

东吴中证可转换债券指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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 2020 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东吴中证可转债指数
基金主代码	165809
交易代码	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
报告期末基金份额总额	10,082,230.17 份
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。
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

转型前:

基金简称	东吴中证可转债		
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		
报告期末基金份额总额	15,817,539.22 份		
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。		
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		
下属分级基金的基金简称	可转债 A	可转债 B	东吴转债
下属分级基金的场内简称	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的份额总额	7,984,617.00 份	3,421,978.00 份	4,410,944.22 份
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	可转债 B 份额获得产品剩余收	东吴转债是债券型指数基金,

	表现出预期低风险、预期收益相对稳定的明显特征。	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。	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。
--	-------------------------	----------------------------------	--

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年8月12日—2020年9月30日）
1. 本期已实现收益	518,854.73
2. 本期利润	-307,484.09
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0270
4. 期末基金资产净值	10,747,312.18
5. 期末基金份额净值	1.0660

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月1日—2020年8月11日）
1. 本期已实现收益	326,490.16
2. 本期利润	1,270,772.43
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0762
4. 期末基金资产净值	17,451,089.64
5. 期末基金份额净值	1.1033

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、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，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（转型后）

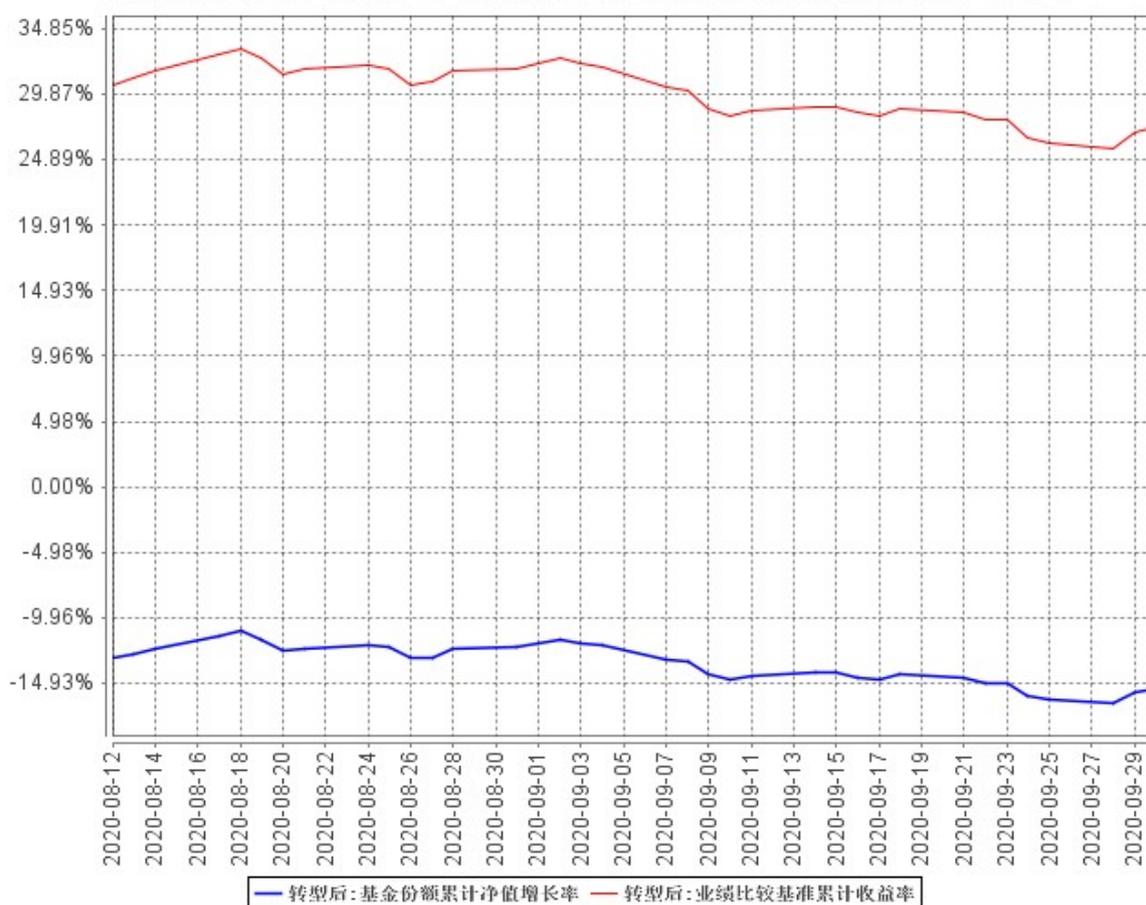
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
自基金转型 生效起至今	-3.38%	0.57%	-2.95%	0.54%	-0.43%	0.03%

