

# 东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

## 更新招募说明书

——东吴基金管理有限公司 2018 年 1 号

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

## 目录

|                                 |     |
|---------------------------------|-----|
| 【重要提示】 .....                    | 1   |
| 一、绪言 .....                      | 2   |
| 二、释义 .....                      | 3   |
| 三、基金管理人 .....                   | 8   |
| 四、基金托管人 .....                   | 17  |
| 五、相关服务机构 .....                  | 22  |
| 六、基金的分级 .....                   | 57  |
| 七、基金的募集 .....                   | 48  |
| 八、基金合同的生效 .....                 | 49  |
| 九、可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易 .....  | 50  |
| 十、东吴转债份额的申购与赎回 .....            | 52  |
| 十一、基金份额的配对转换 .....              | 62  |
| 十二、基金的投资 .....                  | 64  |
| 十三、基金的业绩 .....                  | 75  |
| 十四、基金的财产 .....                  | 76  |
| 十五、基金资产估值 .....                 | 77  |
| 十六、基金费用与税收 .....                | 81  |
| 十七、基金的收益与分配 .....               | 83  |
| 十八、基金份额折算 .....                 | 84  |
| 十九、可转债 A 份额与可转债 B 份额的终止运作 ..... | 91  |
| 二十、基金的会计与审计 .....               | 93  |
| 二十一、基金的信息披露 .....               | 94  |
| 二十二、风险揭示 .....                  | 91  |
| 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....    | 106 |
| 二十四、基金合同内容摘要 .....              | 108 |
| 二十五、基金托管协议的内容摘要 .....           | 128 |
| 二十六、对基金份额持有人的服务 .....           | 146 |
| 二十七、其它应披露事项 .....               | 148 |

---

|                       |     |
|-----------------------|-----|
| 二十八、招募说明书存放及查阅方式..... | 154 |
| 二十九、备查文件.....         | 155 |

## 【重要提示】

本基金根据【2013】年【11】月【21】日中国证券监督管理委员会《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》（证监基金字【2013】1471号）注册募集。基金合同于2014年5月9日正式生效。

基金管理人保证《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。从整体运作来看，基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。从两类份额看，可转债A份额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率（税后）+3.00%，表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。可转债B份额获得剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险较高，预期收益相对较高的特点。

本基金投资范围包括中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。相对而言，中小企业私募债券存在较高的流动性风险和信用风险。尽管本基金将中小企业私募债券的投资比例控制在一定的范围内，但仍然提请投资者关注中小企业私募债存在的上述风险及其对基金总体风险的影响。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年5月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日（财务数据未经审计）。

## 一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）其他有关规定及《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“基金合同”）编写。

本《招募说明书》阐述了东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人对未在本《招募说明书》中载明的信息，或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指东吴基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指平安银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、上市交易公告书：指《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易公告书》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订、自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

- 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 17、基金份额结构：本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额是基金组合份额，基金简称“东吴转债”，分为场外份额和场内份额。分级份额包括两类，优先收益类份额（基金简称“可转债 A”）和进取收益类份额（基金简称“可转债 B”）。可转债 A 与可转债 B 的基金份额配比始终保持 7：3 的比例不变
- 18、东吴转债份额：指东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之基础份额
- 19、可转债 A 份额：指获取优先收益的基金份额，即东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之 A 份额
- 20、可转债 B 份额：指获取进取收益的基金份额，即东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之 B 份额
- 21、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 22、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 23、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 24、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境外的机构投资者
- 25、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 26、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 27、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 28、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理东吴转债份额认购、申购和赎回等业务的基金销售机构及其场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
- 29、场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位并利用深圳证券交易所交易系统办理东吴转债份额认购、申购、赎回以及可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回
- 30、直销机构：指东吴基金管理有限公司

31、场外代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理场外基金销售业务的机构

32、场内代销机构：指代为办理场内基金销售业务，具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位

33、代销机构：除特别说明外，指场外代销机构和场内代销机构的合称

34、销售机构：指本基金的直销机构和代销机构

35、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

36、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

37、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

38、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

39、基金账户：指基金投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录投资人持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况。基金投资人办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

40、深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股账户或证券投资基金账户。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

41、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

42、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

43、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

44、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过



## 3 个月

45、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

46、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

47、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

48、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

49、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

50、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

51、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所交易规则》及不时作出的修订；中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及不时作出的修订

52、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

53、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

54、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

55、上市交易：指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖可转债 A 份额、可转债 B 份额的行为

56、场内份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的东吴转债份额的场内份额与可转债 A 份额、可转债 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

57、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 10 份东吴转债份额的场内份额申请转换成 7 份可转债 A 份额与 3 份可转债 B 份额的行为

58、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 7 份可转债 A 份额与 3 份可转债 B 份额进行配对申请转换成 10 份东吴转债份额的场内份额的行为

59、基金份额折算：指基金管理人根据基金合同的约定，对本基金所有份额进行折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为 1.000 元的行为

60、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

61、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为

62、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为

63、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

64、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

65、巨额赎回：指本基金单个开放日，东吴转债份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额(包括东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额)的10%

66、元：指人民币元

67、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

68、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

69、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

70、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

71、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

72、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

73、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

74、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)

法定代表人：王炯

设立日期：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1 亿元人民币

联系人：贾云鹏

电话：(021) 50509888

传真：(021) 50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

公司网址：www.scfund.com.cn

#### 1、股权结构：

| 持股单位       | 出资额(万元) | 占总股本比例 |
|------------|---------|--------|
| 东吴证券股份有限公司 | 7000    | 70%    |
| 海澜集团有限公司   | 3000    | 30%    |
| 合 计        | 10,000  | 100%   |

#### 2、简要情况介绍：

公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司总经理下设权益投资决策、固收投资决策、专户投资决策、风险管理、基金资产估值五个专门委员会；公司设有权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、研究策划部、集中交易室、营销管理总部、产品策略部、信息技术部、基金事务部、综合管理部、合规风控部十一个部门。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

范力先生，董事长，硕士，高级经济师，中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长，苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理；东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、公司副总裁、常务副总裁；东吴证券股份有限公司党委副书记、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

汤勇先生，董事，工商管理 EMBA，注册会计师，中共党员。任江苏悦达时装有限公司财务会计、新能（张家港）能源有限公司计财处主任，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

王炯先生，董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长、兼资产管理部总经理，现任东吴证券股份有限公司副总裁、总规划师。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

张婉苏女士，独立董事，经济学博士。历任担任斯洛文尼亚道迈尔机电有限责任公司苏州代表处法律顾问、南京大学法学院助教、讲师，现任南京大学法学院副教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

方志刚先生，独立董事，大学学历，民建会员。企业类会计师、中国注册会计师、澳洲注册会计师。历任上海上审会计师事务所审计员、部门经理，上海长信会计师事务所部门经理，上海锦江国旅股份有限公司财务部经理、上海实业联合集团长城药业有限公司财务总监；上海众华沪银会计师事务所高级经理，现任瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所工作，权益合伙人。

## 2、监事会成员

张剑宏先生，监事会主席，硕士。历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务

公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险管理部、合规法务部总经理、合规总监兼首席风险官，现任东吴证券股份有限公司首席风险官。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵女士，员工监事，硕士研究生，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，监察稽核部总经理，现任合规风控部总监兼合规风控部总经理，董事会秘书。

### 3、高管人员

范力先生，董事长，硕士，高级经济师，中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长，苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理；东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、公司副总裁、常务副总裁；东吴证券股份有限公司党委副书记、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

王炯先生，总经理，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

吕晖先生，督察长，大专。历任苏州商业大厦业务员，苏州证券公司交易员，苏州证券登记公司总经理助理，东吴证券资产管理总部副总经理，东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理，东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监、东吴基金管理有限公司副总经理，现任东吴基金管理有限公司督察长。

### 4、基金经理

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，2015年8月19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基金经理。

历任基金经理：无。

#### 5、投资决策委员会成员

(1) 权益投资决策委员会：王炯、彭敢、程涛、杨庆定、杜毅、付琦、刘元海、戴斌、王立立。王炯任权益投资决策委员会主席，彭敢、程涛为权益投资决策委员会副主席。

(2) 固收投资决策委员会：王炯、杨庆定、付琦、周明。王炯任固收投资决策委员会主席，杨庆定、周明为固收投资决策委员会副主席。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

- 13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- 17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- 23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；
- 25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 26、建立并保存基金份额持有人名册；
- 27、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### **（四）基金管理人承诺**

- 1、基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。
- 2、基金管理人严格遵守《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》及有关法规禁止的行

为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 承销证券；
- (6) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (7) 从事承担无限责任的投资；
- (8) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (9) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (10) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (11) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

3、基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金合同当事人的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；



(2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

#### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

##### 1、风险管理的理念

- 1) 风险管理是业务发展的保障；
- 2) 最高管理层负最终责任；
- 3) 分工明确、相互牵制的组织结构是前提；
- 4) 制度建设是基础；
- 5) 制度执行监督是保障；

##### 2、风险管理的原则

1) 健全性原则：风险控制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

3) 独立性原则：公司设风险管理委员会、督察长和合规风控部，各风险控制机构和人员具有并保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行监察和稽核；

