

# 东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同于 2014 年 05 月 09 日经中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，基金合同自该日起正式生效。

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

### 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

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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年5月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)

## 一、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

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       | 占总股本比例 |
|------------|--------|
| 东吴证券股份有限公司 | 70%    |
| 海澜集团有限公司   | 30%    |

|     |      |
|-----|------|
| 合 计 | 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

马震亚先生,董事长,硕士,高级经济师,会计师,中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员;苏州证券有限责任公司财务部副总经理(主持工作);东吴证券有限责任公司财务部总经理,财务总监,东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人,现任东吴基金管理有限公司董事长。

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、东吴证券上海分公司总经理,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、总规划师,现任东吴证券股份有限公司党委委员、副总裁、资产管理部总经理。

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,经济法学博士。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，担任长方集团股份有限公司独立董事。

## 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，现任东吴创业投资有限公司董事长。

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总经理，合规风控部总经理，现任合规风控副总监兼合规风控部总经理，董事会秘书。

## 3、高管人员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

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、东吴证券上海分公司总经理，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。

徐明先生，副总经理，硕士，中共党员。历任中国银行苏州分行营业部会计；苏州华纺经济贸易有限公司财务科会计；中创证券有限责任公司苏州十全街营业部副总经理；东吴证券有限责任公司胥江路证券营业部副总经理，总经理；东吴证券股份有限公司石路证券营业部总经理，太仓分公司总经理，常熟分公司总经理；东吴基金管理有限公司营销总监兼营销管理部总经理，现任东吴基金管理有限公司副总经理兼营销管理部总经理。

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，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，其中，2014年6月28日至2018年4月19日担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（2017年12月25日由原东吴配置优化混合型证券投资基金转型）基金经理，2013年6月25日至2018年12月5日担任东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）（原东吴鼎利分级债券型证券投资基金）基金经理。

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。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

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 2018 年末，平安银行有 80 家分行，共 1,057 家营业机构。

2018 年，平安银行实现营业收入 1,167.16 亿元(同比增长 10.3%)、净利润 248.18 亿元(同比增长 7.0%)、资产总额 34,185.92 亿元(较上年末增长 5.2%)、吸收存款余额 21,285.57 亿元(较上年末增长 6.4%)、发放贷款和垫款总额(含贴现)19,975.29 亿元(较上年末增幅 17.2%)。

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的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2018年12月末，平安银行股份有限公司托管净值规模合计5.59万亿，托管证券投资基金共110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、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、华润元大现金通货币市场基金、平安鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、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、平安惠金定期

开放债券型证券投资基金、鹏华弘腾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、平安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、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安金管家货币市场基金、平安鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨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、平安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、招商稳阳定期开放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、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、平安转型创新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、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、易方达瑞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、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富安纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金、富荣福锦混合型证券投资基金、前海开源丰鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 (ETF)、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金 (ETF)、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、招商添荣 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金。

## 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工

### 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。

### 三、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

##### 2、场外代销机构：

###### （1）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客服电话：95559

公司网址：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：李建红

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

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：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-3

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

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：陈震山

客服热线：95398

公司网址：[www.hzbank.com.cn](http://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

客服电话：0577-96699

公司网址：[www.wzbank.cn](http://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

客服热线：95319

公司网址：[www.jsbchina.cn](http://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

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

公司网址：<http://www.txsec.com>

## (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 1002 室

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

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

## (11) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

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 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服热线：95021/400-1818-188

公司网址：<http://fund.eastmoney.com>

## (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

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文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000766123

公司网址：www.fund123.cn

(15) 上海长量基金销售有限公司

代销机构：上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

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：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客服热线：4008-773-772

公司网址：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：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 14 层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

## (18) 浙江金观诚基金销售有限公司

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 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：蒋雪琦

客服热线：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

## (19) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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

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：王锋

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

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 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客服热线：400-619-9059

公司网址：www.hcjjin.com

## (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

客服热线：010-58170761

公司网址：<http://www.shengshiview.com.cn/>

## (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

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 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服热线：400-678-5095

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

## (26) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

客服热线：4006-802-123

公司网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

## (27) 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

客服热线：0571-86915761

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

(28) 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

客服热线：400-821-0203

(29) 上海联泰基金销售有限公司

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

客服热线：400-166-6788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

(30) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

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：金佶

客服热线：400-821-3999

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

(31) 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：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服热线：400-820-5369

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

(32) 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：王之光

客户服务电话：4008219031

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



## (33) 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 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.com/>

