东吴优信稳健债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年八月二十九日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴优信稳健债券	
基金主代码	582001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年11月5日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,688,321.54份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
下属分级基金的交易代码:	582001	582201
报告期末下属分级基金的份额总额	11,419,768.18份	2,268,553.36份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于债券型基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,在精选高信用等级债券基础上通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。
投资策略	本基金是一只债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅的原则构建和管理投资组合。对于债券投资,本基金通过对利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的分析,确定本基金债券组合久期和期限结构配置。债券选择上,本基金根据债券信用风险特征、到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析,并考虑债券流动性和操作策略,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为债券投资的有益补充,主要采取自下而上的策略精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金主要投资于高信用级别、投资价值高的债券资产,属证券投资基金中的低风险品种,长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	田青
	联系电话	021-50509888-8206	010-67595096
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§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

基金级别	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	280,709.60	-17,908.65
本期利润	1,009,402.44	-3,318.75
加权平均基金份额本期利润	0.0289	-0.0030
本期基金份额净值增长率	1.90%	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0861	0.0474
期末基金资产净值	13,234,803.69	2,538,307.18
期末基金份额净值	1.1589	1.1189

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

东吴优信稳健债券A

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	-0.91%	0.38%	0.67%	0.06%	-1.58%	0.32%
过去三个月	-1.21%	0.31%	2.16%	0.10%	-3.37%	0.21%
过去六个月	1.90%	0.32%	4.35%	0.08%	-2.45%	0.24%
过去一年	3.18%	0.26%	4.21%	0.07%	-1.03%	0.19%
过去三年	0.77%	0.33%	10.99%	0.08%	-10.22%	0.25%
自基金合同生效起至今	17.26%	0.31%	42.09%	0.08%	-24.83%	0.23%

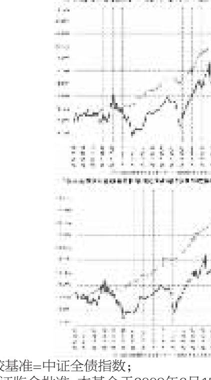
东吴优信稳健债券C

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	-0.93%	0.38%	0.67%	0.06%	-1.60%	0.32%
过去三个月	-1.36%	0.31%	2.16%	0.10%	-3.52%	0.21%
过去六个月	1.66%	0.32%	4.35%	0.08%	-2.69%	0.24%
过去一年	2.72%	0.26%	4.21%	0.07%	-1.49%	0.19%
过去三年	-0.42%	0.33%	10.99%	0.08%	-11.41%	0.25%
自基金合同生效起至今	10.81%	0.32%	38.33%	0.08%	-27.52%	0.24%

注:1、比较基准=中证全债指数;

2、本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类。

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



注:1.比较基准=中证全债指数;

2.经中国证监会批准,本基金于2009年6月15日分为A、C两类,具体内容详见本基金管理人于2009年6月11日刊登的《关于东吴优信稳健债券型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》。

§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,统一社会信用代码913100007664967591。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2018年6月30日,公司管理的资产规模合计676.03亿元,其中,公募资产管理规模(含货币基金)292.19亿元,专户资产管理规模294.61亿元、专项资产管理规模89.23亿元。管理各类产品134只,其中,公募基金28只,专户产品63只,子公司资产计划43只,形成了高中低不同风险层次的多元化产品线。

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:一是权益投资坚持自下而上精选优质成长股的投资风格,把握中国经济转型升级机遇;二是绝对收益提倡"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;三是固定收益以稳健为本,兼顾收益率和流动性,为大类资产配置提供基础性工具。尤其是2015年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,引入了量化投资策略,发行了多只量化公募产品,并在业内率先成立了绝对收益部。2017年,公司对投研模块进行了变革,引进了彭敢等公募行业领军人物,投研磨合红利已开始显现,尤其是固定收益投资崭露头角。