4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，同时强化合规风控部对各部门的监察稽核职能；

5) 防火墙原则：公司基金投资业务和公司自有资金投资业务应在空间上和制度上适当隔离，投资决策和交易清算应严格分离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应对其相应行为制定严格的审批程序和过失处罚措施。

6) 适时性原则：公司内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且随着公司经营战略、经营方针、经营管理等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变而及时进行相应的修改和完善。

7) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

##### 3、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构, 由最高管理层对风险

管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,合规风控部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:

1) 董事会:负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任。

2) 风险管理委员会:作为总经理领导下的专门委员会之一,风险管理委员会负责协助经营管理层建立健全内部控制制度,保证公司内控制度适应业务发展的需要,制定公司的业务风险管理政策,主持重大业务的可行性论证,协助经营管理层处理其他有关内部控制方面的重大事项。

3) 督察长:独立行使督察权利;直接对董事会负责;按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

4) 合规风控部:合规风控部负责公司内控机制与制度的建立、监察、评估和建议。

5) 业务部门:风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

#### 4、风险管理和内部风险控制的措施

1) 建立内控结构,完善内控制度:公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察活动是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新。

2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制:建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。

3) 建立、健全岗位责任制:建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险。

4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序:建立了评估风险的委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策。

5) 建立有效的内部监控系统:建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

6) 使用量化的风险管理手段:采取数量化、技术化的风险控制手段,建立量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失。

7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划, 为所有员工提供足够和适当的培训, 使员工明确其职责所在, 控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

- 1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;
- 2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：17,170,411,366 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：高希泉

联系电话：(0755) 2219 7701

#### 1、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 58% 的股份，为平安银行的控股股东。截至 2017 年末，在职员工 32502 人，通过全国 70 家分行、1079 家营业机构为客户提供多种金融服务。

2017 年，平安银行收入、利润、规模保持稳健发展。实现营业收入 1057.86 亿元（还原营改增前的营业收入同比增幅 1.67%）、净利润 231.89 亿元（同比增长 2.61%）、资产总额 32,484.74 亿元（较上年末增长 9.99%）、吸收存款余额 20,004.20 亿元（较上年末增长 4.09%）、发放贷款和垫款总额（含贴现）17,042.30 亿元（较上年末增幅 15.48%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT 系统支持处、督察合规处、基金服务中心 8 个处室，目前部门人员为 60 人。

#### 2、主要人员情况

陈正涛，男，中共党员，经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银

行家，具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作，具有本外币资金清算，银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教；1993年3月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理；1993年8月至1999年2月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理；1999年3月—2000年1月在招行武汉分行青山支行任行长助理；2000年2月至2001年7月在招行武汉分行公司银行部任副总经理；2001年8月至2003年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长；2003年3月至2005年4月在招行武汉分行机构业务部任总经理；2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长；2007年7月至2008年1月在招行武汉分行同业银行部任总经理；自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理，一直负责公司银行产品开发与管理，全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理，尤其是对商业银行有关各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托管部副总经理；2013年5月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持工作)；2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。

### 3、基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2017年12月末，平安银行股份有限公司托管净值规模合计6.13万亿，托管证券投资基金共109只，具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕

景纯债债券型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、华润元大现金货币市场基金、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、鹏华丰安债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、博时泰安债券型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型

证券投资基金、长盛盛通纯债债券型证券投资基金、平安大华添益债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达睿智灵活配置混合型证券投资基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、嘉实稳悦纯债债券型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理体系的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理的工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合

同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过监控子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。



## 五、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

网站：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

#### 2、场外代销机构：

##### （1）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

##### （2）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195049

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(3) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

联系人：郭伟

电话：010-65557048

传真：010-65550827

客服电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

(4) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

公司网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(5) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路294号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：(0574) 89068340

传真：(0574) 87050024

客服电话：96528，上海地区 962528

公司网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

(6) 杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

客服热线：0571-96523400-8888-508

公司网址：www.hzbank.com.cn

(7) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

客服电话：0577-96699

公司网址：www.wzbank.cn

(8) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

办公地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

联系人：张洪玮

电话：025-58587036

传真：025-58587038

客服热线：96098, 4008696098

公司网址：www.jsbchina.cn

(9) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层邮编：100088

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045529

客服电话：010-66045678

传真：010-66045518

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

（10）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于杨

电话：021-20835779

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

（11）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38600735

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（12）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-54509953

客服热线：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(13) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服热线：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(14) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服热线：4000766123

公司网址：www.fund123.cn

(15) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-820-2899

公司网站：www.erichfund.com

## (16) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

电话：0571-88911818 转 8565

传真：0571-86800423

客服热线：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

## (17) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：李兴春

联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务中心电话：400-921-7755

## (18) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：徐黎云

联系人：来舒岚

电话：0571-88337888

传真：0571-88337666

客服热线：400-068-0058

公司网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

## (19) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

传真：010-85894285

客服热线：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

(20) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汉青

联系人：喻明明

电话：18512582084

传真：025-66996699

客服热线：95177

公司网址：www.snjjin.com

(21) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

联系人：祖杰

电话：010-57756159

传真：010-57756199

客服热线：4008980618

公司网址：www.chtfund.com

(22) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服热线：400-619-9059

公司网址：<http://www.fundzone.cn>

(23) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：宋志强

电话：13120131908

传真：010-58170840

客服热线：400-818-8866

公司网址：[www.gscaifu.com](http://www.gscaifu.com)

(24) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312885

客服热线：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com>

(25) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

电话：15311484311

传真：010-57569671

客服热线：4008936885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)



## (26) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20F

法定代表人：陈刚

联系人：胡璇

电话：0571-85267500

传真：0571-85269200

客服热线：0571-86655920

公司网址：[www.codil21.com](http://www.codil21.com)

## (27) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服热线：400-821-0203

## (28) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

## (29) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：021-333323830

客服热线：4008202819

公司网址：<http://www.chinapnr.com/>

(30) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发  
展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：俞申莉

电话：021-65370077-209

传真：021-55085991

客服热线：021-65370077

公司网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(31) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人邮箱：[NINGBOYU657@pingan.com.cn](mailto:NINGBOYU657@pingan.com.cn)

客户服务电话：4008219031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(32) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电话：18616752315

传真：021-22268089

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.com/>

(33) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室(邮编:510308)

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629021

传真：020-89629011

联系人邮箱：[wuyuhao@yingmi.cn](mailto:wuyuhao@yingmi.cn)

客户服务电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

(34) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEOWEEHOWE(张伟豪)

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服热线：400-684-0500

公司网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(35) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-60833754

传真：010-57762999

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（36）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务热线：95521

（37）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：（010）65183880

传真：（010）65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（38）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 层

法定代表人：何如

联系人：周扬

电话：0755-821308333066

传真：0755-82133952302

客服电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(39) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：林生迎

客服电话：95565、400-8888-111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(40) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服热线：95558

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(41) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008-888-888

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(42) 申万宏源证券有限公司

英文名称：ShenwanHongyuanSecuritiesCo.,Ltd.

注册资本：人民币 330 亿元

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：黄莹

（43）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（44）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

（45）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

电话：023-63786633

传真：023-63786212

客服热线：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

(46) 万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

电话：020-38286588

传真：020-38286588

客服热线：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

(47) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

(48) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：95548

公司网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

（49）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-3339628895530

公司网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

（50）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层（信达证券）

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（51）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998



公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(52) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

办公地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客服电话：020-961303

公司网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(53) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100，021-53686200

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(54) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街8号6楼、7楼

办公地址：无锡市县前东街8号6楼、7楼

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：4008885288

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(55) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

（56）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客服电话：0551-96518 或者 4008096518

公司网址：www.hazq.com

（57）财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服电话：0731-84403350

公司网址：www.cfzq.com

（58）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（59）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（60）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（61）上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

联系人：倪丹

电话：021-38784818

传真：021-68775878

客服热线：68777877

公司网址：[www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

(62) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服热线：40018-40028

公司网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

(63) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

注册资本：16 亿元人民币

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

邮政编码：200030

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967202

传真电话：021-54967293

华鑫证券公司网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

(64) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服热线：4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

(65) 九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

法定代表人：林小明

联系人：聂晗

电话：0755-33331188

传真：0755-33329815

客服热线：4006543218

公司网址：www.tyzq.com.cn

(66) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服热线：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

(67) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

联系人：卢金文

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

客服热线：0592-5163588

公司网址：www.xmzq.com.cn

(68) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

法定代表人：宫龙云

联系人：戴莉丽

电话：021-32229888-25122

传真：021-62878783

客服电话：021-63340678

公司网址：www.ajzq.com

(69) 金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

电话：010-68091380

传真：010-68091380

客服热线：400-8557333

公司网址：www.jhfund.com

### 3、场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

## 二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：010-59378839

传真：010-59378907

联系人：朱立元

## 三、律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

#### **四、会计师事务所和经办注册会计师**

名称：安永华明会计师事务所有限责任公司

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

## 六、基金的分级

### 一、基金份额结构

本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“东吴转债”，分为场外份额和场内份额。分级份额包括两类：优先收益类份额（基金简称“可转债 A”）和进取收益类份额（基金简称“可转债 B”）。可转债 A 份额及可转债 B 份额的基金份额配比始终保持 7:3 的比例不变。

