

东吴中证可转换债券指数证券投资基金

清算报告

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

报告出具日：2021年8月16日

报告公告日：2021年8月31日

一、重要提示

东吴中证可转换债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型而来。原东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1471号《关于核准东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公开发行募集，《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》于2014年5月9日正式生效，首次设立募集规模为268,064,983.90份基金份额。东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会于2020年7月13日审议并通过《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》，《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）自2020年8月12日起生效。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为东吴基金管理有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条的规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由：有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的。”根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。经本基金基金份额持有人大会2021年7月27日表决通过，决定终止《基金合同》，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于2021年7月28日发布了《东吴基金管理有限公司关于东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自2021年7月29日起进入基金财产清算程序，基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	东吴中证可转换债券指数证券投资基金
基金简称	东吴中证可转债指数
基金代码	165809
基金运作方式	契约型开放式
基金转型生效日	2020年8月12日

<p>最后运作日基金份额总额 (2021年7月28日)</p>	<p>3,943,347.80 份</p>
<p>投资目标</p>	<p>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。</p>
<p>投资范围</p>	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券及其备选成份券、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债（含分离交易可转债）、地方政府债、政府机构债、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。</p>
<p>投资策略</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证可转换债券指数收益率×95% + 银行税后活期存款利率×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p>

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

三、基金运作情况

本基金由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型而来。原东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1471号文核准募集，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定向社会公开募集。《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》于2014年5月9日正式生效，首次设立募集规模为268,064,983.90份基金份额。东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会于2020年7月13日审议并通过《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》，《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》自2020年8月12日起生效。自2020年8月12日至2021年7月28日期间，本基金正常运作。

根据《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》、《基金合同》等有关规定，经本基金基金份额持有人大会于2021年7月27日表决通过，决定终止《基金合同》，并对本基金进行变现及清算。基金管理人于2021年7月28日发布《东吴基金管理有限公司关于东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金从2021年7月29日起进入清算期，清算终止日为2021年8月16日。

四、财务会计报告

最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：东吴中证可转换债券指数证券投资基金

报告截止日：2021年7月28日

单位：人民币元

	本期末 2021 年 7 月 28 日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	28,063.54
结算备付金	3,045.30
存出保证金	676.37
交易性金融资产	4,318,682.40
其中：债券投资	4,318,682.40
应收证券清算款	34,270.06
应收利息	18,083.26
资产总计	4,402,820.93
负债：	
应付赎回款	1,747.00

应付赎回费	0.93
应付管理人报酬	1,377.93
应付托管费	344.48
应付税费	18.73
应付指数使用费	53.50
应付审计费	20,000.00
负债合计	23,542.57
所有者权益：	
实收基金	4,971,999.23
未分配利润	-592,720.87
所有者权益合计	4,379,278.36
负债和所有者权益总计	4,402,820.93

注 报告截止日 2021 年 7 月 28 日(基金最后运作日) 基金份额净值 1.1105 元 基金份额总额为 3,943,347.80 份。

五、清算情况

自 2021 年 7 月 29 日至 2021 年 8 月 16 日止的清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 3,045.30 元，其中人民币 1,870.99 元已于 2021 年 8 月 3 日划入本基金托管户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 676.37 元，该款项已于 2021 年 8 月 3 日划入本基金托管户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 4,318,682.40 元，全部为债券投资，其明细如下：

单位：人民币元

债券代码	债券名称	数量(单位：张)	估值单价	成本	市值
110059	浦发转债	3,230	103.25	335,596.52	333,497.50
113021	中信转债	2,610	106.18	280,720.77	277,129.80
108604	国开 1805	2,500	100.16	250,457.50	250,400.00
113044	大秦转债	2,060	102.87	206,263.84	211,912.20
113011	光大转债	1,560	112.57	170,472.03	175,609.20
110053	苏银转债	1,410	120.09	152,675.82	169,326.90
123111	东财转 3	1,020	148.74	136,519.47	151,714.80
113042	上银转债	1,310	102.58	131,820.43	134,379.80
110079	杭银转债	960	113.45	111,281.15	108,912.00
110075	南航转债	830	119.90	105,497.38	99,517.00