近年来,公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩,斩获了诸多奖项,比如第十五届"金基金"奖债券基金奖*东吴增利债券基金(《上海证券报》)、2017年度三年持续回报普通债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2017年度最受欢迎新发基金*东吴双三角股票型基金 (东方财富风云榜)、2016年度积极债券型明星基金*东吴增利债券基金 (《证券时报》)、2016年度最受欢迎债券类基金*东吴鼎利债券基金LOF(东方财富风云榜)等。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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6月28日	-	12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,其中,自2013年6月25日起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、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,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。
刘元海	权益投资部副总经理、基金经理	2017年2月9日	-	13年	刘元海,博士,同济大学毕业。2004年2月至2015年6月就职于东吴基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理等职务,2016年2月再次加入我司,现任权益投资部副总经理、基金经理,其中自2016年4月27日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2017年2月9日起担任东吴优信稳健债券投资基金基金经理。其中,2011年10月26日至2015年5月29日担任东吴新产业精选混合型证券投资基金基金经理,2013年01月30日至2015年5月29日担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理,2014年1月13日至2015年5月29日担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理,2012年03月13日至2013年06月05日担任东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。)

注:1、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金因持有的个别债券连续停牌,出现连续十个交易日以上持有一家公司发行的证券市值被动超过基金资产净值10%的情形。除此之外,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

年初债券市场收益率延续攀升,随着跨年后资金面宽松,短久期品种收益率率先见顶回落。12月金融数据发布后,市场对经济基本面预期下降,海内外权益市场大幅下跌使得市场风险偏好回落,中长端利率债收益率开启下行。3月下旬美国总统特朗普关于"贸易战"的表述和措施使得市场进一步调低经济基本面预期与风险偏好,中长端利率债继续大幅下行,并回落至去年11月左右水平,期限利差也重归收窄。进入二季度,经济数据显示基本面韧性仍较强,地产投资增速处相对高位,但在资管新规等政策引导下,融资数据出现较明显回落。4月17日央行宣布以降准置换中期借贷便利并额外释放增量资金,触发收益率大幅下行,之后由于既存在经济数据边际转弱等利好因素, 又存在资金面阶段性紧张、资管新规发布等利空因素,债券市场转为震荡。6月中旬后,随着中美贸易争端发酵及权益市场大幅下跌,收益率再度大幅回落。整体来看,2018年上半年债券市场收益率较明显下行。

高等级信用债跟随资金面和利率债,表现为明显上涨。年初中低等级信用债的流动性较去年末有所恢复,短久期、较高收益且资质较好的中低等级信用债收益率有明显下行,但随着金融监管政策的收紧,二季度中低等级信用债以调整为主,信用利差较大幅度上行。

本基金在报告期内维持中性杠杆,适度提升久期水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴优信稳健债券A基金份额净值为1.1589元, 本报告期基金份额净值增长率为1.90%;截至本报告期末东吴优信稳健债券C基金份额净值为1.1189元, 本报告期基金份额净值增长率为1.66%; 同期业绩比较基准收益率为4.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

监管政策的大幅收紧导致融资快速萎缩, 对宏观经济及微观企业带来一定负面溢出影响,同时中美贸易争端这一新增外部变量也带来一定的不确定性。从6月开始,金融监管政策与财政货币政策开始出现边际放松,包括MLF担保品范围扩大、准备金率下调及对小微企业支持力度提升,加快推进债转股和加大信贷投放力度等措施。7月23日国务院常务会议部署更好发挥财政金融政策作用,支持扩内需调结构促进实体经济发展。因此我们判断,伴随下半年政策的边际宽松,经济仍将维持较强的韧性,局部还将有所改善,且市场风险偏好将回升,债券市场收益率下行的驱动力趋于弱化。

操作策略方面,我们将保持对市场的密切跟踪,灵活调整组合杠杆和久期。

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,成员由公司副总经理、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组成,同时,督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