### 二、基金基本运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售东吴转债份额。投资者场外认购所得的份额，不进行分拆。投资者场内认购所得的份额，将按 7:3 的基金份额配比自动分离为可转债 A 份额和可转债 B 份额。投资者场内认购所得的东吴转债份额自动分离，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。可转债 A 份额、可转债 B 份额与东吴转债份额的资产合并投资运作。

2、基金合同生效后，东吴转债份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但不上市交易。在满足上市条件的情况下，可转债 A 份额和可转债 B 份额将申请上市交易，但是不开放申购和赎回等业务。

3、基金合同生效后，基金管理人申请可转债 A 份额和可转债 B 份额上市交易，办理东吴转债份额与可转债 A 份额和可转债 B 份额之间的份额配对转换业务。

4、投资者可在场内申购和赎回东吴转债份额，也可选择将其持有的东吴转债份额场内份额按 7:3 的比例分拆成可转债 A 份额和可转债 B 份额后进行二级市场交易。

5、投资者可在二级市场买入或卖出可转债 A 份额和可转债 B 份额，也可以将其持有的上述两类份额按照 7:3 的配比合并为东吴转债份额后进行赎回。

6、投资者可在场外申购和赎回东吴转债份额。场外认购和申购的东吴转债份额不进行份额配对转换，但基金合同另有规定的除外。场外的东吴转债份额可以通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的东吴转债份额配对转换规则进行操作。

7、无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见“第十七部分 基金份额折算”），其所产生的东吴转债份额不进行自动分离。投资者可选择将上述折算产生的东吴转债份额按 7:3 的比例分拆为可转债 A 份额和可转债 B 份额。

### 三、东吴转债份额的份额净值计算规则

T 日东吴转债份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额



的总数。

其中：

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

本基金T日基金份额总数为东吴转债份额、可转债A份额和可转债B份额数量的总和。

#### 四、可转债A份额和可转债B份额的净值计算规则

可转债A份额和可转债B份额具有不同的净值计算规则，即可转债A份额和可转债B份额的风险和收益特征不同。

在基金的存续期内，基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对可转债A份额和可转债B份额分别进行基金份额净值计算。

基金净资产优先分配可转债A份额的本金及可转债A份额的约定收益，可转债A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先分配可转债A份额的本金及可转债A份额的约定收益后的剩余净资产分配予可转债B份额，可转债B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

在基金存续期内，可转债A份额和可转债B份额的净值计算规则如下：

1、可转债A份额的约定年收益率为“一年期银行定期存款年利率（税后）+3.0%”。其中计算可转债A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率（税后）是指基金合同生效日或生效后每个定期折算期间首日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期存款基准利率，年基准收益以1.00元为基准进行计算。

2、基金每个工作日对可转债A份额和可转债B份额进行净值计算。在进行可转债A份额和可转债B份额各自的净值计算时，基金净资产优先确保可转债A份额的本金及可转债A份额累计约定应得收益，之后的剩余净资产计为可转债B份额的净资产。可转债A份额累计约定应得收益，由可转债A份额约定每日收益率乘以截至计算日可转债A份额应计收益的天数进行单利计算确定；可转债A份额约定每日收益率=可转债A份额约定年收益率/当年天数。

3、每10份东吴转债份额所代表的资产净值等于7份可转债A份额和3份可转债B份额的资产净值之和。

4、在本基金的基金合同生效日所在定期折算期间或存续的某一完整定期折算期间内，若未发生基金合同规定的不定期份额折算，则可转债A份额在净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日或自该定期折算期间首日至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则可转债A份额在净值计算日应计收益的天数应按照当

前定期折算期间内最近一次不定期份额折算日次日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证可转债 A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一定期折算期间内本基金财产出现极端损失情况下，可转债 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

### 五、可转债A份额和可转债B份额的净值计算

依据可转债 A 份额和可转债 B 份额的净值计算规则。按照下述的公式分别计算并公告 T 日东吴转债份额、可转债 A 份额和可转债 B 份额的净值：

$$NAV_{\text{可转债A}} = 1 + \frac{R * t}{\text{当年天数}}$$

$$NAV_{\text{可转债B}} = \frac{NAV_{\text{东吴转债}} - 0.7NAV_{\text{可转债A}}}{0.3}$$

R 为可转债 A 份额约定年收益率；

设 T 日为基金份额净值计算日，T=1, 2, 3...N；N 为当年实际天数；t=min{自定期折算期间首日至 T 日，自《基金合同》生效日至 T 日，自不定期份额折算基准日的下一日至 T 日}；

$NAV_{\text{东吴转债}}$  为 T 日每份东吴转债份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{可转债A}}$  为 T 日可转债 A 份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{可转债B}}$  为 T 日可转债 B 份额的基金份额净值。

东吴转债份额、可转债 A 份额和可转债 B 份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

具体转换规则见基金合同第二十、二十一部分及基金管理人届时发布的相关公告。

## 七、基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1471号文备案。

### 二、基金类型和存续期间

- 1、基金的类别：债券型证券投资基金。
- 2、基金的运作方式：契约型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

### 三、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

### 四、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资人、机构投资人和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

### 五、募集情况

经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本基金首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金267,961,793.01元，利息人民币103,190.89元，共计人民币268,064,983.90元。其中，场外销售有效认购资金人民币236,808,793.01元，利息人民币99,719.89元，合计人民币236,908,512.90元；交易所场内销售有效认购资金人民币31,153,000.00元，利息人民币3,471.00元，合计人民币31,156,471.00元。于2014年5月7日汇入本基金在基金托管人平安银行股份有限公司开立的基金托管专户。本次募集有效认购户数为2,566户。认购资金根据每份基金份额的面值人民币1.00元折合268,064,983.90份基金份额，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

## 八、基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、基金募集期届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情况的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 九、可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易

基金合同生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的可转债 A 份额与可转债 B 份额分别在深圳证券交易所上市交易。基金份额上市后,投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖可转债 A 份额和可转债 B 份额。

### 一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

可转债 A 份额与可转债 B 份额上市后,登记在证券登记结算系统中的可转债 A 份额与可转债 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的东吴转债份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并分拆成可转债 A 份额与可转债 B 份额后,方可上市交易。

### 二、上市交易的时间

可转债 A 份额与可转债 B 份额在基金合同生效后 3 个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在指定媒体上刊登公告。

### 三、上市交易的规则

- (1) 可转债 A 份额与可转债 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易;
- (2) 可转债 A 份额与可转债 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一工作日可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额净值;
- (3) 可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

### 四、上市交易的费用

可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易的费用,按照深圳证券交易所上市开放式基金的有关规定办理。

### 五、上市交易的行情提示

可转债 A 份额与可转债 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示可转债 A 份额与可转债 B 份额前一交易日的份额净值。

### 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

可转债 A 份额与可转债 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

七、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 十、东吴转债份额的申购与赎回

### 一、东吴转债份额申购和赎回场所

东吴转债份额的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人可以使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销机构及场外代销机构的营业网点（各销售机构的具体名单见基金份额发售公告）办理东吴转债份额的场外申购和赎回业务。基金投资人也可使用深圳证券账户，通过场内代销机构利用深圳证券交易所交易系统办理东吴转债份额的场内申购和赎回业务。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。基金投资者应当在销售机构的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、东吴转债份额申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，投资人在开放日办理东吴转债份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理东吴转债份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登

记机构确认接受的，其东吴转债份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### 三、东吴转债份额申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的东吴转债份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，当日的场内申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理东吴转债份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### 四、东吴转债份额申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购东吴转债份额申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的东吴转债份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购东吴转债份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请



日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）到销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

## 五、东吴转债份额申购和赎回的数量限制

1、投资人办理东吴转债份额场外申购时，单笔申购最低金额为 1,000 元人民币（含申购费），每笔追加认购的最低金额为 1,000 元。通过直销中心单笔申购最低金额为 1,000 元人民币（含申购费），每笔追加认购的最低金额为 1,000 元。通过本基金管理人网上交易系统办理东吴转债份额申购业务的单笔申购最低金额为 1,000 元（含申购费），每笔追加认购的最低金额为 1,000 元。

2、通过会员单位办理场内东吴转债份额的申购时，单笔最低申购金额为 50,000 元（含申购费），同时申购金额必须是整数金额。

3、基金份额持有人赎回东吴转债份额的最低份额为 100 份，最低账面份额为 100 份。

4、投资者的赎回申请将导致其单个交易账户内留存的基金份额不足基金管理人规定的最低持有份额时，投资者应一次全部赎回；如投资者未一次全部提交赎回申请，销售机构有权以投资者在其单个交易账户内留存的该基金全部份额为限，办理赎回。（如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于最低持有份额的情况，不受此限）

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告；

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## 六、东吴转债份额申购费率、赎回费率

### 1、申购费率

本基金对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过 5%。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。基金的申购费率如下：

| 申购金额 (M, 含申购费)      | 申购费率            |
|---------------------|-----------------|
| M < 10 万元           | 0.50%           |
| 10 万元 ≤ M < 100 万元  | 0.40%           |
| 100 万元 ≤ M < 200 万元 | 0.20%           |
| M ≥ 200 万元          | 按笔收取, 每笔 1000 元 |