123107	温氏转债	600	105.40	61,813.28	63,240.00
127030	盛虹转债	320	191.20	44,524.21	61,184.00
110073	国投转债	520	105.98	62,724.98	55,109.60
113026	核能转债	500	106.87	52,210.29	53,435.00
113013	国君转债	450	112.51	52,734.98	50,629.50
127032	苏行转债	340	111.58	39,618.50	37,937.20
127005	长证转债	320	117.04	35,458.17	37,452.80
127012	招路转债	320	107.37	32,596.80	34,358.40
113037	紫银转债	330	102.77	36,538.14	33,914.10
128129	青农转债	320	105.85	35,302.50	33,872.00
127020	中金转债	280	116.49	32,249.59	32,617.20
110061	川投转债	250	128.96	30,309.93	32,240.00
113043	财通转债	280	105.94	33,265.77	29,663.20
113616	韦尔转债	180	157.36	29,805.16	28,324.80
113045	环旭转债	250	108.47	27,773.99	27,117.50
128081	海亮转债	230	116.76	26,656.13	26,854.80
113014	林洋转债	220	120.17	27,712.82	26,437.40
128136	立讯转债	224	117.24	28,342.53	26,261.76
110062	烽火转债	230	113.33	29,343.99	26,065.90
110043	无锡转债	220	118.31	21,182.08	26,028.20
127025	冀东转债	210	108.39	23,839.63	22,761.90
113024	核建转债	220	103.05	23,627.65	22,671.00
110067	华安转债	210	106.33	24,069.16	22,329.30
113623	凤 21 转债	160	138.95	19,991.41	22,232.00
113048	晶科转债	200	111.04	21,023.95	22,208.00
113009	广汽转债	190	112.86	20,128.31	21,443.40
128048	张行转债	180	112.87	19,221.85	20,316.60
127027	靖远转债	200	101.40	18,235.56	20,280.00
110047	山鹰转债	170	115.70	17,096.40	19,669.00
128107	交科转债	180	105.70	19,672.72	19,026.00
127022	恒逸转债	150	126.27	19,914.78	18,940.50
128035	大族转债	170	109.40	19,179.38	18,598.00
127006	敖东转债	180	102.07	17,932.98	18,372.60
128134	鸿路转债	140	126.85	15,933.24	17,759.00
128109	楚江转债	140	122.43	16,447.83	17,140.20
128108	蓝帆转债	140	121.74	21,723.58	17,043.60
113047	旗滨转债	100	164.88	14,996.23	16,488.00
110063	鹰 19 转债	140	115.98	16,350.03	16,237.20
128034	江银转债	150	105.20	14,395.46	15,780.00
110077	洪城转债	130	118.34	14,627.43	15,384.20
110068	龙净转债	150	102.21	16,557.05	15,331.50
118000	嘉元转债	110	136.96	12,906.84	15,065.60
113615	金诚转债	90	165.55	9,612.96	14,899.50

110041	蒙电转债	140	106.31	14,411.09	14,883.40
110076	华海转债	140	105.28	16,801.43	14,739.20
128114	正邦转债	140	103.45	21,086.13	14,483.00
123108	乐普转 2	120	120.02	14,868.60	14,402.40
128093	百川转债	60	236.74	6,542.27	14,204.40
110056	亨通转债	130	108.10	12,734.77	14,053.00
113607	伟 20 转债	110	123.98	13,032.16	13,637.80
128131	崇达转 2	125	109.09	14,045.58	13,636.25
128046	利尔转债	80	169.68	8,984.49	13,574.40
113602	景 20 转债	110	123.11	13,261.48	13,542.10
113621	彤程转债	70	191.80	8,725.99	13,426.00
113605	大参转债	120	109.78	15,097.72	13,173.60
110057	现代转债	120	109.26	12,701.03	13,111.20
113033	利群转债	130	99.82	14,251.43	12,976.60
110064	建工转债	120	100.71	13,634.24	12,085.20
127016	鲁泰转债	120	100.35	12,605.53	12,042.00
127011	中鼎转 2	90	132.69	9,466.05	11,942.10
110034	九州转债	110	107.69	13,943.01	11,845.90
113017	吉视转债	120	98.23	12,271.12	11,787.60
127024	盈峰转债	110	105.91	13,131.21	11,650.10
110080	东湖转债	110	102.96	11,526.51	11,325.60
128135	洽洽转债	100	112.52	12,081.61	11,252.00
128141	旺能转债	100	112.16	10,476.91	11,216.00
110052	贵广转债	110	101.34	13,015.76	11,147.40
113516	苏农转债	100	109.08	10,386.97	10,908.00
113046	金田转债	100	106.59	10,013.98	10,659.00
128140	润建转债	90	116.56	8,999.64	10,490.40
123035	利德转债	70	143.85	9,040.37	10,069.50
127017	万青转债	90	111.88	13,882.11	10,069.20
123104	卫宁转债	80	119.51	9,910.84	9,560.80
113619	世运转债	90	104.50	9,375.57	9,405.00
123050	聚飞转债	60	154.31	7,423.75	9,258.60
127007	湖广转债	91	100.95	8,353.04	9,186.45
123077	汉得转债	90	101.58	8,988.64	9,142.20
123079	运达转债	50	182.14	5,809.48	9,107.00
123078	飞凯转债	70	128.40	7,499.15	8,988.00
113622	杭叉转债	80	112.29	9,540.09	8,983.20
123083	朗新转债	70	127.34	7,232.32	8,913.80
128130	景兴转债	81	109.74	8,875.63	8,888.94
123113	仙乐转债	70	126.57	8,453.72	8,859.90
123070	鹏辉转债	60	146.61	7,612.25	8,796.60
123099	普利转债	70	125.30	8,092.31	8,771.00
127029	中钢转债	60	146.04	10,324.05	8,762.40