注：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%

3.2.2 自基金转型生效以来基金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，图示日期为 2020 年 8 月 12 日至 2020 年 9 月 30 日；自本基金转型起至报告期末不满一年。

3、转型后的投资范围及投资比例与转型前一致；本报告期内，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

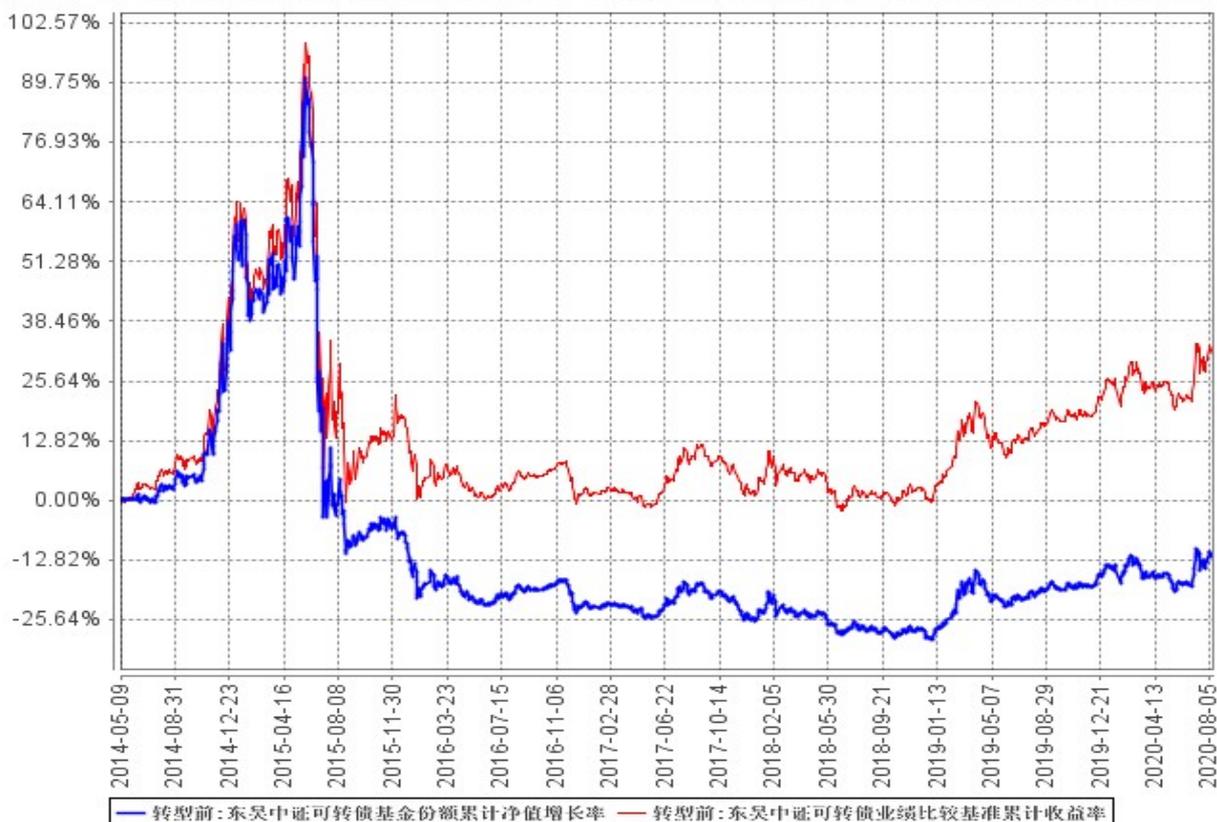
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	7.12%	1.21%	7.54%	1.20%	-0.42%	0.01%
过去六个月	4.98%	0.78%	5.64%	0.78%	-0.66%	0.00%
过去一年	8.62%	0.70%	12.30%	0.71%	-3.68%	-0.01%
过去三年	10.06%	0.63%	21.26%	0.66%	-11.20%	-0.03%
过去五年	-4.49%	0.63%	20.51%	0.68%	-25.00%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	-12.40%	1.20%	31.28%	1.37%	-43.68%	-0.17%