申购费用由投资人承担, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用, 不列入基金财产。

## 2、赎回费率

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定, 基金的赎回费率如下:

|       | 持有期限 (N, 持有时间)                                 | 赎回费率  |
|-------|--|-------|
| 场外赎回费 | N < 7 天  | 1.50% |
|       | 7 天 ≤ N < 3 个月                                 | 0.50% |
|       | 3 个月 ≤ N < 1 年                                 | 0.30% |
|       | 1 年 ≤ N < 2 年                                  | 0.05% |
|       | N ≥ 2 年  | 0     |
| 场内赎回费 | 本基金场内赎回费: 7 天以内为 1.50%, 超过 7 天 (含 7 天) 为 0.50% |       |

(注: 其中 1 个月为 30 天, 3 个月为 90 天; 1 年为 365 日, 2 年为 730 日)

东吴转债份额的场内赎回费率为固定值 0.5%。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产, 其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式, 并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对以特定交易方式 (如网上交易、电话交易等) 等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 按相关监管部门要求履行必要手续后, 基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、东吴转债份额场外申购份额的计算：

东吴转债份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日东吴转债份额净值}$$

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日东吴转债份额净值}$$

场外申购的份额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购的份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例如，某投资人投资 50,250 元场外申购东吴转债份额，对应申购费率为 0.5%，假设申购当日东吴转债份额净值为 1.080 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,250.00 / (1 + 0.5\%) = 50,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,250.00 - 50,000.00 = 250.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 50,000.00 / 1.080 = 46,296.30 \text{ 份}$$

即：该投资人可得到 46,296.30 份东吴转债份额。

### 2、东吴转债份额赎回金额的计算：

本基金采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算。计算公式：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日东吴转债份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金额按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产

承担。

例如：某基金份额持有人赎回其持有的 100,000 份东吴转债份额场外份额，持有时间是 150 天，对应的赎回费率为 0.3%，假设赎回当日东吴转债份额净值是 1.210 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 =  $100,000 \times 1.210 = 121,000.00$  元

赎回费用 =  $121,000 \times 0.3\% = 363.00$  元

净赎回金额 =  $121,000 - 363 = 120,637.00$  元

即：该基金份额持有人可得到的净赎回金额为 120,637.00 元。

3、东吴转债份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的东吴转债份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。此时本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金会计系统、注册登记系统或证券结算登记系统无法正常运行；
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请；
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的东吴转债份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

### 十、巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的东吴转债份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额(包括东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额)的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额）的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的东吴转债份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和注册登记机构的有关业务规则办理。

(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

(4) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 2 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的东吴转债份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，东吴转债份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登东吴转债份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的东吴转债份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次；当连续暂停时间超过 2 个月时，刊登暂停公告的频率由基金管理人视情况调整。暂停结束，东吴转债份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的东吴转债份额的基金份额净值。

### 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

### 十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的规定办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

#### 十四、基金的转托管

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场内认（申）购的东吴转债份额或上市交易买入的可转债 A 份额、可转债 B 份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下；场外认（申）购的东吴转债份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

##### 2、系统内转托管

系统内转托管是指基金持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理东吴转债份额场外基金赎回业务的销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理基金份额系统内转托管。

基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易或东吴转债份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。

##### 3、跨系统转托管

跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的东吴转债份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十六、基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。



## 十一、基金份额的配对转换

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的东吴转债份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务。

### 一、场内份额配对转换

1、场内份额配对转换：指根据基金合同约定，场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。

2、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 10 份东吴转债份额的场内份额申请转换成 7 份可转债 A 份额与 3 份可转债 B 份额的行为。

3、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 7 份可转债 A 份额与 3 份可转债 B 份额进行配对申请转换成 10 份东吴转债份额的场内份额的行为。

4、场外的东吴转债份额不进行份额配对转换。在场外东吴转债份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

### 二、业务办理机构

本基金场内份额配对转换业务的办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人，应当在场内份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供其他方式，办理场内份额配对转换。深圳证券交易所、注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

### 三、业务办理时间

场内份额配对转换，自可转债 A 份额、可转债 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理该业务前在指定媒体上予以公告。

### 四、份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请进行分拆的东吴转债份额的场内份额必须是 10 的整数倍。

3、申请进行合并的可转债 A 份额与可转债 B 份额必须同时配对申请，可转债 A 份额与可转债 B 份额必须为正整数且两者的比例须为 7:3。

4、东吴转债份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为东吴转债份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并

在正式实施前在指定媒体公告。

#### **五、份额配对转换的程序**

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### **六、暂停份额配对转换的情形**

1、基金管理人有权根据市场情况，暂停配对转换的合并或分拆。

2、深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述三项的，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒体公告。

#### **七、份额配对转换的业务办理费用**

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可按照规定的标准收取一定的佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用，具体见相关业务公告。

## 十二、基金的投资

### 一、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。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括可转债（含分离交易可转债）、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、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。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，须在达到可交易状态日起 10 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、投资理念

本基金跟踪具有良好市场代表性的中证可转债指数，通过指数化投资以实现跟踪中证可转债指数，从而为投资者提供一个分享中国经济增长及可转债债券市场发展的有效投资工具。

### 四、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。

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 0.5%以内，年跟踪误差控制在 5%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。

### （一）资产配置策略

本基金将不低于基金资产净值的 80%投资于债券资产，又将不低于非现金基金资产的 80%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好，收益较高的固定收益类产品，以保证投资组合能够在跟踪指数的基础上，具有较好的流动性。

### （二）指数投资策略

对指数投资部分，采用优化复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，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。

#### 1、可转债投资组合的定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的标的指数对其成份券及成分券权重的调整而进行相应调整。

#### 2、可转债投资组合的不定期调整

当以下情况发生时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

(1) 本基金预期标的指数的成份券即将调整或权重发生变化；

(2) 成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例；

(3) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；

(4) 基金发生申购赎回、市场流动性变化等其他可能影响跟踪效果的情形。

#### 3、可转债投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，本基金将根据本基金的资产规模、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。

## 五、投资决策流程

本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系，具体见图 12-1。：

### 1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。

### 3、投资程序

(1) 研究支持：金融工程小组依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策：投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

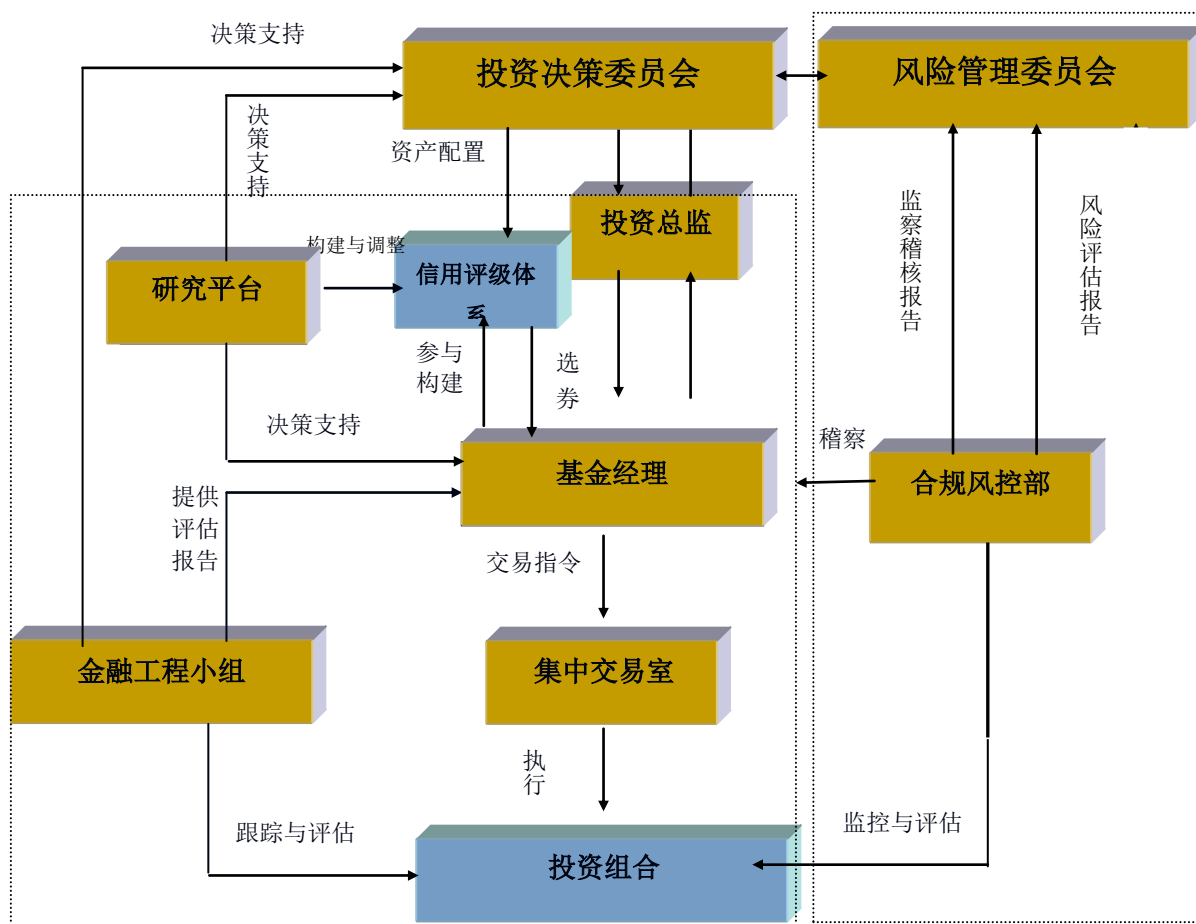
(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估：金融工程小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

