

东吴基金管理有限公司

关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 基金份额持有人大会的第二次提示性公告

东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2020年6月10日在中国证监会指定媒介及基金管理人官网（www.scfund.com.cn）发布了《东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，于2020年6月11日发布了《东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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“《基金合同》”）的有关规定，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的基金管理人东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议召开的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自2020年6月11日起，至2020年7月12日17:00止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）

3、会议计票日：2020年7月13日

4、会议表决票的寄达地点：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区银城路117号瑞明大厦9F

邮编：200120

联系人：贾云鹏

联系电话：021-50509888-8111

请在信封表面注明：“东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-821-0588 咨询。

二、会议审议事项

《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明请参见《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案的说明》（附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 6 月 10 日，即在 2020 年 6 月 10 日下午深圳证券交易所交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。

如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2020 年 6 月 11 日起，至 2020 年 7 月 12 日 17:00 以前（送达时间以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人办公地址，并在信封表面注明：“东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

联系人：贾云鹏

联系电话：021-50509888-8111

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票员在基金托管人（平安银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的

表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、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东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额不小于权益登记日各自基金总份额的 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）的，基金份额持有人大会为有效召开；

2、《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》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各自所持东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额表决权的 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）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，并自决议生效之日起五日内报中国证监会备案。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要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持有的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额不小于权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，基金管理人可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直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：东吴基金管理有限公司

联系人：贾云鹏

联系电话：021-50509888-8111

传真：021-50509884

网址：www.scfund.com.cn

邮编：200135

2、基金托管人：平安银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系方式：021-62154848

联系人：林奇

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-821-0588 咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本基金停牌时间为基金份额持有人大会计票日（2020 年 7 月 13 日）开市起开始停牌至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30 复牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

5、本公告的有关内容由东吴基金管理有限公司负责解释。

东吴基金管理有限公司

2020年6月12日

附件一：《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案的说明》

附件一：

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型 有关事项的议案

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议将东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型为东吴中证可转换债券指数证券投资基金，并相应修改《基金合同》。具体转型方案可参见附件四《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案的说明》。

为实施东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次转型的具体事宜，并根据《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案的说明》对《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》及相关法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

东吴基金管理有限公司

2020年6月12日

附件二：

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码(身份证件号/营业执照号)：			
基金份额持有人开放式基金账户号/证券账户号：			
受托人（代理人）姓名/名称：			
受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号)：			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章			
日期：____年__月__日			

说明：1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见；表决意见代表基金份额持有人持有的本基金全部基金份额的表决意见；2、“开放式基金账户号/证券账户号”，仅指持有本基金份额的开放式基金账户号/证券账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户号；其他情况可不必填写。“开放式基金账户号/证券账户号”、“持有份额类别”处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额；3、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。4、本表决票可从本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托_____先生 / 女士或_____单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年7月12日的以通讯方式召开的东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托人开放式基金账户号/证券账户号：

受托人（代理人）姓名或名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托日期：____年__月__日

附注：1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。2、“开放式基金账户号/证券账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当分别填写基金账户号/证券账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。3、受托人的表决意见代表委托人持有的本基金全部基金份额的表决意见。

附件四：

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案 的说明

一、重要提示

（一）根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议将东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型为东吴中证可转换债券指数证券投资基金，并对《基金合同》进行修订。

（二）《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》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各自所持东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过，故《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

（三）基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对本次东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

（一）更名

基金名称由“东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金”更名为“东吴中证可转换债券指数证券投资基金”（以下简称“本基金”）。同时，《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》将变更为《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》。

（二）取消分级运作机制

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型后终止分级运作，因而不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制，删去相关内容，包括基金份额的分级、可转债 A 份额与可转债 B 份额的上市交易、基金的份额配对转换、基金份额折算、可转债 A 份额与可转债 B

份额的终止运作等章节以及其他相关条款。

（三）取消上市交易

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金目前上市交易的份额为可转债 A 份额和可转债 B 份额。东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金终止分级运作之后，可转债 A 份额和可转债 B 份额全部转换为非上市的东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额，不再进行上市交易。

（四）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转出或者卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。在《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效之前，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的场内基金份额持有人需提交跨系统转托管或赎回申请进行份额的赎回。未提交跨系统转托管或者赎回申请的场内份额持有人所持有的基金份额仍然保留在投资者资金账户中。

选择期期间，东吴转债份额的申购赎回、转入转出业务，可转债 A 份额与可转债 B 份额的交易、配对转换业务照常办理，不受影响。基金份额持有人在东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金正式实施转型前，可选择卖出可转债 A 份额、可转债 B 份额或赎回、转出东吴转债份额，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额。在选择期期间，由于东吴转债份额需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免东吴中证可转换债券基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况作相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