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. 过去三个月：2020年7月1日至2020年8月11日，过去六个月：2020年4月1日至2020年8月11日，过去一年：2019年10月8日至2020年8月11日，过去三年：2017年10月9日至2020年8月11日，过去五年：2015年10月8日至2020年8月11日，自基金合同生效起至今：2014年5月9日至2020年8月11日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东吴中证可转债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，图示日期为 2014 年 5 月 9 日至 2020 年 8 月 11 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	王文华女士，中国籍，南开大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾就职于中诚信证券评估有限公司、联合证券股份有限公司，任高级分析师等职。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 16 日至今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基金经理。

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

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。

4.1.1 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（转型前）

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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	王文华女士，中国籍，南开大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾就职于中诚信证券评估有限公司、联合证券股份有限公司，任高级分析师等职。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 16 日至今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基金经理。

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

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。

4.1.1 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（转型后）

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，海外复工复产，经济底部回升，带动国内出口增速屡超预期。商品房销售状况良好，房地产投资增速明显改善。至 8 月份，国内恢复相对缓慢的消费也渐有起色，社会消费品零售总额同比增速转正。国内经济企稳回升，货币政策边际趋紧，MLF 和 LPR 利率连续两个季度未有调整。10 年期国债收益率波动上行，自 6 月末的 2.82%附近上行至 9 月末的 3.15%附近。

股票市场在 7 月上旬大幅上行，上证指数涨幅在 15%左右，随后高位震荡调整。受股票市场影响，中证可转债指数自 6 月末的 343.46 上行至 7 月中旬的 379.39，震荡调整至 9 月末的 359.21。

本基金对转债指数进行优化配置，跟踪指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 9 月 30 日，东吴中证可转换债券指数证券投资基金份额净值为 1.0660 元；本报告期内（2020 年 8 月 12 日至 2020 年 9 月 30 日）份额净值增长率-3.38%，同期业绩比较基准收益率为-2.95%。

截至 2020 年 8 月 11 日，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金份额净值为 1.1033 元；本报告期内（2020 年 7 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日）份额净值增长率为 7.12%，同期业绩比较基准收益率为 7.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金于 2020 年 7 月 1 日至 2020 年 9 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，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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,686,140.97	98.82
	其中：债券	10,686,140.97	98.82
	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	42,714.74	0.40
8	其他资产	84,731.96	0.78
9	合计	10,813,587.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	600,540.00	5.59
	其中：政策性金融债	600,540.00	5.59
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）	10,085,600.97	93.84

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,686,140.97	99.43

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	10,310	1,054,816.10	9.81
2	113021	中信转债	8,200	860,918.00	8.01
3	113011	光大转债	6,330	745,800.60	6.94
4	108902	农发 1802	6,000	600,540.00	5.59
5	110053	苏银转债	4,210	466,720.60	4.34

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,949.12
2	应收证券清算款	38,250.97
3	应收股利	-
4	应收利息	42,531.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,731.96

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	1,054,816.10	9.81
2	113021	中信转债	860,918.00	8.01
3	113011	光大转债	745,800.60	6.94
4	110053	苏银转债	466,720.60	4.34
5	113013	国君转债	183,555.00	1.71
6	113026	核能转债	171,873.00	1.60
7	127005	长证转债	157,819.20	1.47
8	127015	希望转债	128,943.20	1.20
9	127012	招路转债	108,960.80	1.01
10	128102	海大转债	106,326.00	0.99
11	110051	中天转债	102,873.20	0.96
12	110061	川投转债	102,756.50	0.96
13	113020	桐昆转债	93,067.70	0.87
14	110043	无锡转债	83,005.80	0.77
15	110067	华安转债	82,785.20	0.77
16	110062	烽火转债	79,314.60	0.74
17	113008	电气转债	75,516.00	0.70
18	110065	淮矿转债	69,856.00	0.65
19	110048	福能转债	69,666.00	0.65
20	113014	林洋转债	69,041.70	0.64
21	128081	海亮转债	68,679.60	0.64