(6) 组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，紧密跟踪标的指数。基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资体制和程序做出调整，并在更新的《招募说明书》中列示。

图 12-1 投资决策流程示意图



资料来源：东吴基金。

## 六、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 20%；
- (3) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (4) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

(8) 本基金应投资于信用评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(9) 本基金持有的同一中期票据的比例，不得超过该中期票据规模的 10%；

(10) 本基金投资于同一原始权益人的各类中期票据的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；

(11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第（3）、（8）、（13）、（14）项之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本托管协议生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 七、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%

中证可转换债券指数选取的是在上海证券交易所和深圳证券交易所上市并且面值余额在 3 千万元以上的可转换公司债券。该指数采用派许加权综合价格指数方法编制，其成分券为沪深两市中核心优质可转换债券，具有代表性强、流动性相对较高的特点，能够反映沪深两市可转债市场的总体发展趋势。

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

## 八、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。

从本基金的两类基金份额来看，可转债 A 份额为约定收益，将表现出预期低风险、预期收益相对稳定的明显特征；可转债 B 份额获得产品剩余收益，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。

## 九、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法



- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

**十、本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。**

### 十一、基金投资组合报告

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)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。

本基金的托管人平安股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年4月16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。

本投资组合报告所载数据截至2018年3月31日(未经审计)。

#### 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            | 24,157,435.31 | 86.05        |
|    | 其中:债券             | 24,157,435.31 | 86.05        |
|    | 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        | 3,802,007.51  | 13.54        |

|   |      |               |        |
|---|------|---------------|--------|
|   | 合计   |               |        |
| 8 | 其他资产 | 115,683.61    | 0.41   |
| 9 | 合计   | 28,075,126.43 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 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。

### 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。

## 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。

## 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      | 2,768,553.60  | 10.04        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 906.50        | 0.00         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 21,387,975.21 | 77.55        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 24,157,435.31 | 87.59        |

## 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（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 113011 | 光大转债     | 49,000 | 5,315,520.00 | 19.27        |
| 2  | 019563 | 17 国债 09 | 27,680 | 2,768,553.60 | 10.04        |
| 3  | 128024 | 宁行转债     | 16,392 | 1,883,768.64 | 6.83         |
| 4  | 113008 | 电气转债     | 15,380 | 1,547,381.80 | 5.61         |

|   |        |      |        |              |      |
|---|--------|------|--------|--------------|------|
| 5 | 113013 | 国君转债 | 12,150 | 1,314,630.00 | 4.77 |
|---|--------|------|--------|--------------|------|

## 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。

## 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。

## 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。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 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。

### 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。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 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。

### 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。

### 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。

## 11、投资组合报告附注

(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。

(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。

### (3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 9,150.70 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息  | 106,432.96 |
| 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    | 115,683.61 |

## (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  | 113011 | 光大转债 | 5,315,520.00 | 19.27        |
| 2  | 113008 | 电气转债 | 1,547,381.80 | 5.61         |
| 3  | 113013 | 国君转债 | 1,314,630.00 | 4.77         |
| 4  | 110032 | 三一转债 | 995,155.20   | 3.61         |
| 5  | 110031 | 航信转债 | 494,944.80   | 1.79         |
| 6  | 110033 | 国贸转债 | 355,536.70   | 1.29         |
| 7  | 128016 | 雨虹转债 | 352,079.70   | 1.28         |
| 8  | 110030 | 格力转债 | 285,120.00   | 1.03         |
| 9  | 128034 | 江银转债 | 280,290.00   | 1.02         |
| 10 | 110034 | 九州转债 | 237,806.40   | 0.86         |
| 11 | 128012 | 辉丰转债 | 209,488.68   | 0.76         |
| 12 | 123001 | 蓝标转债 | 207,558.90   | 0.75         |
| 13 | 113012 | 骆驼转债 | 202,579.20   | 0.73         |
| 14 | 128013 | 洪涛转债 | 202,202.00   | 0.73         |
| 15 | 127004 | 模塑转债 | 188,820.00   | 0.68         |
| 16 | 127003 | 海印转债 | 185,679.76   | 0.67         |
| 17 | 128015 | 久其转债 | 183,556.80   | 0.67         |
| 18 | 113010 | 江南转债 | 166,128.00   | 0.60         |
| 19 | 128010 | 顺昌转债 | 119,770.20   | 0.43         |
| 20 | 128014 | 永东转债 | 103,550.00   | 0.38         |

**(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。

**(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。

### 十三、基金的业绩

本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,也不保证最低收益。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。

#### 1、东吴中证可转换债券基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

| 阶段                    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|-----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|---------|--------|
| 2014.05.09-2014.12.31 | 49.22%     | 1.21%         | 53.77%         | 1.19%             | -4.55%  | 0.02%  |
| 2015.01.01-2015.12.31 | -39.65%    | 2.50%         | -25.19%        | 2.99%             | -14.46% | -0.49% |
| 2016.01.01-2016.12.31 | -13.91%    | 0.68%         | -11.15%        | 0.69%             | -2.76%  | -0.01% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | -3.86%     | 0.43%         | -0.14%         | 0.45%             | -3.72%  | -0.02% |
| 2018.01.01-2018.03.31 | 1.61%      | 0.76%         | 3.69%          | 0.82%             | -2.08%  | -0.06% |
| 2014.05.09-2018.03.31 | -24.53%    | 1.43%         | 5.08%          | 1.65%             | -29.61% | -0.22% |

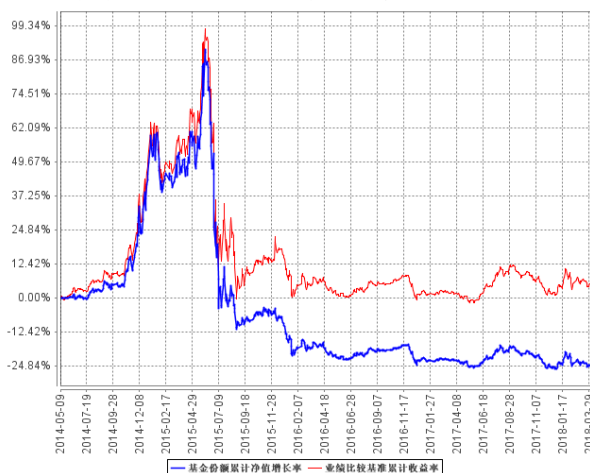
注：本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

#### 2、东吴中证可转换债券基金累计净值增长率历史走势图

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较

(2014年5月9日至2018年3月31日)

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、本基金于2014年5月9日成立。

## 十四、基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、注册登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券、中小企业私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。



(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、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价格估值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### **四、估值程序**

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **五、估值错误的处理**

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、估值错误类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益决定延迟估值时；

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致后，基金管理人应当暂停基金估值；

6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 十六、基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、基金上市费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

#### 3、标的指数使用许可费

指数使用许可费根据基金管理人与指数开发商签署的相关许可协议确定并调整。在通

常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.015% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用许可费每日计提，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元，基金设立当年，不足三个月的，按照三个月收费。

基金管理人可根据指数许可协议规定的费率、收费方式变更和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、与基金销售有关的费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“十、东吴转债份额的申购与赎回”中的相关规定。

本基金转换费率由基金管理人届时另行规定。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十七、基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

本基金（包括东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止可转债 A 份额与可转债 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配规则。

具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十八、基金份额折算

### 一、定期份额折算

在东吴转债份额、可转债 A 份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个 11 月 30 日，第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的 12 月 1 日至下一会计年度的 11 月 30 日。

#### （一）基金份额折算基准日

每个会计年度 12 月第一个工作日。

#### （二）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的东吴转债份额、可转债 A 份额。

#### （三）基金份额折算频率

每年折算一次。

#### （四）基金份额折算方式

可转债 A 份额和可转债 B 份额按照基金合同第四部分“基金的分级”进行净值计算，对可转债 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份东吴转债份额将按 7 份可转债 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，可转债 A 份额和可转债 B 份额的份额配比保持 7:3 的比例。

对于可转债 A 份额期末的约定应得收益，即可转债 A 份额每个会计年度 11 月 30 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内东吴转债份额分配给可转债 A 份额持有人。东吴转债份额持有人持有的每 10 份东吴转债份额将按 7 份可转债 A 份额获得新增东吴转债份额的分配。持有场外东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外东吴转债份额的分配；持有场内东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内东吴转债份额的分配。

经过上述份额折算，东吴转债份额和可转债 A 份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 12 月第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对东吴转债份额和可转债 A 份额进行应得收益的定期份额折算。

#### 1、东吴转债份额

$$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}} = NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} - 0.7 \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)$$

东吴转债份额持有人新增的东吴转债份额

$$= \frac{0.7 \times NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前东吴转债份额净值

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后东吴转债份额净值

$NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债 A 份额净值

$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前东吴转债份额的份额数

东吴转债份额的场外份额经折算后的份额数采用截位的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；东吴转债份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

## 2、可转债 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变可转债 B 份额净值及其份额数。

## 3、可转债 A 份额

定期份额折算后可转债 A 份额的基金份额净值=1.000 元

定期份额折算后可转债 A 份额的份额数 = 定期份额折算前可转债 A 份额的份额数

可转债 A 份额持有人新增的场内东吴转债份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后东吴转债份额净值

$NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债 A 份额净值

$NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债 A 份额的份额数

4、定期份额折算后东吴转债份额的份额数 = 定期份额折算前东吴转债份额的份额数 + 东吴转债份额持有人新增的东吴转债份额的份额数 + 可转债 A 份额持有人新增的东吴转债份额的份额数

## （五）基金份额折算期间的基金业务办理



为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易和东吴转债份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （六）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

#### （七）特殊情形的处理

若在某一定期折算期间最后一个工作日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

## 二、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元；当可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元。

（一）当东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额。

#### 3、基金份额折算频率

不定期。

#### 4、基金份额折算方式

当东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元后，本基金将分别对可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保可转债 A 份额和可转债 B 份额的比例为 7:3，份额折算后可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当东吴转债份额的份额净值达到 1.400 元后，可转债 A 份额、可转债 B 份额、东吴转债份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

#### （1）可转债 A 份额份额折算原则：

- ① 份额折算前可转债 A 份额的份额数与份额折算后可转债 A 份额的份额数相等；
- ② 可转债 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内东吴转债份额。

可转债 A 份额持有人新增的场内东吴转债份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

$NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债 A 份额净值

$NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债 A 份额的份额数

(2) 可转债 B 份额份额折算原则：

- ① 份额折算后可转债 B 份额与可转债 A 份额的份额数保持 7: 3 配比；
- ② 份额折算前可转债 B 份额的资产净值与份额折算后可转债 B 份额的资产净值及新增场内东吴转债份额的资产净值之和相等；
- ③ 份额折算前可转债 B 份额的持有人在份额折算后将持有可转债 B 份额与新增场内东吴转债份额。

可转债 B 份额持有人新增的东吴转债份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{可转债B}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{可转债B}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{可转债B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前可转债 B 份额的份额数

$NAV_{\text{可转债B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前可转债 B 份额净值

(3) 东吴转债份额份额折算原则：

场外东吴转债份额持有人份额折算后获得新增场外东吴转债份额，场内东吴转债份额持有人份额折算后获得新增场内东吴转债份额。

东吴转债份额持有人份额折算后新增的东吴转债份额

$$= \frac{NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：份额折算前东吴转债份额净值

$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：份额折算前东吴转债份额的份额数

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易和东吴转债份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

(二) 当可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

##### 1、基金份额折算基准日

可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

##### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的可转债 A 份额、可转债 B 份额、东吴转债份额。

##### 3、基金份额折算频率

不定期。

##### 4、基金份额折算方式

当可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元后，本基金将分别对可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保可转债 A 份额和可转债 B 份额的比例为 7:3，份额折算后东吴转债份额、可转债 A 份额和可转债 B 份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当可转债 B 份额净值达到 0.450 元后，可转债 A 份额、可转债 B 份额、东吴转债份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

(1) 可转债 B 份额份额折算原则：

份额折算前可转债 B 份额的资产净值与份额折算后可转债 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{可转债B}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{可转债B}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{可转债B}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{可转债B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后可转债 B 份额的份额数

$NUM_{\text{可转债B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前可转债 B 份额的份额数

$NAV_{\text{可转债B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前可转债 B 份额净值

(2) 可转债 A 份额份额折算原则：

① 份额折算前后可转债 A 份额与可转债 B 份额的份额数始终保持 7：3 配比；

② 份额折算前可转债 A 份额的资产净值与份额折算后可转债 A 份额的资产净值及新增场内东吴转债份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前可转债 A 份额的持有人在份额折算后将持有可转债 A 份额与新增场内东吴转债份额。

$NUM_{\text{可转债A}}^{\text{后}} : NUM_{\text{可转债B}}^{\text{后}} = 7 : 3$

$$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{场内}} = \frac{NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - NUM_{\text{可转债A}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{可转债A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后可转债 A 份额的份额数

$NUM_{\text{可转债B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后可转债 B 份额的份额数

$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{场内}}$ ：份额折算前可转债 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内东吴转债份额的份额数

$NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前可转债 A 份额的份额数

$NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前可转债 A 份额净值

(3) 东吴转债份额份额折算原则：

份额折算前东吴转债份额的资产净值与份额折算后东吴转债份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}$ ：份额折算后东吴转债份额的份额数

$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：份额折算前东吴转债份额的份额数

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：份额折算前东吴转债份额净值

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易和东吴转债份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 十九、可转债 A 份额与可转债 B 份额的终止运作

一、经基金份额持有人大会决议通过，可转债 A 份额与可转债 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各自表决权的 2/3 以上(含 2/3) 通过方为有效。

### 二、可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作后的份额折算

可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，可转债 A 份额与可转债 B 份额将全部折算成东吴转债份额的场内份额。

#### 1、份额折算基准日

可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

#### 2、份额折算方式

在折算基准日日终，以东吴转债份额的基金份额净值为基准，可转债 A 份额与可转债 B 份额按照各自的基金份额净值折算成东吴转债份额的场内份额。可转债 A 份额（或可转债 B 份额）基金份额持有人持有的折算后东吴转债份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额折算计算公式：

可转债 A 份额折算为东吴转债份额的数量=

$$\text{折算前可转债A份额的数量} \times \frac{NAV_{\text{可转债A}}}{NAV_{\text{东吴转债}}}$$

可转债 B 份额折算为东吴转债份额的数量=

$$\text{折算前可转债B份额的数量} \times \frac{NAV_{\text{可转债B}}}{NAV_{\text{东吴转债}}}$$

$NAV_{\text{东吴转债}}$  : 分级份额终止运作日东吴转债份额的份额净值

$NAV_{\text{可转债A}}$  : 分级份额终止运作日可转债 A 份额的份额

$NAV_{\text{可转债B}}$  : 分级份额终止运作日可转债 B 份额的份额

可转债 A 份额与可转债 B 份额全部折算为东吴转债份额的场内份额后，本基金转型为

东吴中证可转换债券指数证券投资基金（LOF），本基金接受场外与场内的申购和赎回。

#### 4、份额折算的公告

基金管理人应不迟于可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作日前 2 日，就分级份额终止运作及份额折算事宜，在指定媒体公告。可转债 A 份额与可转债 B 份额进行份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

## 二十、基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。



## 二十一、基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

1、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认

购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会备案后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）上市交易公告书

本基金获准在证券交易所上市交易后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在指定媒体上公告。

#### （五）基金资产净值、基金份额净值

1、基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额净值。

2、在可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额基金份额净值和基金份额累计净值。

3、在开始办理东吴转债份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额各自的基金份额净值和东吴转债份额的基金份额累计净值。

4、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，

将基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### （六）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （八）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金注册登记机构；
- 21、东吴转债份额开始办理申购、赎回；
- 22、东吴转债份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受东吴转债份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金可转债 A 份额与可转债 B 份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 27、本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；

- 28、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理场内份额配对转换业务；
- 29、本基金实施基金份额折算；
- 30、可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作；
- 31、可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作后可转债 A 份额与可转债 B 份额的份额转换；
- 32、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 33、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

#### （十）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人按双方约定方式确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 15 年。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复制。基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以供公众查阅、复制。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十二、风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

(1) 政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险；

(2) 经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

(3) 利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失；

(4) 债券市场流动性风险。部分债券交易相对较不活跃，可能增大债券变现难度，从而影响基金资产变现能力的风险；

(5) 购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降；

(6) 再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率，这将对基金的净值增长率产生影响；

(7) 信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失；

(8) 债券回购风险。债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，

对基金净值造成损失的可能性也就越大。

## 2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

(1) 决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

(2) 操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

(3) 技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

## 4、估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值，确保基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

## 5、流动性风险

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

## 6、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

## 7、本基金特有的风险

### (1) 指数投资风险

1) 标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

2) 标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而



使基金收益水平发生变化，产生风险。

3) 跟踪偏离风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性，可能包括：

①基金在跟踪指数过程中由于买入和卖出债券时均存在交易成本，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离；

②受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为标的指数的成份债、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将债券及时地转化为现金，这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险；

③在本基金实行指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力例如跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

#### (2) 可转债 A 份额的本金风险

可转债 A 份额表现出低风险、收益稳定特征，但是约定收益的获得及其分配也具有不确定性，基金管理人承诺也不保证可转债 A 份额的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，可转债 A 份额的基金份额持有人也可能损失本金。

#### (3) 可转债 B 份额的杠杆性风险

可转债 B 份额具有一定的杠杆性，因此，表现出风险较高，收益较高的特征。

为减小可转债 B 份额的份额净值归零风险，本基金设定了定期、不定期折算机制。但极端情况下，可转债 B 份额净值仍有归零的风险。

#### (4) 份额配对转换业务中存在的风险

本基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定，办理东吴转债份额与可转债 A 份额、可转债 B 份额之间的份额配对转换业务。这一业务的办理，一方面，可能改变可转债 A 份额与可转债 B 份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### (5) 流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### 1) 基金申购、赎回安排

本基金管理人加强申赎环节的管理，合理控制持有人集中度，审慎确认大额申购，避免出现单一持有人申购后份额超过 50%以上的情形，在单一份额持有人持有份额超过 50%时，拒绝其后续申购。当出现法律法规、基金合同约定的情形或接受申赎可能会对基金流动性产生影响时，基金管理人可以暂停本基金申购、延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请，详情请见本招募书第八章，基金份额的申购与赎回。