（五）基金份额的转换

转型选择期届满后，基金管理人将确定份额转换基准日，并在该日将东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金各类基金份额转换成东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额。

本次基金份额的转换可为两个步骤：

1、将可转债 A 份额与可转债 B 份额转换成东吴转债份额的场内份额。

在份额转换基准日日终，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转换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转换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。对于持有份额数较少的可转债 A 份额与可转债 B 份额, 存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换计算公式:

可转债 A 份额 (或可转债 B 份额) 的转换比率=份额转换基准日可转债 A 份额 (或可转债 B 份额) 的基金份额净值/份额转换基准日东吴转债份额的基金份额净值

可转债 A 份额 (或可转债 B 份额) 基金份额持有人持有的转换后东吴转债份额的场内份额数=基金份额持有人持有的转换前可转债 A (或可转债 B) 的份额数*可转债 A 份额 (或可转债 B 份额) 的转换比率

可转债 A 份额、可转债 B 份额基金份额持有人持有的转型后东吴转债份额数量的具体计算和基金份额转换的具体安排详见基金管理人届时发布的公告。

2、将东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金份额转换成东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额, 东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额份额数=东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额份额数。

(六) 基金合同的生效

自份额转换基准日的次一工作日起,《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效, 东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金正式变更为东吴中证可转换债券指数证券投资基金。

上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

(七) 关于转型后场内基金份额后续安排

自《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效后三个月内, 持有东吴中证可转换债券指数证券投资基金场内份额的基金份额持有人, 可以进行场内赎回, 或进行场外开户和跨系统转托管从而将东吴中证可转换债券指数证券投资基金场内份额转换为东吴中证可转换债券指数证券投资基金场外份额。《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效三个月后, 关闭场内赎回、场内份额的跨系统转托管业务, 原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额, 将转登记至本基金管理人开立的中登场外基金账户上, 届时仍持有东吴中证可转换债券指数证券投资基金场内份额余额的投资者, 需根据基金管理人届时发布的相关公告, 对其持有的基金份额进行重新确认与登记, 此过程即为“确权”, 确权完成后, 基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及

其他交易。

(八) 修改基金的费用

- 1、将管理费的年费率由 0.70%调整为 0.40%。
- 2、将托管费的年费率由 0.20%调整为 0.10%。

(九) 授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型方案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排、可转债 A 和可转债 B 的终止上市、份额折算安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

(十) 本次基金合同具体修改内容请参见基金合同修改对照表

章节	修改前	修改后
	内容	内容
全文	东吴中证可转换债券指数 分级 证券投资基金	东吴中证可转换债券指数证券投资基金
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）、《公开募集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》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《公开募集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》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、东吴中证可转换债券指数证券投资基金由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金变更注册而来。</p> <p>中国证监会对东吴中证可转换债券指数分级</p>

	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。	<u>证券投资基金</u> 的 <u>变更</u> 注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。
	五、《基金合同》应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致《基金合同》的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。	<u>五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。</u>
第二部分 释义	1、基金或本基金：指 <u>东吴中证可转换债券指数分级</u> 证券投资基金	1、基金或本基金：指 <u>东吴中证可转换债券指数</u> 证券投资基金，由 <u>东吴中证可转换债券指数分级</u> 证券投资基金转型而来
	8、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》 9、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》	无
	11、《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	9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员第十四次会议《全国人民代表大会常务委员关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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
	14、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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	12、《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

	<p>17、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</p>	<p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业<u>保险</u>监督管理委员会</p>
	<p>18、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，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（简称“可转债A”）和进取收益类份额（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</p> <p>19、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</p> <p>20、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</p> <p>21、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</p>	<p>无</p>
	<p>25、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</p>	<p>19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者</p>
	<p>26、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</p>	<p>20、投资人/<u>投资者</u>：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</p>
	<p>28、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</p>	<p>22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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</p>
	<p>29、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</p>	<p>无</p>

	<p>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</p> <p>30、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</p> <p>31、直销机构：指东吴基金管理有限公司</p> <p>32、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协议，代为办理场外基金销售业务的机构</p> <p>33、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</p> <p>34、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</p>	
	<p>35、销售机构：指本基金的直销机构和代销机构</p>	<p>23、销售机构：指东吴基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构</p>
	<p>36、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</p>	<p>24、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</p>
	<p>37、注册登记机构：指办理注册登记的机构。基金的注册登记机构为中国证券登记</p>	<p>25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东吴基金管理有限公司或接</p>

