

估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

本基金投资于境内基金或资产，其估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价，在持有期间按平均法摊销，每日计提损益。

3.2 本基金投资的前十名证券的发行主体未受到监管部门公开谴责或行政处罚的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在报告编制日的一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未发生公开谴责、处罚。

3.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	存出保证金	97,067.91	
2	应收证券清算款	672,750.00	
3	应收利息	22,287,186.81	
4	应收申购款	63,466,365.00	

5	其他应收款	—
6	待摊费用	—

7	其他					
8	合计			86,523,360.92		
3.3 关联投资情况(报告期内其他关联方持有本基金份额)						
本基金不存在关联投资情况, 本基金关联方持有本基金份额不存在异常。						
5.9 基金份额持有人信息						
截至本报告期末基金份额持有人户数及持有人结构				份额单位: 份		
份额持有人户数(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	
东吴基金A	16,374	14,001.85	7,970,923.82	3.46%	222,769,023.90	96.56%
东吴基金B						
东吴基金C	75	78,527,763.07	5,586,464,085.17	96.01%	204,119,645.39	4.99%
东吴基金D						
合 计	16,443	372,076.77	5,603,435,008.99	91.56%	516,838,667.29	8.44%
注: 上表合计数, 比例的分母采用上述各基金份额的合计数。						
注: 上表合计数, 比例的分母采用上述各基金份额的合计数。						

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	1,000,000,000.00	16.34%

2	其他机构	648,162,321.71	10.50%
3	其他机构	549,742,688.17	8.98%
4	其他机构	501,388,995.67	8.19%
5	保险类机构	500,485,983.19	8.18%
6	其他机构	250,000,000.00	4.08%
7	银行类机构	202,777,991.28	3.31%
8	银行类机构	200,160,498.82	3.27%
9	券商类机构	150,000,000.00	2.45%

10	其他机构	144,384,871.56	2.36%
----	------	----------------	-------

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	东兴资管A	94,191.93	0.0015%
	东兴资管B	—	—
	合计	94,191.93	0.0015%

④ 期末基金管理人及关联方持有本基金及基金管理人旗下其他理财产品情况

注：高级管理人员、基金投资和研究人员及其近亲属及其控制的法人未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴资管A	东兴资管B
基金合同生效日（2010年5月11日）基金份额总额	1,474,241,698.52	2,969,332,679.75

本报告期期初基金份额总额	117,388,274.69	10,187,113,414.59
本报告期期间基金总申购份额	518,384,873.50	64,289,333,234.89

本公司报告期内基金已赎回份额	409,033,202.47	68,580,982,918.02
本公司报告期内基金净申购/赎回份额（份额减少以“-”号填列）	1,000,000,000.00	165,419,017,081.98
本公司报告期内基金净申购/赎回金额（金额减少以“-”号填列）	230,739,948.72	5,889,583,720.64
本公司报告期内基金净申购/赎回金额占基金资产净值的比例	0.0012%	0.0027%

报告期内基金已赎回份额在上市期间，均按照赎回款项到账日期赎回，基金赎回款项到账日期与赎回份额到账日期存在差异。

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

##### 11.1.1 基金份额持有人大会决议

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、基金销售机构的重大人事变动

报告期内未发生基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动。

本基金管理人于2018年03月24日发布公告，徐华女士不再担任公司副总经理职务，由周国先生担任公司副总经理，同日周国先生与周国先生已签署股权转让协议。本基金管理人于2018年03月24日发布公告，徐华女士不再担任公司副总经理职务，同日周国先生与周国先生已签署股权转让协议。上述人事变动已由周国先生担任公司副总经理职务，同时周力女士不再担任公司董事职务，上述人事变动已向相关监管机构备案，公告。

报告期内未发生基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

[illegible]

券商名称	交易单元 数量	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	备注
------	------------	------	----------------------	----	----------------	----

华泰联合	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中航证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
中国银河	2	—	—	—	—	—
国联证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—

宏源证券	1	—	—	—	—	—
宏源证券	1	—	—	—	—	—
华信证券	1	—	—	—	—	—
华信证券	1	—	—	—	—	—

[illegible]

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。

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	成交金额占当期债券总成交金额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总金额的比例	成交金额	占当期权证成交总金额的比例
华泰联合	--	--	5,349,000.00	10.30%	--	--
招商证券	--	--	--	--	--	--
平安证券	--	--	--	--	--	--

东北证券	000	000	000	000	000	000
中银国际	000	000	000	000	000	000
川财证券	000	000	000	000	000	000

方正证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申银证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
万联证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
晋能证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
财通证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国元证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—	—	—	—

东兴证券	...	...	...	...	...	...
东方证券	...	...	...	...	...	...
中信建投	...	...	...	...	...	...

广发证券	---	---	---	---
广发证券	---	---	---	---
国海证券	---	---	---	---
申银万国	---	---	---	---
中金公司	---	---	---	---
长江证券	---	---	---	---
平安证券	---	---	---	---
东吴证券	---	---	---	---
32,000	1,860,460	100.00%	46,504,367	83.70%
			100,000	

本基金本报告期无个股涨幅绝对超过20%的情况

《12 报告期内无个股涨幅绝对超过15% (含) 以上的情况。

《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

	报告期内持有基金份额变化情况	报告期内持有基金份额情况
投		
持有基金		

序号	份额比例达到或者超过20%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
----	---------------	------	------	------	------	------

机构	时间区间					
1	20180600 -	0.00	1,017.736, 902.94	1,017.736, 902.94	0.00	0.00%
	20180613					
2	20180103 -	3,003,201, 767.47	42,343,771.16	3,045.738, 538.63	0.00	0.00%
	20180110					
3	20180126 -	3,003,201, 767.47	42,343,771.16	3,045.738, 538.63	0.00	0.00%
	20180411					
4	20180425 -	3,003,201, 767.47	42,343,771.16	3,045.738, 538.63	0.00	0.00%
	20180600					

	7						

无	产品持有风险
1. 巨额赎回风险 (1) 本基金单一投资者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卖出流动性资产以应对赎回款的需求,进而对基金的投资运作造成负面影响并产生较大损失。 (2) 本基金单一投资者持有的基金份额或基金份额占比过大,导致基金管理人被迫或主动采取流动性风险管理措施,如基金管理人认为有必要,可能采取暂停基金赎回申请的措施,投资者可能因此无法赎回持有的基金份额;如流动性支持手段以上(含)发生巨额赎回,基金管理人可依据《基金合同》约定的暂停赎回或延缓支付赎回款项的措施,对除该基金份额持有人以外的其他基金份额持有人采取暂停赎回或延缓支付赎回款项的措施。 (3) 本基金单一投资者持有基金份额达到或超过本基金总份额的百分之十,本基金基金管理人有权采取以下措施: ① 单一投资者巨额赎回时,若本基金发生赎回下月日基金净值前持有人少于200人或总资产净值低于0.70%的情况,基金管理人应当与中国证监会指定估值方商定,就本基金估值方式,特例采用“后进先出”原则,对赎回基金份额进行估值。 ② 单一投资者巨额赎回时,按照赎回份额占赎回总份额的比例,对赎回基金份额进行估值。 ③ 其他措施	

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标及投资策略。

目的及投资策略。	
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	
无。	

东吴基金管理有限公司  
2019年3月29日