

关于东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划变更为东吴中短债债券型发起式证券投资基金相关业务安排的公告

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》《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，东吴证券股份有限公司旗下的东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）经中国证监会证监许可〔2025〕671号文准予变更注册。集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会，并于2025年5月28日表决通过了《关于东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为东吴中短债债券型发起式证券投资基金有关事项的议案》。

自本公告日起（即 2025 年 6 月 17 日），“东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划”变更为“东吴中短债债券型发起式证券投资基金”（以下简称“本基金”），管理人由东吴证券股份有限公司变更为东吴基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）。

一、集合计划份额持有人大会会议情况

集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2025年4月28日起至2025年5月27日17:00止。会议审议了《关于东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为东吴中短债债券型发起式证券投资基金有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”），并由参与本次集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人或其代理人对本次会议议案进行表决。根据《关于东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次集合计划份额持有人大会于 2025 年5月28日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。

二、本次变更主要内容

1、产品名称变化：由东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划变更为东吴中短债债券型发起式证券投资基金。

2、管理人变化：东吴证券股份有限公司变更为东吴基金管理有限公司。

3、基金经理变化：投资经理由“东吴证券旗下投资经理江逸舟”变更为“东吴基金旗下基金经理邵笛”。

4、产品类别变化：由债券型集合资产管理计划变更为债券型发起式证券投资基金，申购本基金的发起资金金额不少于1,000万元，且发起资金申购的基金份额持有期限自《东吴

中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效之日起不少于3年，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

5、投资范围变化：由“本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可分离交易可转换债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。其中企业债、公司债、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于 AA，短期融资券债项评级不低于A-1。本集合计划不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围”变更为“本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具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。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围”。

6、投资组合比例变化：“投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于中短债主题证券的资产比例不低于非现金集合计划资产的80%。每个交易日日终在扣国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本集合计划所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可分离交易可转换债的纯债部分、资产支持证券等金融工具。如法律法规或监管机构允许集合计划投资其他品种或变更投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以相应调整上述集合计划的投资范围和投资比例规定”变更为“本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保

证金后，持有现金或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。本基金所指的中短期债券是指剩余期限或行权剩余期限不超过三年（含）的债券资产，主要包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例”。

7、投资策略变化：“本集合计划主动投资于信用债（不含可交换债券、可转换债券）的信用评级不低于AA，其中，投资于信用评级为AAA及以上的信用债的比例不低于信用债资产的50%；投资于信用评级为AA+的信用债比例不高于信用债资产的50%；投资于信用评级为AA的信用债的比例不高于信用债资产的20%”调整为“本基金投资于信用评级在AA+级及以上的信用债券（含资产支持证券，下同）。其中，AA+级信用债占本基金所投资的信用债比例为0-50%；AAA级信用债占本基金所投资的信用债比例为50%-100%”；并调整资产配置策略、债券投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略，删除杠杆策略。

8、投资限制变化：调整资产支持证券、债券回购投资限制等。

9、争议解决条款变化：将争议“向集合计划管理人住所地有管辖权的法院提起诉讼……也可根据事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁”调整为“提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）”。

10、根据法律法规更新情况及基金实际投资运作需要，同步更新相关法律文件。

三、其他需要提示的事项

1、自本公告日起（即2025年6月17日），《东吴安鑫中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》失效且《基金合同》同时生效。本基金管理人股东东吴证券股份有限公司作为发起资金提供方使用发起资金申购金额1000万元（不含申购费用），且持有发起资金申购份额的期限自基金合同生效日起不少于3年。

2、自《基金合同》生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

3、本基金开放申购、赎回等业务的时间以基金管理人后续发布的公告为准。

4、投资者如对上述事项有任何疑问，可以通过本基金管理人的网站（www.scfund.com.cn）或全国统一客服热线（400-821-0588）了解详情。

风险提示：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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请

投资者在投资基金前仔细阅读基金的《基金合同》《招募说明书》《基金产品资料概要》及其更新等法律文件，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金管理人不对基金投资收益做出任何承诺或保证。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2025年6月17日