<p>结算有限责任公司</p>	<p><u>受东吴基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构</u></p>
<p>38、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</p> <p>39、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</p>	<p>无</p>
<p>40、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</p>	<p><u>26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户</u></p>
<p>41、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</p>	<p>无</p>
<p>42、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</p>	<p><u>27、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办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户</u></p>
<p>43、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</p>	<p><u>28、基金合同生效日：指《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效日，原《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止</u></p>
<p>45、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</p>	<p>无</p>

	<p>52、《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</p>	<p>36、《业务规则》：指《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》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守</p>
	<p>53、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</p>	<p>无</p>
	<p>56、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</p> <p>57、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</p> <p>58、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</p> <p>59、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</p> <p>60、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</p>	<p>无</p>
	<p>62、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</p>	<p>40、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操作</p>
	<p>63、系统内转托管：指基金份额持有人将持</p>	<p>无</p>

	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 64、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	
	65、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	41、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受理基金申购申请的一种投资方式
	66、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%	42、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(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的 10%
		50、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
第三部分 基金的基本情况	一、基金名称 东吴中证可转换债券指数分级 证券投资基金	一、基金名称 东吴中证可转换债券指数 证券投资基金
	四、标的指数 中证可转换债券	四、标的指数 中证可转换债券 指数 如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布，或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基

		<u>金的标的指数。</u>
	<p><u>五、基金份额分级</u></p> <p>本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即可转债A份额和可转债B份额，两级份额的配比原则上不超过7:3。</p> <p>有关本基金基金份额分级的规定详见本基金合同第四部分。</p>	无
	<p><u>六、基金的投资目标</u></p> <p>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。</p>	<p><u>五、基金的投资目标</u></p> <p>本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。</p>
	<p><u>七、基金的最低募集份额总额</u></p> <p>本基金的最低募集份额总额为2亿份。</p> <p><u>七、基金份额面值 and 认购费用</u></p> <p>本基金份额发售面值为人民币1.00元。</p> <p>本基金认购费率最高不超过5%，具体费率按招募说明书的规定执行。</p>	无
	无	<p><u>七、基金份额的类别</u></p> <p>在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，经与基金托管人协商，在履行适当程序后为本基金增设新的份额类别、调整现有基金份额类别的费率水平、收费方式或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但须报中国证监会备案并提前公告。有关基金份额类别的具体规则等相关事项届时将另行公告。</p>
第四部分	整章删除	无

基金的分级		
<p>第四部分 基金的历史沿革</p>	无	<p>东吴中证可转换债券指数证券投资基金由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型而来。</p> <p>东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金经 2013 年 11 月 21 日中国证监会《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》（证监许可【2013】1471 号）核准，进行募集。募集结束后，基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 9 日生效。基金管理人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。</p> <p>基金管理人根据法律法规、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，对东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金进行变更注册。</p> <p>东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会于****年**月**日审议并通过《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，同意东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型为东吴中证可转换债券指数证券投资基金，基金名称相应变更为“东吴中证可转换债券指数证券投资基金”。自****年**月**日起，《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》生效，《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》自同一起失效。</p>
<p>第五部分 基金份额的</p>	整章删除	无

发售		
第六部分 基金备案	整章删除	无
第五部分 基金的存续	无	<u>《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</u>
第七部分 可转债 A 份 额与可转债 B 份额的上 市交易	整章删除	无
第六部分 基金份额的 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，并在管理人网站公示。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	一、申购和赎回场所 <u>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点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销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务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。</u>

	<p>赎回。</p>	
	<p>二、东吴转债份额申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>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。</p> <p>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介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，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。</p> <p>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介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人将自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购、赎回，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介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>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基金份额的申购、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、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。</p>
	<p>三、东吴转债份额申购与赎回的原则</p> <p>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；</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p>

	<p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>	<p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；</p> <p>4、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。</p>
	<p>四、东吴转债份额申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>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。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人在提交申购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基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p><u>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。</u>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。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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）及时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。</p> <p>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、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。<u>对于申请的确认情况，投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。</u></p> <p><u>在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。</u></p>
	<p>五、东吴转债份额申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>5、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介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>5、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等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>

	<p>六、东吴转债份额申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、东吴转债份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 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。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：东吴转债份额申购份额的计算详见招募说明书。东吴转债份额申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的东吴转债份额的基金份额净值，有效份额单位为份，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。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：东吴转债份额赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日东吴转债份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述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。</p> <p>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。不高于赎回费总额的 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，其中对持续持有期少于 7 日的投资</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、<u>本</u>基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 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。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：<u>本基金</u>申购份额的计算详见<u>《招募说明书》</u>。<u>本基金的</u>申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，<u>上述</u>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。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：<u>本基金</u>赎回金额的计算详见<u>《招募说明书》</u>。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述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。</p> <p>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，其中对持续持有期少于 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。</p>
--	---	--