128144	利民转债	80	108.90	8,654.13	8,712.00
113563	柳药转债	80	108.40	9,385.02	8,672.00
113603	东缆转债	70	122.89	8,280.56	8,602.30
128127	文科转债	90	95.24	9,454.87	8,571.60
127031	洋丰转债	70	121.98	8,027.01	8,538.60
123068	弘信转债	70	121.56	8,109.35	8,509.20
128078	太极转债	70	121.54	8,902.58	8,507.80
113614	健 20 转债	70	120.85	7,878.54	8,459.50
123076	强力转债	80	105.44	8,045.74	8,435.20
123049	维尔转债	80	105.11	9,418.42	8,408.80
128026	众兴转债	70	119.07	6,855.71	8,334.90
127015	希望转债	80	103.82	11,819.21	8,305.60
128083	新北转债	80	103.30	10,035.74	8,264.00
127033	中装转 2	80	102.23	8,077.53	8,178.40
123102	华自转债	50	162.77	5,151.83	8,138.50
128119	龙大转债	70	116.09	10,911.31	8,126.30
128142	新乳转债	70	114.89	8,919.38	8,042.30
123086	海兰转债	70	113.79	6,760.53	7,965.30
128133	奇正转债	70	112.74	7,773.58	7,891.80
123087	明电转债	60	128.90	5,518.02	7,734.00
128121	宏川转债	70	110.48	8,849.62	7,733.60
113549	白电转债	70	108.95	7,364.85	7,626.50
113609	永安转债	70	108.13	6,575.60	7,569.10
128063	未来转债	70	105.92	7,906.44	7,414.40
127013	创维转债	70	105.17	7,655.86	7,361.90
128105	长集转债	70	104.98	9,728.28	7,348.60
128037	岩土转债	70	104.46	6,892.59	7,312.20
113530	大丰转债	70	103.45	7,828.51	7,241.50
113505	杭电转债	70	102.64	7,700.25	7,184.80
113600	新星转债	70	102.25	7,470.09	7,157.50
123105	拓尔转债	60	118.90	5,979.76	7,134.00
113620	傲农转债	70	99.97	7,108.03	6,997.90
128124	科华转债	70	99.60	8,100.99	6,972.00
128057	博彦转债	60	115.89	7,474.69	6,953.40
110071	湖盐转债	60	114.24	6,987.52	6,854.40
123064	万孚转债	60	113.75	6,931.32	6,825.00
123063	大禹转债	60	113.40	7,433.54	6,804.00
128132	交建转债	70	95.72	6,896.80	6,700.40
128137	洁美转债	50	133.46	5,847.23	6,673.00
123074	隆利转债	40	165.46	4,404.81	6,618.40
113589	天创转债	70	94.15	7,259.80	6,590.50
127026	超声转债	60	109.15	5,776.09	6,549.00
123091	长海转债	50	129.66	7,282.65	6,483.00

