

东吴中证可转换债券指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 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。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东吴中证可转债指数
基金主代码	165809
交易代码	165809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 12 日
报告期末基金份额总额	8,812,174.86 份
投资目标	本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为债券指数基金，对指数投资部分，采用优化复制标的指数的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
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%
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，具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020 年 10 月 1 日 — 2020 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	160,591.26
2. 本期利润	223,413.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0237
4. 期末基金资产净值	9,591,385.32
5. 期末基金份额净值	1.0884

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

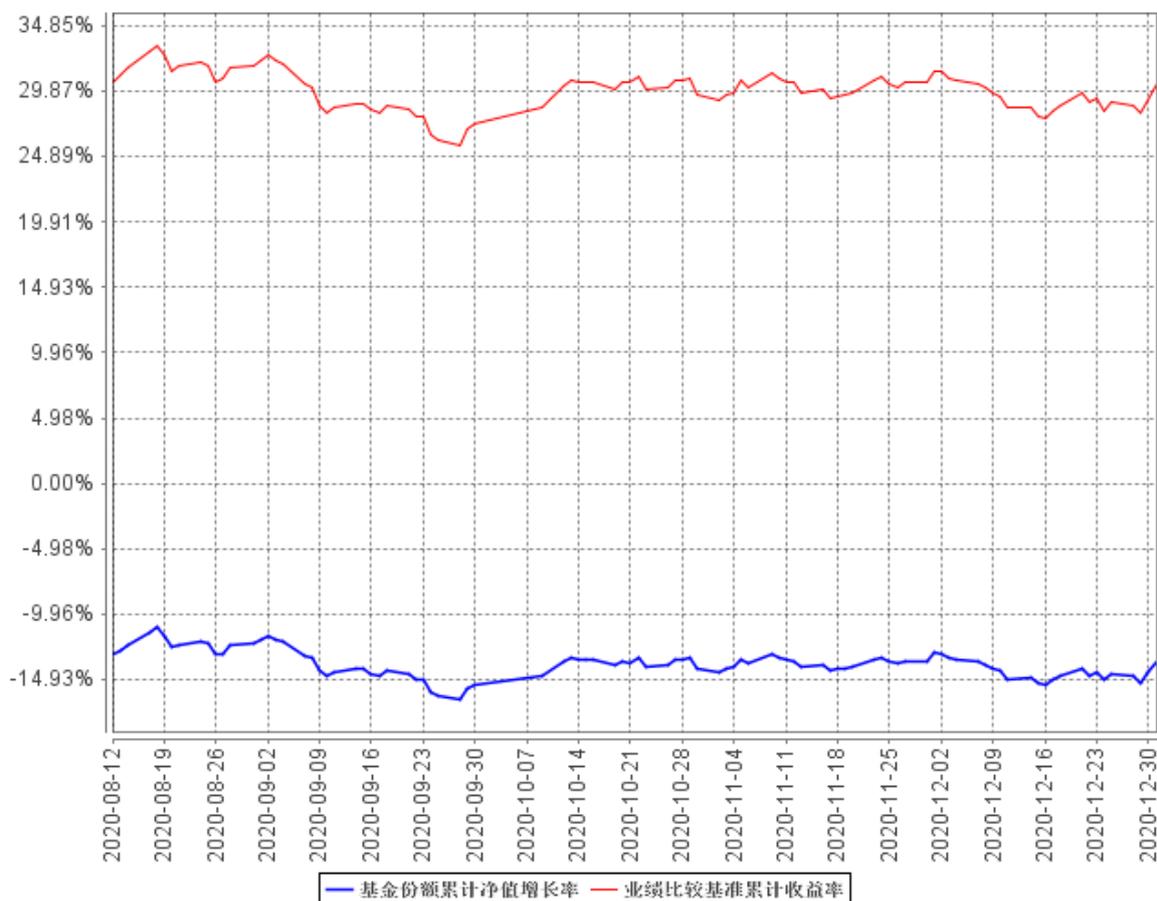
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	2.10%	0.48%	2.41%	0.48%	-0.31%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-1.35%	0.52%	-0.62%	0.50%	-0.73%	0.02%

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%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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、本基金转型日为 2020 年 8 月 12 日，图示日期为 2020 年 8 月 12 日至 2020 年 12 月 31 日；自本基金转型起至报告期末不满一年。