	<p>者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</p> <p>6、东吴转债份额的申购费用最高不超过 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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介上公告。</p> <p>7、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。</p> <p>8、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。</p>	<p>6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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介上公告。</p> <p>7、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，<u>且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下</u>，根据市场情况制定基金促销计划。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。</p> <p>8、<u>当发生大额申购赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p><u>6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、</u></p>

	<p>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介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。</p>	<p><u>基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</u></p> <p><u>9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p>发生上述第 <u>1、2、3、5、6、7、10</u> 项暂停申购情形之一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介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。</p>
	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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；</p> <p>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。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时</u>，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。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。</p>
	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>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</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的 <u>基金</u> 份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中</p>

<p>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。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有</p>	<p>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的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当<u>本</u>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。</p> <p>(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的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。</p> <p>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。</p> <p>(3) <u>当基金发生巨额赎回且</u>单个开放日内单</p>
---	--

<p>人申请赎回的基金份额占前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。</p> <p>(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,并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>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,并在两日内在指定媒介上刊登公告。</p>	<p>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%,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。</p> <p>(4) 暂停赎回:连续 2 个开放日以上(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,并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时,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 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在两日内在指定媒介上刊登公告。</p>
<p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介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。</p> <p>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 日在指定媒介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。</p> <p>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,</p>	<p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p><u>2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法》的有关规定,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。</u></p>

	<p>基金管理人应提前 2 日在指定媒介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。</p>	
	<p>十二、基金的非交易过户</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>十二、基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指登记机构受理继承、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。</p> <p>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登记机构的规定办理，并按登记机构规定的标准收费。</p>
	<p>十三、基金的转托管</p> <p>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。</p> <p>2、系统内转托管</p> <p>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）</p>	<p>十三、基金的转托管</p> <p><u>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。</u></p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3、跨系统转托管</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
	<p>十五、基金的冻结和解冻</p> <p>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。</p>	<p>十五、<u>基金份额</u>的冻结和解冻</p> <p>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。</p>
	<p>无</p>	<p>十六、<u>基金份额的转让</u></p> <p><u>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人履行相关程序后，可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</u></p>
<p>第九部分</p>	<p>整章删除</p>	<p>无</p>

基金的份额 配对转换		
第七部分 基金合同当 事人及权利 义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：王炯</p> <p>注册资本：1 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(1) 依法募集基金；</p> <p>(5) 召集基金份额持有人大会；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。</p> <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(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</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F</p> <p>法定代表人：邓晖</p> <p>注册资本：1 亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(1) 依法募集资金；</p> <p>(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；</p> <p>(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；</p> <p>(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》规定的其他权利。</p> <p>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：</p> <p>(1) 依法募集资金，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申购、赎回和登记事宜；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、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净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p>

	<p>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；</p>	
	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号</p> <p>注册资本：5,123,350,416 元</p> <p>联系人：李玉彬</p> <p>联系电话：(0755)22168677</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。</p> <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(12) 从基金管理人处接收并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(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；</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>办公地址：<u>广东省深圳市福田区益田路 5023 号</u></p> <p>注册资本：<u>19,405,918,198 元</u></p> <p>联系人：<u>高希泉</u></p> <p>联系电话：<u>(0755) 2219 7701</u></p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为基金开设<u>资金账户、证券账户等投资所需账户</u>，为基金办理证券交易资金清算；</p> <p>(7) 法律法规<u>及中国证监会规定的</u>和《基金合同》<u>约定</u>的其他权利。</p> <p>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：</p> <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户、<u>证券账户等投资所需账户</u>，按照本<u>基金</u>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；</p> <p>(12) 从基金管理人<u>或其委托的登记机构</u>处接收并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(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<u>基金管理人</u>、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p>
	<p>三、基金份额持有人</p> <p>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</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对<u>《基金合同》</u>的承认和接受，基金投资</p>

	<p>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。</p> <p>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，一本基金每份基金份额具有同等的合法权益。</p> <p>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：</p> <p>（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>（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；</p> <p>（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。</p> <p>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：</p> <p>（1）认真阅读并遵守《基金合同》；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；</p>	<p>者自依据<u>《基金合同》</u>取得基金份额，即成为本基金份额持有人和<u>《基金合同》</u>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<u>《基金合同》</u>当事人并不以在<u>《基金合同》</u>上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>本基金每份基金份额具有同等的合法权益。</p> <p>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：</p> <p>（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；</p> <p>（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> <p>（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p> <p>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：</p> <p>（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；</p> <p>（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；</p> <p>（4）缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> <p>（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p>
第八部分 基金份额持	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	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