110060	天路转债	60	107.19	6,477.35	6,431.40
123096	思创转债	60	106.84	6,025.74	6,410.40
128096	奥瑞转债	50	127.71	5,631.97	6,385.50
123071	天能转债	50	127.59	5,315.57	6,379.50
127019	国城转债	70	90.92	6,575.20	6,364.40
113599	嘉友转债	60	104.86	6,928.91	6,291.60
123053	宝通转债	60	104.52	8,450.36	6,271.20
110038	济川转债	60	104.44	6,442.69	6,266.40
113535	大业转债	60	103.22	6,033.65	6,193.20
123033	金力转债	40	154.20	4,703.11	6,168.00
113591	胜达转债	60	102.42	6,248.26	6,145.20
110048	福能转债	40	151.25	4,242.86	6,050.00
113036	宁建转债	60	100.07	7,150.88	6,004.20
113618	美诺转债	50	119.82	5,352.44	5,991.00
113569	科达转债	60	99.50	6,084.04	5,970.00
113528	长城转债	50	118.99	5,316.16	5,949.50
123069	金诺转债	40	147.43	4,318.32	5,897.20
128075	远东转债	50	116.71	6,023.99	5,835.50
113606	荣泰转债	50	113.86	5,675.91	5,693.00
128101	联创转债	40	141.85	4,869.11	5,674.00
123098	一品转债	40	139.68	4,847.24	5,587.20
128042	凯中转债	50	111.02	5,569.34	5,551.00
128106	华统转债	50	110.17	6,653.51	5,508.50
113612	永冠转债	40	135.64	4,561.21	5,425.60
123060	苏试转债	40	135.52	6,078.66	5,420.80
113568	新春转债	40	134.93	4,331.30	5,397.20
127014	北方转债	50	107.49	5,488.07	5,374.50
113542	好客转债	50	107.02	5,645.83	5,351.00
123101	拓斯转债	50	107.04	5,140.93	5,352.00
123059	银信转债	50	106.50	6,029.89	5,325.00
127028	英特转债	50	104.92	5,324.32	5,246.00
113012	骆驼转债	40	131.10	4,229.99	5,244.00
123010	博世转债	50	104.77	5,782.01	5,238.50
113604	多伦转债	50	103.70	5,982.31	5,185.00
123081	精研转债	50	103.59	5,381.10	5,179.50
128138	侨银转债	50	103.63	5,174.14	5,181.50
123056	雪榕转债	50	103.53	7,305.07	5,176.50
127034	绿茵转债	50	103.22	5,243.60	5,161.00
113532	海环转债	50	99.93	5,319.99	4,996.50
128116	瑞达转债	50	99.51	5,612.98	4,975.50
128066	亚泰转债	50	99.42	5,909.81	4,971.00
113584	家悦转债	50	98.44	6,711.27	4,922.00
128139	祥鑫转债	50	98.39	5,084.14	4,919.50

128018	时达转债	40	121.92	3,955.08	4,876.80
113525	台华转债	40	119.81	4,803.22	4,792.40
123090	三诺转债	40	119.06	5,563.27	4,762.40
123025	精测转债	30	156.73	5,425.48	4,701.90
123067	斯莱转债	20	233.86	2,335.76	4,677.20
113579	健友转债	40	116.36	5,370.03	4,654.40
113610	灵康转债	40	115.56	4,169.31	4,622.40
113030	东风转债	40	109.10	4,732.66	4,364.00
123011	德尔转债	40	107.63	4,363.81	4,305.20
113597	佳力转债	40	107.31	4,549.67	4,292.40
113588	润达转债	40	106.29	5,206.69	4,251.60
128014	永东转债	40	105.21	4,140.19	4,208.40
113598	法兰转债	40	104.98	5,390.07	4,199.20
123044	红相转债	40	104.63	4,480.67	4,185.20
128069	华森转债	40	104.46	4,566.93	4,178.40
128071	合兴转债	40	103.84	4,444.29	4,153.60
128123	国光转债	40	102.50	4,966.82	4,100.00
127021	特发转 2	40	101.86	4,526.82	4,074.40
128125	华阳转债	40	101.55	5,516.81	4,062.00
128118	瀛通转债	40	101.40	4,736.49	4,056.00
123089	九洲转 2	30	134.39	3,290.27	4,031.70
128117	道恩转债	40	100.58	4,810.05	4,023.20
113578	全筑转债	40	100.18	7,149.02	4,007.20
128049	华源转债	40	100.14	4,406.53	4,005.60
113601	塞力转债	40	99.18	4,236.94	3,967.20
128122	兴森转债	30	129.57	3,593.51	3,887.10
128033	迪龙转债	30	124.14	3,098.41	3,724.20
113541	荣晟转债	30	118.95	3,349.71	3,568.50
123092	天壕转债	30	118.50	3,300.71	3,555.00
113577	春秋转债	30	118.04	4,428.61	3,541.20
123048	应急转债	30	115.68	3,337.21	3,470.40
113039	嘉泽转债	30	113.69	3,175.13	3,410.70
123065	宝莱转债	30	112.31	3,209.59	3,369.30
123075	贝斯转债	30	112.26	3,494.81	3,367.80
128025	特一转债	30	112.03	3,381.36	3,360.90
123057	美联转债	30	110.46	3,313.51	3,313.80
123109	昌红转债	30	108.20	3,487.02	3,246.00
123002	国祯转债	30	107.41	3,765.01	3,222.30
128040	华通转债	30	106.85	3,557.12	3,205.50
113565	宏辉转债	30	105.91	3,865.45	3,177.30
113524	奇精转债	30	105.50	3,373.81	3,165.00
128072	翔鹭转债	30	105.40	3,203.80	3,162.00
128021	兄弟转债	30	103.18	3,568.61	3,095.40