22	128048	张行转债	65,164.00	0.61
23	110047	山鹰转债	64,635.20	0.60
24	110066	盛屯转债	61,355.00	0.57
25	113024	核建转债	60,864.40	0.57
26	113009	广汽转债	57,645.00	0.54
27	113029	明阳转债	55,132.70	0.51
28	128085	鸿达转债	54,682.20	0.51
29	127006	敖东转债	54,493.50	0.51
30	110031	航信转债	54,165.00	0.50
31	113032	桐 20 转债	54,040.50	0.50
32	113543	欧派转债	53,935.20	0.50
33	128035	大族转债	52,523.10	0.49
34	110063	鹰 19 转债	50,310.00	0.47
35	128029	太阳转债	48,633.00	0.45
36	128095	恩捷转债	48,113.40	0.45
37	113508	新风转债	47,426.00	0.44
38	110068	龙净转债	46,250.40	0.43
39	110041	蒙电转债	44,908.00	0.42
40	113545	金能转债	44,764.00	0.42
41	128098	康弘转债	43,618.60	0.41
42	113025	明泰转债	43,387.50	0.40
43	110064	建工转债	42,877.80	0.40
44	128034	江银转债	40,876.60	0.38
45	110056	亨通转债	40,825.80	0.38
46	110057	现代转债	38,488.00	0.36
47	128097	奥佳转债	37,793.60	0.35
48	110034	九州转债	36,662.40	0.34
49	110052	贵广转债	34,492.80	0.32
50	110060	天路转债	33,829.60	0.31
51	113017	吉视转债	33,799.40	0.31
52	113534	鼎胜转债	31,647.70	0.29
53	128078	太极转债	31,128.00	0.29
54	110033	国贸转债	29,424.60	0.27

55	127011	中鼎转 2	29,020.00	0.27
56	128096	奥瑞转债	28,533.80	0.27
57	128075	远东转债	28,487.80	0.27
58	128046	利尔转债	28,138.20	0.26
59	128019	久立转 2	28,003.66	0.26
60	110058	永鼎转债	27,928.80	0.26
61	127013	创维转债	27,921.40	0.26
62	127007	湖广转债	27,799.11	0.26
63	113562	璞泰转债	27,568.00	0.26
64	110055	伊力转债	27,321.80	0.25
65	128032	双环转债	26,222.50	0.24
66	128058	拓邦转债	25,462.00	0.24
67	128026	众兴转债	25,440.00	0.24
68	128083	新北转债	25,417.30	0.24
69	128028	赣锋转债	25,394.40	0.24
70	123035	利德转债	24,632.00	0.23
71	128017	金禾转债	24,522.50	0.23
72	128065	雅化转债	24,406.00	0.23
73	128074	游族转债	24,058.00	0.22
74	113504	艾华转债	23,511.60	0.22
75	113571	博特转债	23,280.00	0.22
76	128057	博彦转债	22,886.00	0.21
77	113550	常汽转债	22,100.80	0.21
78	128099	永高转债	21,928.30	0.20
79	123044	红相转债	21,225.00	0.20
80	113516	苏农转债	21,054.00	0.20
81	113549	白电转债	20,499.10	0.19
82	113563	柳药转债	20,112.70	0.19
83	113537	文灿转债	20,100.80	0.19
84	113505	杭电转债	19,421.80	0.18
85	128018	时达转债	19,406.60	0.18
86	128071	合兴转债	19,042.50	0.18
87	110038	济川转债	19,029.80	0.18