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。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算,并参与公司对基金的估值方法的计算;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2018年4月4日至2018年6月30日出现基金资产净值连续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, 中国建设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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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:东吴优信稳健债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	1,091,980.52	87,267.31
结算备付金	345,829.72	902,875.34
存出保证金	22,554.41	14,836.94
交易性金融资产	15,888,090.17	52,772,062.28
其中:股票投资	2,835,712.00	8,743,410.00
基金投资	-	-
债券投资	13,052,378.17	44,028,652.28
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,357,863.59
应收利息	317,262.50	1,213,345.08
应收股利	-	-
应收申购款	397.46	199.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	17,666,114.78	56,348,449.90
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	400,000.00	-
应付证券清算款	1,001,097.43	-
应付赎回款	69,977.02	100,244.37
应付管理人报酬	8,478.83	29,318.50
应付托管费	2,608.85	9,021.08
应付销售服务费	839.95	306.70
应付交易费用	29,372.69	49,673.35
应交税费	326,395.17	324,540.00
应付利息	-365.81	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	54,599.78	50,000.11
负债合计	1,893,003.91	563,104.11
所有者权益:		
实收基金	13,688,321.54	49,078,883.34
未分配利润	2,084,789.33	6,706,462.45
所有者权益合计	15,773,110.87	55,785,345.79
负债和所有者权益总计	17,666,114.78	56,348,449.90

注: 本基金为分级基金, 报告截止日2018年6月30日, 份额总额为13,688,321.54份, 其中东吴优信稳健债券A基金份额净值1.1589元, 基金份额总额11,419,768.18份;东吴优信稳健债券C基金份额净值1.1189元,基金份额总额2,268,553.36份。

6.2 利润表

会计主体:东吴优信稳健债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	1,467,655.35	902,901.51
1.利息收入	1,119,015.59	1,024,945.00
其中:存款利息收入	9,151.67	5,051.83
债券利息收入	1,109,863.92	1,018,885.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,007.28
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-404,266.56	-40,663.53
其中:股票投资收益	523,885.74	23,207.11
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-941,692.30	-63,870.64
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,540.00	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	743,282.74	-81,484.22
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	9,623.58	104.26
减:二、费用	461,571.66	382,164.39
1. 管理人报酬	135,530.90	98,576.33
2. 托管费	41,701.80	30,331.14
3. 销售服务费	2,416.31	1,542.42
4. 交易费用	122,313.08	77,778.67
5. 利息支出	82,543.69	110,569.17
其中:卖出回购金融资产支出	82,543.69	110,569.17
6. 税金及附加	3,487.62	-
7. 其他费用	73,578.26	63,366.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,006,083.69	520,737.12
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,006,083.69	520,737.12

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东吴优信稳健债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	49,078,883.34	6,706,462.45	55,785,345.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,006,083.69	1,006,083.69
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)	-35,390,561.80	-5,627,756.81	-41,018,318.61
其中:1.基金申购款	6,522,804.33	991,280.30	7,514,084.63
2.基金赎回款	-41,913,366.13	-6,619,037.11	-48,532,403.24
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)	13,688,321.54	2,084,789.33	15,773,110.87
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	27,811,534.41	2,874,917.57	30,686,451.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	520,737.12	520,737.12
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)	-432,437.02	-45,014.80	-477,451.82
其中:1.基金申购款	446,909.90	46,127.91	493,037.81
2.基金赎回款	-879,346.92	-91,142.71	-970,489.63
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)	27,379,097.39	3,350,639.89	30,729,737.28

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:

______王炯______ ______徐明______ ____吴婷____

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

东吴优信稳健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证监许可[2008]1048号文《关于核准东吴优信稳健债券型证券投资基金募集的批复》的核准向社会公开发行募集,募集期为2008年10月6日至2008年10月31日。经江苏公证天业会计师事务所有限公司验资,首次募集的净认购金额为1,481,291,890.04 人民币元,利息为439,198.30 人民币元,首次募集有效认购户数为8722 户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本息合计募集基金份额总额为1,481,731,088.34 份。经向中国证监会备案,本基金合同于2008年11月5日正式生效。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和注册登记人为东吴基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益品种,债券投资比例为80%-95%,股票投资比例为0%-20%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金业绩比较基准=中证全债指数