110070	凌钢转债	20	118.35	2,074.21	2,367.00
113536	三星转债	20	113.98	2,512.02	2,279.60

以上交易性金融资产已于 2021 年 7 月 29 日全部处置变现，实际变现金额为人民币 4,366,374.81 元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 34,270.06 元，已于 2021 年 7 月 29 日划入本基金托管户。

(5) 本基金最后运作日应收利息余额为人民币 18,083.26 元，其中应收银行存款利息人民币 511.00 元，应收结算备付金利息人民币 7.23 元，应收存出保证金利息人民币 1.22 元及应收债券利息人民币 17,563.81 元。截至 2021 年 8 月 16 日应收利息余额为人民币 1,225.74 元，其中应收银行存款利息人民币 1,215.68 元，应收结算备付金利息人民币 8.66 元，应收存出保证金利息人民币 1.40 元。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,747.00 元，该款项中人民币 715.66 元已于 2021 年 7 月 29 日支付，剩余人民币 1,031.34 元已于 2021 年 7 月 30 日支付。另于 2021 年 7 月 29 日确认的应付赎回款为人民币 195,447.35 元，该款项已于 2021 年 8 月 2 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币 0.93 元，该款项中人民币 0.54 元已于 2021 年 7 月 29 日支付，剩余人民币 0.39 元已于 2021 年 7 月 30 日支付。另于 2021 年 7 月 29 日确认的应付赎回费为人民币 57.10 元，该款项已于 2021 年 8 月 2 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,377.93 元，该款项已于 2021 年 8 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 344.48 元，该款项已于 2021 年 8 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付税费为人民币 18.73 元，清算期间产生的应付税费为人民币 0.48 元，共计人民币 19.21 元，该款项已于 2021 年 8 月 9 日支付。

(6) 本基金最后运作日应付指数使用费为人民币 53.50 元，该款项已于 2021 年 8 月 3 日支付。

(7) 本基金最后运作日应付审计费为人民币 20,000.00 元，该款项已于 2021 年 8 月 9 日支付。

3、清算期间损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、收入	30,919.65
1.利息收入	787.26
其中：存款利息收入	706.29
债券利息收入	80.97
2.投资收益（损失以“-”号填列）	68,398.40
其中：债券投资收益	68,398.40
3.公允价值变动损益（损失以“-”号填列）	-38,285.09

4.其他收入（损失以“-”号填列）	19.08
二、费用	66.16
交易费用	66.11
税金及附加	0.05
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	30,853.49
减：所得税费用	-
四、净利润（亏损总额以“-”填列）	30,853.49

注：1.存款利息收入系清算期间的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息收入。

2.投资收益系买卖债券的差价收入。

3.其他收入系投资者于本基金最后运作日申请赎回基金份额所确认的赎回费收入。

4、剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日（2021年7月28日）基金净资产	4,379,278.36
加：清算期间净利润	30,853.49
减：清算期间确认的基金赎回款（含费用）	195,523.53
二、2021年8月16日基金净资产	4,214,608.32

根据本基金的《基金合同》，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。截至本基金清算终止日（2021年8月16日）本基金剩余财产为人民币4,214,608.32元。自清算终止日次日（2021年8月17日）至清算款支付日前一日银行存款和结算备付金产生的利息亦属全体基金份额持有人所有，将于支付清算款时一并向基金份额持有人分配。为保护基金份额持有人利益，加快清算速度，基金管理人将以自有资金先行垫付相关应收利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）及结算备付金款项，供清算分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金产生的利息（以实际结息金额为准）将于到账后返还给基金管理人。

5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- 1、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金清算审计报告》

2、《上海市通力律师事务所关于<东吴中证可转换债券指数证券投资基金清算报告>的法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 层

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 8 月 16 日