88	113542	好客转债	18,494.40	0.17
89	113541	荣晟转债	18,141.00	0.17
90	113530	大丰转债	17,578.00	0.16
91	128021	兄弟转债	16,706.20	0.16
92	127014	北方转债	16,309.50	0.15
93	113525	台华转债	16,258.20	0.15
94	113557	森特转债	16,185.00	0.15
95	113559	永创转债	16,108.40	0.15
96	113012	骆驼转债	16,059.00	0.15
97	113532	海环转债	15,648.00	0.15
98	113528	长城转债	15,384.00	0.14
99	113569	科达转债	15,213.00	0.14
100	128033	迪龙转债	15,165.00	0.14
101	128037	岩土转债	14,635.50	0.14
102	123022	长信转债	14,574.60	0.14
103	128066	亚泰转债	14,518.40	0.14
104	128049	华源转债	14,492.40	0.13
105	123046	天铁转债	13,841.10	0.13
106	123036	先导转债	13,810.00	0.13
107	113553	金牌转债	13,386.00	0.12
108	123030	九洲转债	13,071.60	0.12
109	123033	金力转债	12,563.10	0.12
110	123017	寒锐转债	12,550.00	0.12
111	113556	至纯转债	12,353.40	0.11
112	123028	清水转债	12,333.20	0.11
113	123010	博世转债	12,063.70	0.11
114	113535	大业转债	12,008.40	0.11
115	128093	百川转债	11,833.80	0.11
116	128042	凯中转债	11,778.80	0.11
117	128090	汽模转 2	11,530.00	0.11
118	113561	正裕转债	11,049.00	0.10
119	123027	蓝晓转债	10,969.80	0.10
120	128050	钧达转债	10,959.00	0.10

121	113509	新泉转债	10,942.50	0.10
122	128063	未来转债	10,783.00	0.10
123	128014	永东转债	10,238.00	0.10
124	128072	翔鹭转债	10,136.00	0.09
125	128082	华锋转债	9,991.80	0.09
126	123025	精测转债	9,898.40	0.09
127	113564	天目转债	9,869.60	0.09
128	128069	华森转债	9,629.10	0.09
129	128025	特一转债	9,534.60	0.09
130	128056	今飞转债	9,449.60	0.09
131	113565	宏辉转债	9,305.60	0.09
132	123038	联得转债	8,962.80	0.08
133	128101	联创转债	8,749.60	0.08
134	123002	国祯转债	8,591.10	0.08
135	123007	道氏转债	8,584.80	0.08
136	113548	石英转债	8,416.20	0.08
137	113524	奇精转债	8,386.40	0.08
138	128079	英联转债	8,335.60	0.08
139	123045	雷迪转债	8,042.30	0.07
140	113572	三祥转债	8,040.20	0.07
141	128040	华通转债	7,956.20	0.07
142	113030	东风转债	7,903.00	0.07
143	113568	新春转债	7,393.40	0.07
144	123047	久吾转债	7,125.60	0.07
145	123039	开润转债	6,941.40	0.06
146	123043	正元转债	6,940.20	0.06
147	128094	星帅转债	6,733.20	0.06
148	113570	百达转债	6,412.20	0.06
149	123011	德尔转债	6,229.80	0.06
150	113546	迪贝转债	5,256.00	0.05
151	128070	智能转债	5,222.50	0.05
152	123012	万顺转债	5,055.60	0.05

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,470,400.82	99.28
	其中：债券	17,470,400.82	99.28
	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	52,107.30	0.30
8	其他资产	73,923.78	0.42
9	合计	17,596,431.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,002,800.00	5.75
	其中：政策性金融债	1,002,800.00	5.75

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）	16,467,600.82	94.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,470,400.82	100.11

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	16,390	1,701,937.60	9.75
2	113021	中信转债	13,200	1,404,612.00	8.05
3	113011	光大转债	10,160	1,241,348.80	7.11
4	108902	农发 1802	10,000	1,002,800.00	5.75
5	110053	苏银转债	6,600	723,360.00	4.15

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,119.82
2	应收证券清算款	11,925.34
3	应收股利	-
4	应收利息	57,778.67
5	应收申购款	99.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,923.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	1,701,937.60	9.75
2	113021	中信转债	1,404,612.00	8.05
3	113011	光大转债	1,241,348.80	7.11
4	110053	苏银转债	723,360.00	4.15
5	123041	东财转 2	453,884.90	2.60
6	113013	国君转债	278,208.00	1.59
7	127005	长证转债	277,044.40	1.59
8	113026	核能转债	264,883.20	1.52
9	127015	希望转债	233,973.60	1.34
10	113020	桐昆转债	189,551.80	1.09
11	127012	招路转债	172,298.40	0.99