## (34) 珠海盈米基金销售有限公司

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

客户服务电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

## (35) 奕丰基金销售有限公司

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）

客服热线：400-684-0500

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

## (36) 中民财富管理（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

法定代表人：弭洪军

客服热线：400-876-5716

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

## (37) 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

客户服务电话：400-990-8826

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

(38) 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

客户服务热线：95521/4008888666

公司网址：<http://www.gtja.com>

(39) 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

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(40) 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 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

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

(41) 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：霍达

客服电话：95565、4008881111

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

(42) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

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：张佑君

客服热线：95548

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

(43) 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 2-6 层

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：陈共炎

客服电话：4008-888-888 或 95551

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

(44) 申万宏源证券有限公司

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）

客服电话：95523 或 4008895523

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

联系人：黄莹

(45) 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：尤习贵

客服电话：95579 或 4008-888-999

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

(46) 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：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

法定代表人：王连志

客服电话：95517

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

(47) 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

客服热线：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

(48) 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

客服热线：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

(49) 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：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.ewww.com.cn

(50) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

公司网址：www.zxzqsd.com.cn

(51) 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

客服电话：0512-3339628895530

公司网址：www.dwzq.com.cn

(52) 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：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(53) 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：周健男

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(54) 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

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

(55) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

传真：021-53686100，021-53686200

网址：www.shzq.com

(56) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市金融一街 8 号国联大厦

法定代表人：姚志勇

客服电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn

(57) 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

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

(58) 华安证券股份有限公司

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

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

公司网址：www.hazq.com

(59) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

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 26-28 楼

法定代表人：蔡一兵

客服电话：95317

公司网址：www.cfzq.com

(60) 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：赵俊

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(61) 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

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(62) 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：北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航资本大厦 35 层

法定代表人：王晓峰

客服电话：95335

公司网址：www.avicsec.com

(63) 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

客服热线：68777877

公司网址：www.cf-clsa.com

(64) 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

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(65) 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

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

客户服务电话：95323；4001099918

公司网站：www.cfsc.com.cn

(66) 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

客服热线：4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

(67) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

客服热线：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

(68)九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法定代表人：魏先锋

客服热线：95305

公司网址：<http://www.jzsec.com>

(69)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

客服热线：95310

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

(70)长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼

法定代表人：王勇

客服热线：400-0099-886

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

(71)爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

客服电话：4001962502

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

(72)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

客服热线：400-8557333

公司网址：www.jhjfund.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（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、张亚旋

#### 四、基金的名称

本基金名称：东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金

#### 六、基金的上市交易

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。

#### 七、基金的投资目标

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。

#### 八、基金的投资范围

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。

## 九、基金的投资策略

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。

## 十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：

中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

## 十一、基金的风险收益特征

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。

## 十二、基金的投资组合报告

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 2019 年 4 月 17 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 2019 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  | 22,303,618.03 | 97.76        |
|    | 其中：债券   | 22,303,618.03 | 97.76        |
|    | 资产支持证券  | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资   | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资 | -             | -            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 6 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 330,236.20    | 1.45   |
| 8 | 其他资产              | 181,889.48    | 0.80   |
| 9 | 合计                | 22,815,743.71 | 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  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,400,140.00  | 6.29         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,400,140.00  | 6.29         |
| 4  | 企业债券      | 201.40        | 0.00         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 20,903,276.63 | 93.89        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 22,303,618.03 | 100.18       |

## 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   | 21,920 | 2,517,950.40 | 11.31        |
| 2  | 127010 | 平银转债   | 17,400 | 2,058,942.00 | 9.25         |
| 3  | 018005 | 国开1701 | 14,000 | 1,400,140.00 | 6.29         |

|   |        |      |       |            |      |
|---|--------|------|-------|------------|------|
| 4 | 113013 | 国君转债 | 6,950 | 822,949.50 | 3.70 |
| 5 | 128024 | 宁行转债 | 5,892 | 723,714.36 | 3.25 |

#### 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   | 3,299.54   |
| 2  | 应收证券清算款 | 100,000.00 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 76,590.94  |
| 5  | 应收申购款   | 1,999.00   |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 181,889.48 |