<p>有人大会</p>	<p>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。</p> <p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（10）终止可转债 A 份额与可转债 B 份额的运作；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（14）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协</p>	<p>表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p><u>本基金份额持有人大会不设日常机构。</u></p> <p>一、召开事由</p> <p>1、<u>除法律法规、中国证监会另有规定的以外</u>，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：</p> <p>（5）<u>调整</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p><u>（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；</u></p> <p>（12）对基金<u>合同</u>当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协</p>
-------------	---	---

	<p>商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 调低基金管理费、基金托管费；</p> <p>(3) 在<u>法律法规和《基金合同》规定的范围内</u>调整本基金的申购费率、调低赎回费率；</p> <p>(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；</p> <p>(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</p>	<p>商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 调低<u>除基金管理费、基金托管费以外其他应由基金承担的费用</u>；</p> <p>(3) 在<u>不违反法律法规及基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下</u>调整本基金的申购费率、调低赎回费率、<u>变更收费方式或调整基金份额类别</u>；</p> <p>(4) 在<u>不违反法律法规及基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下</u>，<u>基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则</u>；</p> <p>(5) 根据指数发布机构对指数使用许可协议的调整变更标的指数许可使用费收费标准、<u>计费方式和支付方式等</u>；</p> <p>(8) 在<u>不违反法律法规及基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下</u>，<u>基金管理人履行相关程序后，推出新业务或服务</u>；</p>
	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>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。</p> <p>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</p>	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>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，<u>并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合</u>。</p> <p>4、<u>代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会</u>，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</p>

<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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,代表基金份额总数10%以上(含10%)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日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。</p> <p>5、代表基金份额10%以上(含10%)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,单独或合计代表基金份额总数10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前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。</p>
<p>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</p>	<p>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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的</p>

	<p>召集人确定。</p> <p>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：</p> <p>（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）。</p> <p>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。</p> <p>（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%）；</p>	<p><u>其他</u>方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p> <p>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<u>基金</u>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：</p> <p>（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<u>二分之一（含二分之一）</u>。</p> <p><u>参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6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（含三分之一）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。</u></p> <p>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<u>或大会公告载明的其他方式</u>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<u>或大会公告载明的其他方式</u>进行表决。</p> <p>（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<u>二分之一（含二分之一）</u>；<u>若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的基金份额低于上述规定比例</u></p>
--	--	--

	<p>(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书证明符合法律法规、《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;</p> <p>(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。</p>	<p><u>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3个月以后、6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(含三分之一)基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;</u></p> <p>(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书证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。</p> <p><u>B、在不与法律法规冲突的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</u></p>
	<p>五、议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>(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。</p> <p>(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</p>	<p>五、议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>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。</p>

	<p>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。</p> <p>(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:</p> <p>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进行解释和说明。</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>2、议事程序</p> <p>(1)现场开会</p> <p>大会由召集人授权代表主持。基金管理人为</p>	<p>2、议事程序</p> <p>(1)现场开会</p> <p>大会主持人为基金管理人授权出席会议的代</p>
--	---	---

	<p>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。</p>	<p><u>表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；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，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生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。</u></p>
	<p>六、表决</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>六、表决</p> <p>基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。</p> <p>1、<u>一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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过。</u></p> <p>2、<u>特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）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《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</u></p>
	<p>八、生效与公告</p>	<p>八、生效与公告</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。</p>
	<p>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。</p>	<p>九、<u>本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如与将来颁布的涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p>
<p>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p>	<p>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</p> <p>(一) 基金管理人职责终止的情形</p> <p>4、法律法规和《基金合同》规定的其他情形。</p> <p>(二) 基金托管人职责终止的情形</p> <p>4、法律法规和《基金合同》规定的其他情形。</p>	<p>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</p> <p>(一) 基金管理人职责终止的情形</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p> <p>(二) 基金托管人职责终止的情形</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p>
	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有东吴转债份额、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%)基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需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)表决通过。新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条；</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、<u>决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)表决通过，并自表决通过之日起生效；</u></p>

<p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；</p> <p>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会备案生效后 2 日内在指定媒介公告。</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有东吴转债份额、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%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需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）表决通过。新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会备案生效后 2 日内在指定媒介公告；</p> <p>6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；</p>	<p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、<u>决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，自表决通过之日起生效；</u></p> <p>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；</p> <p>6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值；</p>
---	---

