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020年6月10日
24	东吴基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证	2020年6月23日

	证券投资基金所持有的债券估值调整公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站、深交所（巨潮资讯网）	
25	东吴基金管理有限公司关于聘任常务副总经理的公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020年6月24日
26	东吴基金管理有限公司管理的基金 2020 年半年度基金净值公告	公司网站、中证信息网站	2020年7月1日
27	东吴基金管理有限公司关于参加长城国瑞证券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、深交所（巨潮资讯网）	2020年7月3日
28	东吴基金管理有限公司关于暂停成都华羿恒信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、深交所（巨潮资讯网）	2020年7月3日
29	东吴基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚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、深交所（巨潮资讯网）	2020年7月3日
30	东吴基金管理有限公司关于旗下基金开通在大连网金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、深交所	2020年7月15日

		所（巨潮资讯网）	
31	东吴基金管理有限公司关于参加大连网金基金销售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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 7 月 15 日
32	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 2 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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 7 月 21 日
33	东吴基金管理有限公司住所变更公告	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、深交所（巨潮资讯网）	2020 年 7 月 31 日
34	东吴基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站	2020 年 8 月 20 日
35	东吴基金管理有限公司关于参加招商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	2020 年 8 月 21 日
36	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	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	2020 年 8 月 28 日
37	东吴鼎泰纯债债券型证券投资基	证券时报、公司网	2020 年 8 月 28 日

	金更新招募说明书以及产品资料概要	站、中证信息网站	
38	东吴基金管理有限公司关于参加恒泰证券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	2020 年 8 月 31 日
39	东吴基金管理有限公司关于暂停手机 APP、微信服务号认购、申购（含定期定额）及转换转入业务的公告	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	2020 年 8 月 31 日
40	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在中国人寿保险股份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	2020 年 8 月 31 日
41	东吴基金管理有限公司关于参加中国人寿保险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	2020 年 8 月 31 日
42	东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要	证券时报、公司网站、中证信息网站	2020 年 9 月 11 日
43	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在江苏银行股份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	2020 年 9 月 11 日
44	东吴基金管理有限公司关于参加江苏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	2020 年 9 月 11 日

45	东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低赎回份额、转换转出及最低持有份额的公告	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	2020 年 10 月 22 日
46	东吴基金管理有限公司关于参加海通证券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	2020 年 10 月 23 日
47	东吴基金管理有限公司关于参加华鑫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	2020 年 10 月 23 日
48	东吴基金管理有限公司关于终止大泰金石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	2020 年 10 月 26 日
49	东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 3 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	2020 年 10 月 28 日
50	东吴基金管理有限公司关于参加方德保险代理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	2020 年 10 月 28 日
51	东吴基金管理有限公司关于参加北京肯特瑞基金销售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	2020 年 10 月 31 日

52	东吴基金管理有限公司关于参加部分代销机构费率优惠的公告	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	2020 年 11 月 3 日
53	东吴基金管理有限公司关于网上直销平台暂停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	2020 年 11 月 26 日
54	东吴基金管理有限公司关于参加部分代销机构费率优惠的公告	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	2020 年 12 月 1 日
55	东吴基金管理有限公司关于参加宁波银行股份有限公司同业基金销售平台费率优惠的公告	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	2020 年 12 月 12 日
56	东吴基金管理有限公司关于参加信达证券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	2020 年 12 月 12 日
57	东吴基金管理有限公司首席信息官任职公告	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	2020 年 12 月 23 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20200101 - 20201231	900,006,000.00	0.00	300,000,000.00	600,006,000.00	99.99%
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴鼎泰纯债债券型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、报告期内东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 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。

### 13.3 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3月31日