12	113008	电气转债	169,682.10	0.97
13	110051	中天转债	160,632.20	0.92
14	110061	川投转债	157,042.80	0.90
15	110042	航电转债	155,749.00	0.89
16	113022	浙商转债	152,508.00	0.87
17	113014	林洋转债	148,642.00	0.85
18	110062	烽火转债	147,952.70	0.85
19	128084	木森转债	138,264.00	0.79
20	110048	福能转债	129,895.30	0.74
21	128048	张行转债	120,110.04	0.69
22	128081	海亮转债	113,287.20	0.65
23	110031	航信转债	112,480.00	0.64
24	110043	无锡转债	112,058.10	0.64
25	113028	环境转债	110,292.00	0.63
26	113024	核建转债	107,731.80	0.62
27	110065	淮矿转债	102,766.30	0.59
28	128035	大族转债	100,285.20	0.57
29	113019	玲珑转债	94,829.00	0.54
30	113009	广汽转债	91,593.60	0.52
31	110063	鹰 19 转债	90,896.00	0.52
32	128085	鸿达转债	87,368.00	0.50
33	110047	山鹰转债	86,457.60	0.50
34	127006	敖东转债	86,036.00	0.49
35	113545	金能转债	75,572.90	0.43
36	113543	欧派转债	75,222.90	0.43
37	113508	新风转债	75,047.00	0.43
38	113029	明阳转债	74,670.40	0.43
39	113025	明泰转债	74,145.50	0.42
40	113518	顾家转债	72,196.00	0.41
41	110056	亨通转债	71,340.00	0.41
42	128034	江银转债	71,264.00	0.41
43	113031	博威转债	70,614.50	0.40
44	110041	蒙电转债	70,239.80	0.40

45	110057	现代转债	62,455.20	0.36
46	110034	九州转债	62,015.30	0.36
47	110064	建工转债	61,235.10	0.35
48	128029	太阳转债	60,836.00	0.35
49	128078	太极转债	58,896.00	0.34
50	113550	常汽转债	57,475.00	0.33
51	110052	贵广转债	56,450.00	0.32
52	128075	远东转债	54,628.00	0.31
53	128092	唐人转债	54,519.70	0.31
54	128086	国轩转债	53,797.50	0.31
55	113017	吉视转债	53,331.20	0.31
56	128074	游族转债	53,163.60	0.30
57	127011	中鼎转 2	51,234.50	0.29
58	113534	鼎胜转债	50,786.40	0.29
59	113516	苏农转债	50,750.60	0.29
60	110060	天路转债	49,964.40	0.29
61	113547	索发转债	49,509.90	0.28
62	127007	湖广转债	48,875.40	0.28
63	123036	先导转债	48,072.60	0.28
64	110033	国贸转债	45,012.00	0.26
65	113504	艾华转债	44,745.00	0.26
66	113544	桃李转债	44,685.30	0.26
67	128019	久立转 2	44,464.40	0.25
68	110058	永鼎转债	44,362.50	0.25
69	128026	众兴转债	43,692.00	0.25
70	128028	赣锋转债	42,513.40	0.24
71	127013	创维转债	42,136.50	0.24
72	128046	利尔转债	42,063.00	0.24
73	113542	好客转债	40,806.00	0.23
74	128083	新北转债	40,152.00	0.23
75	113549	白电转债	39,903.50	0.23
76	113562	璞泰转债	39,555.00	0.23
77	110055	伊力转债	38,724.00	0.22