	<p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。</p> <p>1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有东吴转债份额、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%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；</p> <p>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会备案生效后2日内在指定媒介上联合公告。</p>	<p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；</p> <p>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定内在指定媒介上联合公告。</p>
	<p>(四) 新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。</p>	<p>三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第十一部分 基金份额的 登记</p>	<p>一、基金的注册登记业务</p> <p>本基金的注册登记业务指本指基金登记、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。</p>	<p>一、基金份额登记业务</p> <p>本基金的登记业务指本基金登记、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。</p>
	<p>二、基金注册登记业务办理机构</p> <p>本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额</p>	<p>二、基金登记业务办理机构</p> <p>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的</p>

	持有人的合法权益。	合法权益。
	<p>三、基金注册登记机构的权利</p> <p>基金注册登记机构享有以下权利：</p> <p>1、取得注册登记费；</p> <p>5、法律法规规定的其他权利。</p>	<p>三、基金登记机构的权利</p> <p>基金登记机构享有以下权利：</p> <p>1、取得登记费；</p> <p>5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p>
	<p>四、基金注册登记机构的义务</p> <p>基金注册登记机构承担以下义务：</p> <p>1、配备足够的专业人员办理本基金份额的注册登记业务；</p> <p>2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理本基金份额的注册登记业务；</p> <p>3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；</p> <p>4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外；</p> <p>5、按基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；</p> <p>7、法律法规规定的其他义务。</p>	<p>四、基金登记机构的义务</p> <p>基金登记机构承担以下义务：</p> <p>1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；</p> <p>2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；</p> <p>3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；</p> <p>4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；</p> <p>5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；</p> <p>7、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。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>一、投资目标</p> <p>本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制法的投资策略，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。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。</p>

	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>二、投资范围</p> <p><u>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券及其备选成份券、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债（含分离交易可转债）、地方政府债、政府机构债、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。</u></p> <p>本基金不直接从二级市场买入股票、权证等资产，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。</p> <p>本基金的投资组合比例为：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基金资产净值的90%；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。</p>
	<p>四、投资策略</p> <p>本基金为债券指数基金，对指数投资部分，</p>	<p>四、投资策略</p> <p>本基金为债券指数基金，对指数投资部分，</p>

	<p>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。</p> <p>在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.5%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。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>（二）指数投资策略</p> <p>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。</p>	<p>采用优化复制标的指数的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金将不低于基金资产净值的90%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。</p> <p>（二）指数投资策略</p> <p>对指数投资部分，采用优化复制标的指数法，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。</p> <p>（三）中小企业私募债券投资策略</p> <p>中小企业私募债券由于该券种的发行主体资质相对较弱，且存在信息透明度较低等问题，因而面临更大的信用风险，属于高风险高收益品种，未来有可能出现债券到期后企业不能按时清偿债务的情况，从而导致基金资产</p>
--	---	---

		<p><u>的损失。</u></p> <p><u>本基金将从发行主体所处行业的稳定性、未来成长性，以及企业经营、现金流状况、抵押质押及担保增信措施等方面优选信用资质相对较强的高收益债进行投资。严格执行分散化投资策略，分散行业、发行人和区域集中度，以避免行业或区域性事件对组合造成的集体冲击。</u></p> <p><u>(四) 资产支持证券投资策略</u></p> <p><u>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以获得长期稳定收益。</u></p>
	<p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p>	<p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 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基金资产<u>净值</u>的<u>90%</u>；</p> <p><u>(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</u></p> <p><u>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</u></p> <p><u>(5) 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%； 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</u></p>

<p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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。</p> <p>(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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>(6) 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%；</p> <p><u>(8) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</u></p> <p>(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>除上述第(2)、(7)、(10)、(11)项之外，因证券市场波动、<u>证券发行人</u>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，<u>但中国证监会规定的特殊情形除外。</u></p> <p><u>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基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管</u></p>
--	--

	<p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是<u>国务院证券监督管理机构</u>另有规定的除外；</p> <p>(7) <u>依照</u>法律法规有关规定，<u>由</u>中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p><u>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。</u></p>	<p><u>人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</u></p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是<u>中国证监会</u>另有规定的除外；</p> <p>(7) <u>法律、行政法规</u>有关规定<u>和</u>中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p><u>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</u></p> <p><u>法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需要经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。</u></p>
	<p>五、业绩比较基准</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p><u>本基金是债券型指数基金，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基金资产净值的 90%。同时，本基金将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。因此，中证可转换债券指数和银行税后活期存款利率分别</u></p>