## (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 | 2,517,950.40 | 11.31        |
| 2  | 113013 | 国君转债 | 822,949.50   | 3.70         |
| 3  | 128024 | 宁行转债 | 723,714.36   | 3.25         |
| 4  | 123006 | 东财转债 | 594,545.00   | 2.67         |
| 5  | 113008 | 电气转债 | 557,019.60   | 2.50         |
| 6  | 127005 | 长证转债 | 510,555.60   | 2.29         |
| 7  | 123003 | 蓝思转债 | 326,163.24   | 1.47         |
| 8  | 110042 | 航电转债 | 321,160.50   | 1.44         |
| 9  | 113015 | 隆基转债 | 306,200.00   | 1.38         |
| 10 | 113017 | 吉视转债 | 277,775.00   | 1.25         |
| 11 | 128035 | 大族转债 | 274,875.00   | 1.23         |
| 12 | 113014 | 林洋转债 | 264,325.00   | 1.19         |
| 13 | 128034 | 江银转债 | 262,308.54   | 1.18         |
| 14 | 110040 | 生益转债 | 254,655.90   | 1.14         |
| 15 | 110043 | 无锡转债 | 252,540.00   | 1.13         |
| 16 | 113018 | 常熟转债 | 236,545.40   | 1.06         |
| 17 | 128045 | 机电转债 | 234,840.00   | 1.05         |
| 18 | 113508 | 新风转债 | 234,586.00   | 1.05         |
| 19 | 128019 | 久立转2 | 232,680.00   | 1.05         |
| 20 | 113019 | 玲珑转债 | 225,940.00   | 1.01         |
| 21 | 113009 | 广汽转债 | 220,520.00   | 0.99         |
| 22 | 128018 | 时达转债 | 213,680.00   | 0.96         |
| 23 | 128032 | 双环转债 | 213,600.00   | 0.96         |
| 24 | 110031 | 航信转债 | 208,375.80   | 0.94         |
| 25 | 128023 | 亚太转债 | 194,140.00   | 0.87         |
| 26 | 113512 | 景旺转债 | 193,755.00   | 0.87         |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 27 | 127004 | 模塑转债 | 193,480.00 | 0.87 |
| 28 | 110044 | 广电转债 | 193,164.00 | 0.87 |
| 29 | 128021 | 兄弟转债 | 192,352.48 | 0.86 |
| 30 | 128030 | 天康转债 | 183,330.00 | 0.82 |
| 31 | 128015 | 久其转债 | 176,383.20 | 0.79 |
| 32 | 128016 | 雨虹转债 | 175,311.00 | 0.79 |
| 33 | 110041 | 蒙电转债 | 166,350.00 | 0.75 |
| 34 | 128036 | 金农转债 | 162,530.70 | 0.73 |
| 35 | 128028 | 赣锋转债 | 158,775.00 | 0.71 |
| 36 | 128020 | 水晶转债 | 156,282.20 | 0.70 |
| 37 | 128041 | 盛路转债 | 151,500.00 | 0.68 |
| 38 | 128017 | 金禾转债 | 150,416.00 | 0.68 |
| 39 | 113518 | 顾家转债 | 147,396.00 | 0.66 |
| 40 | 127006 | 敖东转债 | 146,326.45 | 0.66 |
| 41 | 123007 | 道氏转债 | 144,951.30 | 0.65 |
| 42 | 128027 | 崇达转债 | 142,296.00 | 0.64 |
| 43 | 110034 | 九州转债 | 141,337.60 | 0.63 |
| 44 | 113504 | 艾华转债 | 136,776.00 | 0.61 |
| 45 | 113506 | 鼎信转债 | 135,990.00 | 0.61 |
| 46 | 113517 | 曙光转债 | 125,230.00 | 0.56 |
| 47 | 113516 | 吴银转债 | 123,740.00 | 0.56 |
| 48 | 110033 | 国贸转债 | 122,985.80 | 0.55 |
| 49 | 128038 | 利欧转债 | 119,098.21 | 0.53 |
| 50 | 128039 | 三力转债 | 117,490.00 | 0.53 |
| 51 | 113515 | 高能转债 | 113,460.00 | 0.51 |
| 52 | 128025 | 特一转债 | 111,880.00 | 0.50 |
| 53 | 127003 | 海印转债 | 111,550.00 | 0.50 |
| 54 | 123002 | 国祯转债 | 110,574.00 | 0.50 |
| 55 | 128010 | 顺昌转债 | 109,692.04 | 0.49 |
| 56 | 113505 | 杭电转债 | 107,870.00 | 0.48 |
| 57 | 128044 | 岭南转债 | 106,444.80 | 0.48 |
| 58 | 128014 | 永东转债 | 104,570.00 | 0.47 |