### 2) 本基金拟投资市场行业及资产的流动性风险评估

本基金拟投资于银行间和交易所债券、货币市场工具等投资品种。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，确保基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险。

### 3) 巨额赎回情况下的流动性等风险管理措施

若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取延缓支付赎回款项的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

### 4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及

时赎回基金份额的风险。本基金对持续持有期少于 7 日的投资人，收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资人赎回基金份额时收取。

#### 5) 基金报告及临时报告

在本基金持续运作过程中，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告中披露该投资者的信息及风险。本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回的重大事项时，及时发布公告。

#### (6) 份额折算的风险

由于本基金各级基金份额的风险收益特征不同，当可转债 A 份额和可转债 B 份额折算成东吴转债份额的场内份额及东吴转债份额的场内份额分拆成可转债 A 份额和可转债 B 份额后；或当可转债 A 份额和可转债 B 份额运作终止，可转债 A 份额和可转债 B 份额折算成东吴转债份额的场内份额后，基金份额持有人所持有基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

#### (7) 基金份额的折/溢价交易风险

可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

对于可转债 A 份额、可转债 B 份额，尽管在基金份额配对转换机制下，七份可转债 A 份额与三份可转债 B 份额的市价总和将与十份东吴转债份额的净值之间具有逼近的趋势，但是，可转债 A 份额或可转债 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于基金份额配对转换套利机制的影响，可转债 A 份额与可转债 B 份额的交易价格可能会相互影响。

### 8、其他风险

(1) 随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

(2) 因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

(3) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(4) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

(7) 其他意外导致的风险。

## 二、声明

1、本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会备案。中国证监会对本基金募集的备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、投资于本基金面临的主要风险包括市场风险、投资风险、管理风险、流动性风险、本基金的特有风险、技术风险及其他风险等。在市场波动等因素的影响下，本基金投资有可能出现亏损。

3、投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，充分了解基金投资的风险和收益特征，根据自身的风险承受能力，审慎选择适合自己的基金产品。

4、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

5、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构销售网点代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案生效后方可执行，自决议生效之日起依照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

### 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；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

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。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十四、基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利和义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

- (17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资



人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
  - (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
  - (7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
  - (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
  - (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
  - (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
  - (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
  - (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照本合同及托管协议的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
  - (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
  - (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
  - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
  - (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
  - (12) 从基金管理人处接收并保存基金份额持有人名册；
  - (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
  - (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
  - (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

东吴转债份额、可转债A份额及可转债B份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果可转债A份额与可转债B份额的运作出现终止，则在终止可转债A份额与可转债B份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止可转债 A 份额与可转债 B 份额的运作；

(11) 终止可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易，但因可转债 A 份额与可转债 B 份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(12) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(13) 代表东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各基金份额总数 10%以上（含 10%，每一级份额均应占各该级份额总数的 10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额的 10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(14) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(15) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(6) 根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定，本基金修改可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市与交易规定；

(7) 在不变更本基金合同其他约定的条件下，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更东吴转债份额的收益分配方式

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提

议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（含 10%，每一级份额均应占各该级份额总数的 10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额总数的 10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人。本合同以下相同表述与此具有相同含义）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各该级基金份额总数 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召。

5、代表东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各该级基金份额总数 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各该级基金份额总数 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%，全部有效凭证所对应的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额分别占权益登记日东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各自基金总份额 50%以上。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开（下同）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

（2）基金管理人、基金托管人、持有东吴转债份额、可转债 A 份额 与可转债 B 份额各自的基金份额总数 10%以上（以权益登记日持有的份额数量为准）的基金份额持有人，可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将



其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合计代表东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各该级基金份额总数 10%以上（以权益登记日持有的份额数量为准）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

(6) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额持有人和代理人所持各自类别内的表决权 50%以上（含 50%）选举产生的一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## (六) 表决

东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 50%以上）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 2/3 以上，下同）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止可转债 A 份额与可转债 B 份额的运作、终止基金合同以及与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点

以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证, 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的, 不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集, 则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议, 召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法备案或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决, 在公告基金份额持有人大会决议时, 必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的, 从其规定。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### (一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额, 基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (三) 基金收益分配原则

本基金(包括东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额)不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过, 并经中国证监会备案后, 如果终止可转债 A 份额与可转债 B 份额的运作, 本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配规则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、基金上市费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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、公休假等，支付日期顺延。

###### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

###### 3、标的指数使用许可费

指数使用许可费根据基金管理人与指数开发商签署的相关许可协议确定并调整。在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.015% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用许可费每日计提，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元，基金设立当年，不足三个月的，按照三个月收费。

基金管理人可根据指数许可协议规定的费率、收费方式变更和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

### （一）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。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括可转债（含分离交易可转债）、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、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。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，须在达到可交易状态日起 10 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

### (三) 投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 债券的投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%;

(2) 投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 20%;

(3) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(4) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;

(5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券,不超过该证券的 10%;

(6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

(7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的 10%;基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的 20%;

(8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(9) 本基金持有的同一中期票据的比例,不得超过该中期票据规模的 10%;

(10) 本基金投资于同一原始权益人的各类中期票据的比例,不得超过该基金资产净值的 10%;

(11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市

公司可流通股票的 30%；

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第 (3)、(8)、(13)、(14) 项之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本托管协议生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。

### 2、基金资产净值、基金份额净值的公告方式

(1) 基金合同生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额净值。

(2) 在可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易后, 基金管理人将在每个交易日的次日, 通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介, 披露交易日的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额基金份额净值和基金份额累计净值。

(3) 在开始办理东吴转债份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在每个开放日的次日, 通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介, 披露开放日的东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额各自的基金份额净值和东吴转债份额的基金份额累计净值。

(4) 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日, 将基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## 七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### (一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的, 应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项, 由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告, 并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案生效后方可执行, 自决议生效之日起依照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

### (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;
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止, 在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- 3、《基金合同》约定的其他情形;
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组: 自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组, 基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成: 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有



从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

基金合同受中国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十五、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：东吴基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号

邮政编码：200135

法定代表人：王炯

成立日期：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务

#### 2. 基金托管人

名称：平安银行股份有限公司(简称：平安银行)

住所：中华人民共和国广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日。

组织形式：股份有限公司

注册资本：5,123,350,416 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：潘琦

联系电话：(0755)22168257

经营范围：办理人民币存、贷、结算、汇兑业务；人民币票据承兑和贴现

各项信托业务；经监管机构批准发行或买卖人民币有价证券；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；外汇存款、汇款；境内境外借款；从事同

业拆借；外汇借款；外汇担保；在境内境外发行或代理发行外币有价证券；买卖或代客买卖外汇及外币有价证券、自营外汇买卖；贸易、非贸易结算；办理国内结算；国际结算；外币票据的承兑和贴现；外汇贷款；资信调查、咨询、见证业务；保险兼业代理业务；代理收付款项；黄金进口业务；提供信用证服务及担保；提供保管箱服务；外币兑换；结汇、售汇；信用卡业务；经有关监管机构批准或允许的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括可转债（含分离交易可转债）、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、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。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，须在达到可交易状态日起 10 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资比例进行监督：

- (1) 债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 20%；
- (3) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (4) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；
- (8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (9) 本基金持有的同一中期票据的比例，不得超过该中期票据规模的 10%；
- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类中期票据的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；
- (11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。
- (12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- (13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆

回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第(3)、(8)、(13)、(14)项之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本托管协议生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本

次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定，并与基金托管人签订《基金投资非公开发行股票等流通受限证券风险控制补充协议》。

(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人

董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核,基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

7、基金托管人依据有关法律法规的规定、基金合同和本协议的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新,加盖公章并书面提交,并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后基金管理人或基金托管人应及时发送对方,基金管理人或基金托管人于2个工作日内电话或回函确认已知名单的变更。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,若无法阻止关联交易发生时,基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易,基金托管人应



按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

#### 8、基金托管人对基金投资中期票据的监督

(1) 基金投资中期票据应遵守《关于证券投资基金投资中期票据有关问题的通知》等有关法律法规的规定，并与基金托管人签订《基金投资中期票据风险控制补充协议》。

(2) 基金管理人应将经董事会批准的相关投资决策流程、风险控制制度以及基金投资中期票据相关流动性风险处置预案提供给基金托管人，基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。

基金管理人确定基金投资中期票据的，应根据《托管协议》及相关补充协议的约定向基金托管人提供其托管基金拟购买中期票据的数量和价格、应划付的金额等执行指令所需相关信息，并保证上述信息的真实、准确、完整。

基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资中期票据前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资中期票据出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

#### 9、基金托管人对基金投资中小企业私募债的监督

基金投资中小企业私募债券的，基金管理人应按照《托管协议的内容与格式》准则的规定，与基金托管人签订风险控制补充协议。协议内容应包括基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险和信用风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督等内容。

基金管理人应在基金首次投资中小企业私募债前将经董事会批准的相关投资决策流程、风险控制制度以及基金投资中小企业私募债券相关流动性风险处置预案提供给基金托管人。

10、基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资其他方面进行监督。

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额净值计、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(三)基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定,应及时通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并于收到通知后十个工作日内以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应及时向中国证监会报告。