3、转型后的投资范围及投资比例与转型前一致；本报告期内，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王文华	基金经理	2019年12月24日	-	13年	王文华女士，中国国籍，南开大学经济学硕士，具备证券投资

					基金从业资格。曾任职中诚信证券评估有限公司高级分析师；联合证券股份有限公司投资银行高级经理。2012 年 3 月起加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2012 年 3 月起加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2014 年 10 月 15 日至 2020 年 7 月 17 日担任东吴增利债券型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月 7 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2018 年 4 月 11 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2019 年 12 月 24 日至今担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金（原东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金）基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易

管理制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,海外经济持续复苏带动国内出口增速大幅提升,房地产销售的持续回暖带动房地产投资增速进一步回升。前期受疫情影响较大的消费也逐步恢复,社会消费品零售总额同比转正后继续提升。制造业投资也渐有起色,同比增速改善明显。国内经济稳步恢复,持续向好,带动长短端利率同步提升。3个月同业存款从2.8%附近上升至11月末的3.3%附近。10年期国债收益率自3.15%附近上行至12月中旬的3.3%附近。

11月中旬,河南国有企业永城煤电债券违约,引发信用债市场震动,相似资质的企业债券二级折价抛售、一级发行受阻,信用利差大幅走阔。11月末,央行意外加量MLF2000亿,12月中续作MLF9500亿,并持续维持12月份银行间流动性的整体宽裕。3个月同业存款自高点回落至12月末的2.7%附近,10年期国债收益率也回落至3.14%附近。

可转债市场继续扩容,四季度发行上市可转债65只,融资金额1000亿元。中证可转债指数跟随股票市场高位震荡,自9月末的359.21上行至年末的368.30。

本基金对转债指数进行优化配置,跟踪指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0884元;本报告期基金份额净值增长率为2.10%,业绩比较基准收益率为2.41%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,因赎回等原因,本基金于2020年10月1日至2020年12月31日出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,已上报中国证监会,公司正在完善相关应对方案。本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	9,613,758.60	98.07
	其中：债券	9,613,758.60	98.07
	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	70,212.79	0.72
8	其他资产	119,233.69	1.22
9	合计	9,803,205.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 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。

5.4 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	549,780.00	5.73
	其中：政策性金融债	549,780.00	5.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,063,978.60	94.50
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	9,613,758.60	100.23

5.5 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	110059	浦发转债	8,000	814,400.00	8.49
2	113021	中信转债	6,550	689,125.50	7.18
3	113011	光大转债	5,050	625,594.00	6.52
4	018013	国开 2004	5,500	549,780.00	5.73
5	110053	苏银转债	3,330	360,505.80	3.76

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,223.12
2	应收证券清算款	78,568.53

3	应收股利	-
4	应收利息	30,792.40
5	应收申购款	6,649.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,233.69

5.10.4 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	110059	浦发转债	814,400.00	8.49
2	113021	中信转债	689,125.50	7.18
3	113011	光大转债	625,594.00	6.52
4	110053	苏银转债	360,505.80	3.76
5	113013	国君转债	137,402.00	1.43
6	113026	核能转债	134,433.00	1.40
7	127005	长证转债	109,437.50	1.14
8	128112	歌尔转 2	105,553.80	1.10
9	127012	招路转债	85,616.20	0.89
10	110061	川投转债	83,517.00	0.87
11	110051	中天转债	79,890.80	0.83
12	113035	福莱转债	63,888.30	0.67
13	113014	林洋转债	61,740.00	0.64
14	110043	无锡转债	61,548.90	0.64
15	128108	蓝帆转债	60,455.00	0.63
16	110062	烽火转债	58,926.40	0.61
17	110065	淮矿转债	58,006.00	0.60
18	110067	华安转债	57,829.80	0.60
19	110048	福能转债	56,200.00	0.59
20	128095	恩捷转债	54,930.00	0.57
21	128081	海亮转债	51,558.00	0.54
22	128048	张行转债	51,408.00	0.54
23	113024	核建转债	50,745.00	0.53
24	113009	广汽转债	50,185.30	0.52