78	113563	柳药转债	37,458.00	0.21
79	128065	雅化转债	37,272.00	0.21
80	128057	博彦转债	36,516.00	0.21
81	128071	合兴转债	34,728.00	0.20
82	123035	利德转债	31,746.00	0.18
83	128032	双环转债	31,696.00	0.18
84	113530	大丰转债	31,530.00	0.18
85	128058	拓邦转债	31,497.48	0.18
86	128018	时达转债	30,897.00	0.18
87	123017	寒锐转债	29,328.00	0.17
88	128067	一心转债	29,040.00	0.17
89	128017	金禾转债	28,586.00	0.16
90	113505	杭电转债	26,762.50	0.15
91	128021	兄弟转债	26,136.00	0.15
92	110038	济川转债	25,854.40	0.15
93	128033	迪龙转债	25,692.50	0.15
94	113537	文灿转债	23,890.00	0.14
95	127014	北方转债	23,308.00	0.13
96	113559	永创转债	22,680.00	0.13
97	113525	台华转债	22,438.00	0.13
98	123033	金力转债	22,383.00	0.13
99	123022	长信转债	22,358.40	0.13
100	113557	森特转债	22,018.00	0.13
101	123028	清水转债	21,810.00	0.12
102	113012	骆驼转债	21,252.00	0.12
103	113528	长城转债	21,152.00	0.12
104	128093	百川转债	19,846.80	0.11
105	113554	仙鹤转债	19,823.10	0.11
106	128037	岩土转债	19,710.00	0.11
107	113553	金牌转债	19,500.60	0.11
108	113556	至纯转债	19,200.00	0.11
109	113509	新泉转债	19,159.00	0.11
110	123002	国祯转债	19,071.00	0.11

111	123010	博世转债	18,307.20	0.10
112	113535	大业转债	17,894.20	0.10
113	113541	荣晟转债	17,878.50	0.10
114	128090	汽模转 2	17,752.50	0.10
115	113532	海环转债	16,258.50	0.09
116	128042	凯中转债	15,577.80	0.09
117	128049	华源转债	15,457.00	0.09
118	128066	亚泰转债	15,211.30	0.09
119	123025	精测转债	14,017.00	0.08
120	113548	石英转债	12,892.00	0.07
121	123007	道氏转债	12,448.70	0.07
122	128056	今飞转债	12,216.60	0.07
123	113030	东风转债	11,880.00	0.07
124	123039	开润转债	11,875.00	0.07
125	113561	正裕转债	11,862.00	0.07
126	128050	钧达转债	11,457.00	0.07
127	113524	奇精转债	10,935.00	0.06
128	123027	蓝晓转债	10,872.00	0.06
129	128072	翔鹭转债	10,749.00	0.06
130	128082	华锋转债	10,641.60	0.06
131	128094	星帅转债	10,599.30	0.06
132	128014	永东转债	10,415.00	0.06
133	128070	智能转债	9,315.20	0.05
134	123038	联得转债	9,229.50	0.05
135	128079	英联转债	9,187.50	0.05
136	113546	迪贝转债	9,092.00	0.05
137	123011	德尔转债	8,675.20	0.05
138	128040	华通转债	8,250.90	0.05
139	123012	万顺转债	6,897.50	0.04

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金转型生效日（2020年8月12日）基金份额总额	15,817,641.22
基金转型生效日起至报告期期末基金总申购份额	46,190.64
减：基金转型生效日起至报告期期末基金总赎回份额	5,781,601.69
基金转型生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	10,082,230.17

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、报告周期为2020年8月12日到2020年9月30日。本基金转换基准日为2020年8月11日。东吴转债份额的场内份额、可转债A份额、可转债B份额将最终转换为东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额的场内份额，东吴转债份额的场外份额将最终转换为东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额的场外份额。转换后东吴转债场内份额为13,632,259.00份，东吴转债场外份额为2,185,382.22份。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	可转债 A	可转债 B	东吴转债
报告期期初基金份额总额	8,354,994.00	3,580,711.00	5,380,525.40
报告期期间基金总申购份额	-	-	62,635.39
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	1,561,326.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-370,377.00	-158,733.00	529,110.00
报告期期末基金份额总额	7,984,617.00	3,421,978.00	4,410,944.22

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、报告周期为2020年7月1日到2020年8月11日。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20200819-20200930	2,651,996.00	0.00	0.00	2,651,996.00	26.30%
个人	1	20200810-20200818	3,156,894.00	0.00	3,156,894.00	0.00	0.00%

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议》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》、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》自同一日起失效。

自 2020 年 8 月 12 日起，本基金的基金名称由“东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金”变更为“东吴中证可转换债券指数证券投资基金”。东吴中证可转换债券指数证券投资基金的场外简称为“东吴中证可转债指数”，场内简称仍为“东吴转债”，基金代码仍为“165809”。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、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变更注册的批复文件；
- 3、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》；
- 4、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》；
- 5、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》；
- 6、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议》；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 8、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。

9.2 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。

9.3 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
2020 年 10 月 28 日