	<p>随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金经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》的规定在指定媒介上刊登公告。</p>	<p><u>赋予95%和5%的权重符合本基金的投资特性。</u></p> <p>随着市场环境的变化，<u>如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布，或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，</u>本基金经理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时变更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》的规定在指定媒介上刊登公告。</p>
	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。</p> <p>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。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，<u>具有与标的指数相似的风险收益特征。</u></p>
	<p>七、本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。</p>	<p><u>七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法</u></p> <p><u>1、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；</u></p> <p><u>2、有利于基金资产的安全与增值；</u></p> <p><u>3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独</u></p>

		<u>立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益。</u>
第十三部分 基金的财产	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、 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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。	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、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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。
第十四部分 基金资产的估值	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	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 <u>或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的</u> ，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 <u>或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的</u> ，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； <u>(2) 对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；</u> (3) 交易所上市交易的 <u>可转换</u> 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

	<p>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；</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（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。</p> <p>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。</p>	<p>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；</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p><u>（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</u></p> <p><u>4、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。</u></p> <p><u>5、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。</u></p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
	<p>四、估值程序</p> <p>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。</p>	<p>四、估值程序</p> <p><u>基金管理人</u>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。</p>
		<p>。</p>
<p>无</p>		<p><u>八、特殊情况的处理</u></p> <p><u>1、基金管理人或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资产估值错误处理。</u></p> <p><u>2、由于不可抗力原因，或由于证券及登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，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，但未能发现错误</u></p>

		<p><u>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免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</u></p>
第十五部分 基金费用与 税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>4、基金上市费用；</p> <p>5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；</p> <p>6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费；</p> <p>8、基金的证券交易或结算而产生的费用；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p><u>4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；</u></p> <p>5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、<u>仲裁费</u>和诉讼费；</p> <p><u>7、基金的证券交易费用；</u></p> <p><u>9、基金相关账户的开户及维护费用；</u></p>
	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>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</p> <p>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</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，<u>由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后</u>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。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，</p>

	<p>产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>3、标的指数使用许可费</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>按月支付，<u>由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后</u>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。</p> <p>3、标的指数使用许可费</p> <p>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。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。</p> <p>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。</p> <p>基金管理人可根据指数许可协议规定的费率、收费方式的变更对上述<u>费率、</u>计提方式进行合理变更并公告<u>并在招募说明书及其定期的更新中更新。</u></p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—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。</p>
第十六部分 基金的收益 与分配	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>具体见基金管理人届时发布的相关公告。</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p><u>1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</u></p> <p><u>2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低</u></p>

		<p>于面值；</p> <p>3、<u>本基金每一基金份额享有同等分配权；</u></p> <p>4、<u>法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</u></p> <p><u>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。</u></p> <p><u>四、收益分配方案</u></p> <p><u>基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</u></p> <p><u>五、收益分配方案的确定、公告与实施</u></p> <p><u>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。</u></p> <p><u>基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。</u></p> <p><u>六、基金收益分配中发生的费用</u></p> <p><u>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</u></p>
<p>第二十部分 基金份额折算</p>	<p>整章删除</p>	
<p>第二十一部分 可转债</p>	<p>整章删除</p>	

A 份额与可 转债 B 份额 的终止运作		
第十七部分 基金的会计 与审计	<p>一、基金会计政策</p> <p>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；</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；</p>
第十八部分 基金的信息 披露	<p>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。</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>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。</p> <p>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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>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</p>	<p>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。<u>相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</u></p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、<u>《基金合同》</u>、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>1、<u>《基金合同》</u>是界定<u>《基金合同》</u>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事项的法律文件。</p> <p>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<u>申购</u>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。<u>《基金合同》</u>生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p>

<p>说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上； 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。</p> <p>（二）基金份额发售公告</p> <p>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介上。</p> <p>（三）《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件 的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效 公告。</p> <p>（四）基金份额上市交易公告书</p> <p>基金份额获准在证券交易所上市交易的，基 金管理人应当在基金份额上市交易的三个工 作日前，将基金份额上市交易公告书登载在 指定网站上，并将上市交易公告书提示性公 告登载在指定报刊上。</p> <p>（五）基金净值信息</p> <p>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在 指定网站披露一次东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额净值。</p> <p>2、在可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易 后，基金管理人应当不晚于每个开放日的次 日，通过指定网站、基金销售机构网站或者 营业网点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。</p> <p>3、在开始办理东吴转债份额申购或者赎回 后，基金管理人应当不晚于每个开放日的次 日，通过指定网站、基金销售机构网站或者 营业网点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。</p>	<p>（二）基金净值信息</p> <p><u>《基金合同》</u>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 在指定网站披露一次基金份额<u>净值和基金份 额累计</u>净值。</p> <p>在<u>开始办理基金份额申购或者赎回</u>后，基金 管理人应当不晚于每个开放日的次日，通过 指定网站、基金销售机构网站或者营业网点 披露<u>开放日</u>的基金份额净值和基金份额累计 净值。</p>
---	---