25	128035	大族转债	49,329.00	0.51
26	113034	滨化转债	45,563.70	0.48
27	128107	交科转债	44,271.80	0.46
28	113029	明阳转债	43,285.20	0.45
29	127006	敖东转债	42,644.10	0.44
30	110031	航信转债	42,148.00	0.44
31	110047	山鹰转债	41,663.70	0.43
32	128109	楚江转债	41,657.00	0.43
33	113586	上机转债	41,464.00	0.43
34	128065	雅化转债	40,929.00	0.43
35	113025	明泰转债	40,854.40	0.43
36	127015	希望转债	39,751.80	0.41
37	113508	新凤转债	39,637.50	0.41
38	128034	江银转债	38,937.60	0.41
39	128028	赣锋转债	38,715.20	0.40
40	113545	金能转债	38,515.00	0.40
41	128110	永兴转债	37,663.20	0.39
42	110066	盛屯转债	37,150.00	0.39
43	110068	龙净转债	36,043.00	0.38
44	113583	益丰转债	35,118.20	0.37
45	113033	利群转债	33,977.60	0.35
46	110041	蒙电转债	33,817.90	0.35
47	110063	鹰 19 转债	33,191.70	0.35
48	128029	太阳转债	33,107.50	0.35
49	128114	正邦转债	32,796.40	0.34
50	113543	欧派转债	31,795.10	0.33
51	110056	亨通转债	31,346.10	0.33
52	110034	九州转债	30,362.80	0.32
53	110057	现代转债	29,799.90	0.31
54	110064	建工转债	29,632.20	0.31
55	113582	火炬转债	29,369.00	0.31
56	110052	贵广转债	26,299.00	0.27
57	110055	伊力转债	25,696.50	0.27

58	127016	鲁泰转债	25,693.20	0.27
59	128078	太极转债	25,518.90	0.27
60	113017	吉视转债	24,172.50	0.25
61	127011	中鼎转 2	24,110.00	0.25
62	110069	瀚蓝转债	22,720.50	0.24
63	128026	众兴转债	22,316.70	0.23
64	127007	湖广转债	22,181.77	0.23
65	127013	创维转债	21,925.20	0.23
66	110033	国贸转债	21,580.00	0.22
67	113516	苏农转债	21,566.00	0.22
68	127017	万青转债	20,935.80	0.22
69	128096	奥瑞转债	20,871.00	0.22
70	128111	中矿转债	20,487.60	0.21
71	123048	应急转债	20,372.80	0.21
72	128113	比音转债	19,859.40	0.21
73	123035	利德转债	19,417.40	0.20
74	128046	利尔转债	19,324.50	0.20
75	123050	聚飞转债	19,291.20	0.20
76	128032	双环转债	18,625.70	0.19
77	113563	柳药转债	18,550.40	0.19
78	113542	好客转债	18,097.60	0.19
79	123049	维尔转债	17,792.00	0.19
80	123055	晨光转债	17,113.80	0.18
81	128017	金禾转债	16,812.40	0.18
82	123017	寒锐转债	16,631.00	0.17
83	128106	华统转债	16,550.80	0.17
84	113012	骆驼转债	16,531.50	0.17
85	128075	远东转债	15,934.10	0.17
86	128083	新北转债	15,895.50	0.17
87	128018	时达转债	15,357.00	0.16
88	123044	红相转债	15,253.70	0.16
89	113504	艾华转债	15,205.30	0.16
90	128105	长集转债	15,040.20	0.16

91	113559	永创转债	14,840.00	0.15
92	128097	奥佳转债	14,578.30	0.15
93	113579	健友转债	13,722.00	0.14
94	123053	宝通转债	13,388.40	0.14
95	110060	天路转债	13,291.20	0.14
96	123022	长信转债	13,015.80	0.14
97	113505	杭电转债	12,818.00	0.13
98	113587	泛微转债	12,494.40	0.13
99	128090	汽模转 2	12,307.00	0.13
100	128057	博彦转债	12,230.90	0.13
101	128093	百川转债	11,891.00	0.12
102	113549	白电转债	11,645.70	0.12
103	110038	济川转债	11,544.50	0.12
104	113535	大业转债	11,517.60	0.12
105	128074	游族转债	11,456.40	0.12
106	113550	常汽转债	11,408.80	0.12
107	113584	家悦转债	11,359.70	0.12
108	123007	道氏转债	11,251.00	0.12
109	123028	清水转债	11,116.60	0.12
110	113016	小康转债	11,057.00	0.12
111	113528	长城转债	10,936.20	0.11
112	113588	润达转债	10,733.00	0.11
113	123025	精测转债	10,708.00	0.11
114	128063	未来转债	10,622.00	0.11
115	127014	北方转债	10,452.00	0.11
116	128049	华源转债	10,222.00	0.11
117	128014	永东转债	10,215.00	0.11
118	128033	迪龙转债	9,969.00	0.10
119	113537	文灿转债	9,906.40	0.10
120	113530	大丰转债	9,891.00	0.10
121	113548	石英转债	9,771.60	0.10
122	113557	森特转债	9,767.00	0.10
123	113564	天目转债	9,735.20	0.10