|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 59 | 128026 | 众兴转债 | 100,950.30 | 0.45 |
| 60 | 128033 | 迪龙转债 | 100,914.90 | 0.45 |
| 61 | 128013 | 洪涛转债 | 98,650.00  | 0.44 |
| 62 | 123012 | 万顺转债 | 97,517.96  | 0.44 |
| 63 | 128029 | 太阳转债 | 94,074.40  | 0.42 |
| 64 | 123004 | 铁汉转债 | 94,072.00  | 0.42 |
| 65 | 123009 | 星源转债 | 91,416.00  | 0.41 |
| 66 | 128022 | 众信转债 | 89,078.14  | 0.40 |
| 67 | 123001 | 蓝标转债 | 88,662.00  | 0.40 |
| 68 | 127007 | 湖广转债 | 87,902.75  | 0.39 |
| 69 | 123015 | 蓝盾转债 | 75,030.00  | 0.34 |
| 70 | 123011 | 德尔转债 | 66,948.00  | 0.30 |
| 71 | 113509 | 新泉转债 | 64,698.00  | 0.29 |
| 72 | 110038 | 济川转债 | 56,435.00  | 0.25 |

#### (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

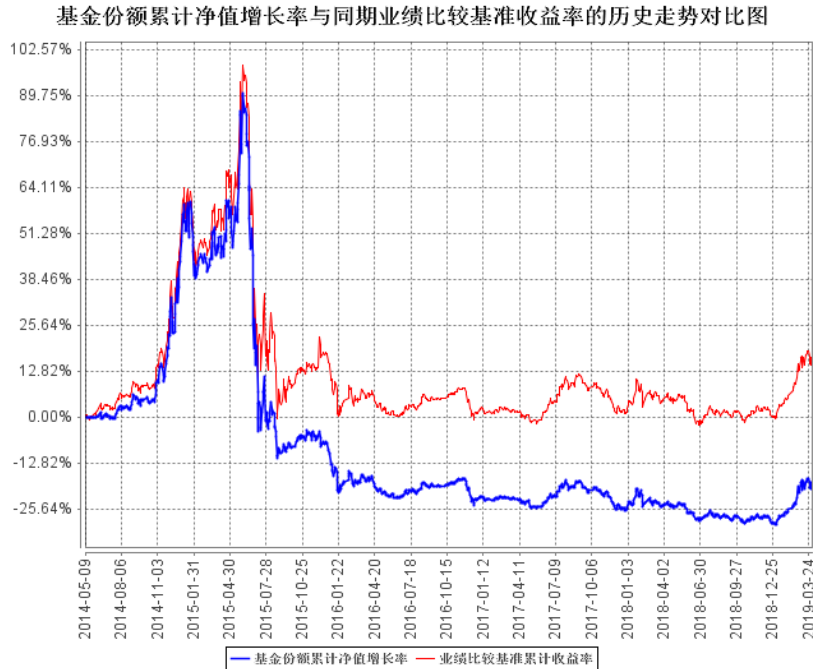
| 阶段                    | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|-----------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 2014.05.09-2014.12.31 | 49.22%  | 1.21%     | 53.77%     | 1.19%         | -4.55%  | 0.02%  |
| 2015.01.01-2015.12.31 | -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% |
| 2018.01.01-2018.12.31 | -5.21%  | 0.53%     | -1.07%     | 0.60%         | -4.14%  | -0.07% |
| 2019.01.01-2019.03.31 | 15.97%  | 1.02%     | 16.61%     | 0.93%         | -0.64%  | 0.09%  |
| 2014.05.09-2019.03.31 | -18.35% | 1.31%     | 16.88%     | 1.50%         | -35.23% | -0.19% |

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2019年3月31日)



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、费用概览

### 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：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           | 0.5%            |
| 10 万元 ≤ M < 100 万元  | 0.4%            |
| 100 万元 ≤ M < 200 万元 | 0.2%            |
| 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）

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人定

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。

## 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。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”中，对相关内容进行了更新。
- 2、在“三、基金管理人”中，对相关内容进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”中，对相关内容进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”中，对相关内容进行了更新。
- 5、在“十、东吴转债份额的申购与赎回”中，对相关内容进行了更新。
- 6、在“十二、基金的投资”中，对相关内容进行了更新。
- 7、在“十三、基金的业绩”中，对相关内容进行了更新。
- 8、在“二十七、其他应披露事项”中，对相关内容进行了更新。

## 十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2019年6月21日签署。

东吴基金管理有限公司  
二零一九年六月二十一日