(四)基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》、本协议约定的,应当立即通知基金管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

(五)基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,包括但不限于:在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定,基金管理人 对基金托管人履行托管职责的情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户和证券账户及债券托管账户,是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额净值,是否根据基金管理人指令办理清算交收,是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的,应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正,基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求

需向中国证监会报送基金监督报告的,基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金托管人在限期内纠正。

#### 四、基金财产的保管

##### (一)基金财产保管的原则

1、基金托管人应安全保管基金财产,未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

3、基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整和独立。

5、对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

##### (二)基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金合同生效前的募集资金应存放于专门账户,该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的,由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资,并出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上(含 2 名)中国注册会计师签字方为有效。

3、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中,并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

##### (三)基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开设和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### (四) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金,以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户,亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的,涉及相关账户的开设、使用的,若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### (五) 债券托管账户的开设和管理

1、募集资金验资后,基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户,并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后,由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易,由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2、基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议,协议正本由基金托管人保管,协议副本由基金管理人保存。

#### (六) 其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### (七) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

## 五、基金资产净值计算与会计核算

### (一) 基金资产净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人按照基金合同约定分别计算基金资产净值、东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

根据有关法律法规,基金资产净值、东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额参考净值计算及基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见的,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (二) 基金资产估值方法

#### 1、估值对象

基金所拥有的各类有价证券以及银行存款本息、备付金、保证金和其它资产及负债。

#### 2、估值方法

本基金按以下方式进行估值:

##### (1) 股票估值方法

1) 上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价进行调整,确定公允价值进行估值。

##### 2) 未上市股票的估值:

①首次发行的股票,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

②首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第1)条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$
（FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## (2) 债券估值方法

1)在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2)在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5) 交易所上市的中小企业私募债采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

6) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (3) 权证估值方法

1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值; 估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 以最近交易日的收盘价估值; 估值日无交易, 但最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的, 应对最近交易日的收盘价进行调整, 确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的权证, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

3) 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 因持有股票而享有的配股权证, 以配股除权日起到配股确认日止, 若收盘价高于配股价, 则按收盘价和配股价的差额进行估值, 若收盘价低于配股价, 则估值为零。

5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (4) 资产支持证券的估值方法

1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

2) 全国银行间市场交易的资产支持证券, 根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(5) 交易所上市的中小企业私募债采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

### (6) 其他资产的估值方法

(7) 在任何情况下, 基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不

能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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价格估值。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### (三) 估值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

1、如采用本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第（1）—（5）进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

（2）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

（3）基金管理人、基金托管人按估值方法的第（6）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则



#### **(四) 基金账册的建立**

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后, 应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则, 分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册, 对相关各方各自的账册定期进行核对, 互相监督, 以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧, 应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的, 基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正, 保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符, 暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的, 以基金管理人的账册为准。

#### **(五) 会计数据和财务指标的核对**

双方应每个交易日核对账目, 如发现双方的账目存在不符的, 基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正, 确保核对一致。若当日核对不符, 暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的, 以基金管理人的账册为准。

#### **(六) 基金定期报告的编制和复核**

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制, 应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制, 应于每季度终了后 15 个工作日内完成; 更新的招募说明书在基金合同生效后每 6 个月公告一次, 于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告; 年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人在月度报表完成当日, 对报表加盖公章后, 以约定方式将有关报表提供基金托管人; 基金托管人在 2 个工作日内进行复核, 并将复核结果书面或其他约定方式通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日, 以约定方式将有关报表提供基金托管人; 基金托管人在 5 个工作日内进行复核, 并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日, 将有关报告提供基金托管人, 基金托管人在收到 15 日内进行复核, 并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日, 将有关报告提供基金托管人, 基金托管人在收到后 20 日内进行复核, 并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日, 将有关报告提供基金托管人, 基金托管人在收到后 30 日内复核, 并将复核结果反馈给基金管理人。基金托管人在复核过程中, 发现双方的报表存在不符时, 基金管理人和基金托管人应共同查明原因, 进行调整, 调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致, 基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告, 基金托管人有权就相关情况报证监会备

案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

### 七、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金注册登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权利登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

### 八、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## 九、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 基金托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

### (二) 基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(1) 基金财产清算组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(2) 基金财产清算组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 4、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

1) 支付基金财产清算费用；

2) 缴纳基金所欠税款；

3) 清偿基金债务；

4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足可转债 A 份额的本金及应计收益分配，剩余部分（如有）由可转债 B 份额的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

### **(三)基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告

### **(四)基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十六、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。以下是主要的服务内容：

### 一、持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### 二、持有人交易记录查询及定期对账单服务

1、本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

2、定期对账单服务

基金管理人设立客户服务部门。对账单服务分为电子对账单服务和纸质对账单服务。每月度、季度、年度结束后 10 个工作日内，客户服务部门将通过邮件向所有选择电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单，记录该持有人最近一月度，或一季度或一年度内所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。每年度结束后 30 个工作日内，客户服务部门将向本年度有交易的或持有份额的，且选择纸质对账单服务的基金份额持有人寄送该持有人最近一年度纸质对账单。基金份额持有人也可通过基金公司网站下载电子对账单或拨打基金公司客服热线索取电子或纸质对账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

### 三、定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可利用直销网点或代理销售网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体方法另行公告。

### 四、客户服务中心（Call Center）

客服中心自动语音系统提供 7\*24 小时基金交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

客服中心人工坐席在每个工作日提供不少于 8 小时的坐席服务，投资者可以通过拨打热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、资料修改、疑难解答、客户投诉/意见/建议处理、信函补寄、基金信息的定制等专项服务。

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

## 五、网络服务

公司网站可为客户提供下列服务：信息定制、在线账户查询、信息下载、专家在线咨询、举办网上活动等。

客户还可通过公司网站直接进行网上交易，享受一站式服务。

公司网站：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

## 二十七、其它应披露事项

(1) 2017年11月14日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(2) 2017年11月15日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(3) 2017年11月16日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(4) 2017年11月16日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务的公告》；

(5) 2017年11月17日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(6) 2017年11月20日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(7) 2017年11月21日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(8) 2017年11月22日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(9) 2017年11月23日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》；

(10) 2017年11月24日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨

潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(11) 2017年11月27日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(12) 2017年11月28日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(13) 2017年11月28日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告》;

(14) 2017年11月28日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》;

(15) 2017年11月29日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(16) 2017年11月30日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(17) 2017年12月01日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(18) 2017年12月04日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能不定期份额折算的提示公告》;

(19) 2017年12月04日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间可转债A份额停复牌的公告》;



(20) 2017年12月04日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债A份额本次定期折算期间约定年收益率的公告》；

(21) 2017年12月05日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》；

(22) 2017年12月05日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《关于东吴可转债A份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告》；

(23) 2017年12月05日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告》；

(24) 2017年12月05日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金B份额不定期份额折算的风险提示公告》；

(25) 2017年12月05日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《关于调整可转债B(证券编码：150165)折算基准日证券简称的公告》；

(26) 2017年12月06日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间可转债A份额、可转债B份额停复牌的公告》；

(27) 2017年12月07日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》；

(28) 2017年12月07日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于可转债A和可转债B不定期份额折算后前收盘价调整的公告》；

(29) 2017年12月22日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金更新招募说明书以

及摘要》;

(30) 2017年12月28日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于调整流通受限股票估值方法的公告》;

(31) 2017年12月29日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》;

(32) 2017年12月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司股权变更公告》;

(33) 2017年12月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金及资产管理计划征收增值税的公告》;

(34) 2018年01月02日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2017年年度资产净值公告》;

(35) 2018年01月10日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构并推出转换业务的公告》;

(36) 2018年01月10日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加南京苏宁基金销售有限公司费率优惠的公告》;

(37) 2018年01月19日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金2017年第4季度报告》;

(38) 2018年01月31日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在大泰金石基金销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告》;

(39) 2018年01月31日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加大泰金石基金销售

有限公司费率优惠的公告》;

(40) 2018年02月05日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在上海利得基金销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告》;

(41) 2018年02月05日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加上海利得基金销售有限公司费率优惠的公告》;

(42) 2018年02月06日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠的公告》;

(43) 2018年03月26日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于修改东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同、托管协议的公告》;

(44) 2018年03月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》;

(45) 2018年03月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司费率优惠的公告》;

(46) 2018年03月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加东海证券股份有限公司费率优惠的公告》;

(47) 2018年03月31日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金2017年年度报告以及摘要》;

(48) 2018年04月03日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告》;

(49) 2018年04月03日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司副理解聘的公

告》;

(50) 2018年04月11日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金惠家保险代理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》;

(51) 2018年04月11日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加金惠家保险代理有限公司费率优惠的公告》;

(52) 2018年04月14日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于工商变更登记的公告》;

(53) 2018年04月19日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金2018年第1季度报告》。

## 二十八、招募说明书存放及查阅方式

### 一、招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、销售机构和注册登记机构的办公场所，并刊登在基金管理人的网站上。

### 二、招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

## 二十九、备查文件

- 一、 本基金在中国证监会注册备案的募集文件
- 二、 《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》
- 三、 《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》
- 四、 法律意见书
- 五、 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、 中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其他备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

东吴基金管理有限公司

二零一八年六月二十二日