124	128072	翔鹭转债	9,670.00	0.10
125	128037	岩土转债	9,636.00	0.10
126	113575	东时转债	9,375.10	0.10
127	113525	台华转债	9,176.40	0.10
128	113577	春秋转债	9,166.40	0.10
129	123033	金力转债	9,110.40	0.09
130	113565	宏辉转债	9,078.40	0.09
131	128069	华森转债	8,955.90	0.09
132	113585	寿仙转债	8,635.90	0.09
133	128050	钧达转债	8,599.50	0.09
134	123010	博世转债	8,262.40	0.09
135	128066	亚泰转债	8,225.60	0.09
136	128042	凯中转债	8,140.80	0.08
137	128040	华通转债	8,105.30	0.08
138	113524	奇精转债	7,984.80	0.08
139	113532	海环转债	7,910.40	0.08
140	113556	至纯转债	7,484.50	0.08
141	113569	科达转债	7,368.80	0.08
142	113030	东风转债	7,346.50	0.08
143	113578	全筑转债	7,230.30	0.08
144	113509	新泉转债	7,114.20	0.07
145	123045	雷迪转债	7,042.80	0.07
146	113568	新春转债	6,985.30	0.07
147	123051	今天转债	6,946.20	0.07
148	128094	星帅转债	6,660.00	0.07
149	113580	康隆转债	6,420.30	0.07
150	123039	开润转债	6,389.40	0.07
151	128082	华锋转债	6,267.60	0.07
152	113570	百达转债	6,218.40	0.06
153	123011	德尔转债	5,917.80	0.06
154	128070	智能转债	5,859.00	0.06
155	123002	国祯转债	5,669.00	0.06
156	123047	久吾转债	5,622.00	0.06

157	128021	兄弟转债	5,619.50	0.06
158	128071	合兴转债	5,595.00	0.06
159	113541	荣晟转债	5,550.00	0.06
160	128056	今飞转债	5,373.50	0.06
161	123046	天铁转债	5,359.60	0.06
162	128101	联创转债	5,320.50	0.06
163	113576	起步转债	5,320.00	0.06
164	123043	正元转债	5,227.95	0.05
165	113546	迪贝转债	5,092.00	0.05
166	110058	永鼎转债	5,090.50	0.05
167	113574	华体转债	5,075.50	0.05
168	110070	凌钢转债	5,029.00	0.05
169	128025	特一转债	5,024.00	0.05
170	113573	纵横转债	4,986.50	0.05
171	113561	正裕转债	4,634.40	0.05
172	123054	思特转债	4,059.20	0.04
173	123052	飞鹿转债	3,671.10	0.04
174	123038	联得转债	3,659.70	0.04
175	128079	英联转债	3,648.30	0.04
176	113536	三星转债	3,503.70	0.04
177	113572	三祥转债	3,437.40	0.04
178	123027	蓝晓转债	3,225.80	0.03
179	123030	九洲转债	2,926.80	0.03
180	123012	万顺转债	2,450.40	0.03
181	128103	同德转债	1,573.50	0.02

5.10.5 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。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	10,082,230.17
报告期期间基金总申购份额	53,445.89
减：报告期期间基金总赎回份额	1,323,501.20
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	8,812,174.86

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20201001-20201115	2,651,996.00	0.00	2,651,996.00	0.00	0.00%
	2	20201126-20201231	0.00	2,651,996.00	0.00	2,651,996.00	30.09%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》；
- 5、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、报告期内东吴中证可转换债券指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2021 年 1 月 22 日