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2018年6月30日的财务状况以及2018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(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3.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。

4.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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金注册与过户登 记人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	77,991,191.48	99.28%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	70,469,060.84	98.60%	2,681,467.61	24.98%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	445,800,000.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	71,846.87	99.29%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-

注: 上述佣金按市场佣金率计算, 扣除券商需承担的费用, 包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等。管理人因此从关联方获得的服务主要包括: 为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	135,530.90	98,576.33
其中: 支付销售机构的客户维护费	3,300.88	2,971.43

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.65%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.65%÷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,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	41,701.80	30,331.14

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×0.20%÷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,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C	合计
中国建设银行股份有限公司	-	594.41	594.41
东吴基金管理有限公司	-	847.91	847.91
东吴证券股份有限公司	-	96.74	96.74
合计	-	1,539.06	1,539.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C	合计
中国建设银行股份有限公司	-	660.74	660.74
东吴基金管理有限公司	-	27.05	27.05
东吴证券股份有限公司	-	92.28	92.28
合计	-	780.07	780.07

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,本基金的A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.40%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
基金合同生效日(2008年11月5日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	7,915,099.94	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,915,099.94	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	69.3105%	-

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
基金合同生效日(2008年11月5日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	7,915,099.94	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,915,099.94	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	29.6600%	-

注:1、本关联方投资本基金的费率是公允的,均遵照本基金公告的费率执行。

2、本基金于2008年11月5日成立,自2009年6月15日分为A、C两类。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,091,980.52	4,578.95	153,664.79	723.78

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券清算款余额400,000.00元,于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,835,712.00	16.05
	其中:股票	2,835,712.00	16.05
2	固定收益投资	13,052,378.17	73.88
	其中:债券	13,052,378.17	73.88
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,437,810.24	8.14
7	其他各项资产	340,214.37	1.93
8	合计	17,666,114.78	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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,590,302.00	10.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	334,450.00	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	197,700.00	1.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	713,260.00	4.52
S	综合	-	-
	合计	2,835,712.00	17.98

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002343	慈文传媒	38,000	713,260.00	4.52
2	600535	天士力	8,000	206,560.00	1.31
3	300059	东方财富	15,000	197,700.00	1.25
4	603799	华友钴业	2,000	194,940.00	1.24
5	300413	快乐购	5,000	189,700.00	1.20
6	002340	格林美	30,000	181,500.00	1.15
7	600521	华海药业	6,800	181,492.00	1.15
8	600702	舍得酒业	5,000	180,450.00	1.14
9	600196	复星医药	4,000	165,560.00	1.05
10	002007	华兰生物	5,000	160,800.00	1.02

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.scfund.com.cn的半年度报告正文。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002343	慈文传媒	3,106,924.00	5.57
2	300059	东方财富	2,044,323.80	3.66
3	601599	鹿港文化	1,641,197.00	2.94
4	603589	口子窖	1,304,548.00	2.34
5	600172	黄河旋风	1,261,680.00	2.26
6	600029	南方航空	1,166,397.00	2.09
7	601607	上海医药	1,160,736.00	2.08
8	000858	五粮液	1,023,856.27	1.84
9	601328	交通银行	938,731.49	1.68
10	600977	中国电影	930,613.11	1.67
11	601288	农业银行	913,000.00	1.64
12	300336	新文化	897,549.00	1.61
13	600000	浦发银行	806,650.00	1.45
14	300024	机器人	798,750.40	1.43
15	600056	中国医药	795,400.00	1.43
16	000823	超声电子	715,295.00	1.28
17	002340	格林美	712,035.00	1.28
18	002466	天齐锂业	636,678.00	1.14
19	600782	新钢股份	617,650.00	1.11
20	600584	长电科技	587,600.00	1.05

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002343	慈文传媒	4,068,203.00	7.29
2	300059	东方财富	2,543,497.20	4.56
3	300336	新文化	2,437,626.00	4.37
4	603589	口子窖	2,378,258.40	4.26
5	600172	黄河旋风	2,007,828.12	3.60
6	600029	南方航空	1,747,123.00	3.13
7	601599	鹿港文化	1,640,384.00	2.94
8	601607	上海医药	1,151,415.00	2.06
9	000823	超声电子	1,128,759.00	2.02
10	000636	风华高科	1,082,042.00	1.94
11	000858	五粮液	1,001,480.00	1.80
12	601328	交通银行	981,180.00	1.76
13	600056	中国医药	967,910.00	1.74
14	600977	中国电影	962,426.00	1.73
15	601288	农业银行	930,000.00	1.67
16	000596	古井贡酒	820,300.00	1.47
17	600000	浦发银行	788,725.30	1.41
18	300024	机器人	780,850.00	1.40
19	600782	新钢股份	643,600.00	1.15
20	002466	天齐锂业	624,795.90	1.12

注:本项的 "卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	36,004,587.16
卖出股票收入(成交)总额	42,552,691.32

注:本项的 "买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	913,500.00	5.79
	其中:政策性金融债	913,500.00	5.79
4	企业债券	12,138,878.17	76.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,052,378.17	82.75

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	136192	16信威01	20,000	1,938,600.00	12.29
2	136378	16华泰01	13,000	1,270,880.00	8.06
3	122413	15精工债	11,560	1,145,480.40	7.26
4	136261	16长园01	10,000	995,300.00	6.31
5	112389	16华西02	10,000	988,800.00	6.27

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,554.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	317,262.50
5	应收申购款	397.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	340,214.37

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
东吴优信稳健债券A	1,026	11,130.38	7,915,949.67	69.32%	3,503,818.51	30.68%
东吴优信稳健债券C	200	11,342.77	1,774,465.44	78.22%	494,087.92	21.78%
合计	1,226	11,165.03	9,690,415.11	70.79%	3,997,906.43	29.21%

注:本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注:高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
基金合同生效日(2008年11月5日)基金份额总额	1,481,731,088.34	-
本报告期期初基金份额总额	48,201,275.80	877,607.54
本报告期基金总申购份额	4,267,077.96	2,255,726.37
减:本报告期基金总赎回份额	41,048,585.58	864,780.55
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	11,419,768.18	2,268,553.36

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、本基金于2008年11月5日成立,自2009年6月15日分为A、C两类。

§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发生以下人事变动:

2018年4月3日,徐军女士因工作调动辞去公司督察长职务,由吕晖先生担任公司督察长职务,同时吕晖先生辞去其所担任的公司副总经理职务。

本报告期内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相关诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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监管局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,上海证监局对公司采取责令改正的决定。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,针对性的制定、落实整改措施,并将及时向监管部门提交整改报告。

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。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
东吴证券	2	77,991,191.48	99.28%	71,846.87	99.29%	-
招商证券	1	566,087.00	0.72%	515.89	0.71%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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两个交易单元,分别为天风证券与国泰君安。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	70,469,060.84	98.60%	445,800,000.00	100.00%	-	-
招商证券	997,700.00	1.40%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180207 - 20180513	8,986,632.80	-	8,986,632.80	-	0.00%
	2	20180101 - 20180520	17,157,061.15	3,692,254.63	20,849,315.78	-	0.00%
	3	20180514 - 20180630	7,915,099.94	-	-	7,915,099.94	57.82%
	-	-	-	-	-	-	-
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。

东吴基金管理有限公司

2018年8月29日