	<p>4、基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日东吴转债份额、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。</p>	<p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p>
	<p>(八) 临时报告</p> <p>2、基金合同终止、基金清算；</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p> <p>15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>17、东吴转债份额开始办理申购、赎回；</p> <p>20、本基金暂停接受东吴转债份额申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；</p> <p>21、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；</p> <p>22、本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；</p> <p>23、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；</p> <p>24、本基金实施基金份额折算；</p> <p>25、可转债 A 份额与可转债 B 份额终止运作；</p> <p>26、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；</p> <p>(八) 澄清公告</p> <p>在基金合同存续期限内，任何公共媒介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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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和基金上市交易的证券交易所。</p> <p>(九) 基金份额持有人大会决议</p>	<p>(五) 临时报告</p> <p>2、<u>《基金合同》</u>终止、基金清算；</p> <p>14、管理费、托管费、申购费、赎回费、<u>标的指数使用许可费</u>等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>16、<u>本基金</u>开始办理申购、赎回；</p> <p>19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；</p> <p><u>21、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p> <p>(六) 澄清公告</p> <p>在<u>《基金合同》</u>存续期限内，任何公共媒介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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。</p> <p>(七) 基金份额持有人大会决议</p>

	<p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p>	<p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p><u>(八) 投资资产支持证券的信息披露</u></p> <p><u>基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</u></p> <p><u>基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</u></p> <p><u>(九) 中小企业私募债券的投资情况</u></p> <p><u>基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后 2 个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</u></p>
	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息</p>	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p>

	<p>的内容应当一致。</p> <p>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。</p>	<p>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 10 年。</p>
	<p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所和基金上市交易的证券交易所网站，供社会公众查阅、复制。</p>	<p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。</p>
	<p>无</p>	<p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>1、不可抗力；</p> <p>2、发生暂停估值的情形；</p> <p>3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>
<p>第十九部分</p> <p>基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>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。</p> <p>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》的规定在指定媒介公告。</p>	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金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。</p> <p>2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，并自决议生效后依照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。</p>
	<p>三、基金财产的清算</p> <p>4、基金财产清算程序：</p> <p>（7）对基金财产进行分配；—</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月。</p>	<p>三、基金财产的清算</p> <p>4、基金财产清算程序：</p> <p>（7）对基金剩余财产进行分配。<u>—</u></p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但若遇基金持有的有价证券出现长期休市、停牌或其他流通受限的情形除外。</p>

<p>第二十部分 违约责任</p>	<p>一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失，一方承担连带责任后有权根据另一方过错程度向另一方追偿。</p>	<p>一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。<u>对损失的赔偿，仅限于直接损失。</u></p>
	<p>二、由于基金合同当事人违反基金合同，给其他基金合同当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。当发生下列情况时，当事人可以免责： (1)基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规、<u>市场交易规则</u>作为或不作为而造成的损失等； (2)在没有故意或过失的情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则<u>进行</u>的投资所造成的损失等；</p>	<p>二、由于基金合同当事人违反基金合同，给其他基金合同当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。当发生下列情况时，当事人可以免责： <u>1、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定</u>作为或不作为而造成的损失等； <u>2、基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则<u>行使或不行使其</u>投资权</u>所造成的损失等；</p>
	<p>三、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p>	<p>三、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，<u>《基金合同》</u>能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p>
	<p>四、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由</p>	<p>四、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除<u>或</u></p>

	此造成的影响。	减轻 由此造成的影响。
第二十一部分 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。	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 上海国际经济贸易仲裁委员会 仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的，对当事人均有约束力。 争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。
第二十二部分 基金合同的效力	基金合同 是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、 基金合同 经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。 2、 基金合同 的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。 3、 基金合同 自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的 基金合同 各方当事人具有同等的法律约束力。 4、 基金合同 正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。 5、 基金合同 可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。	《基金合同》 是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、 《基金合同》 经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章）。 2、 《基金合同》 的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。 3、 《基金合同》 自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的 《基金合同》 各方当事人具有同等的法律约束力。 4、 《基金合同》 正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。 5、 《基金合同》 可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。
第二十三部分 其他事项	基金合同 如有未尽事宜，由 基金合同 当事人各方按有关法律法规协商解决。	《基金合同》 如有未尽事宜，由 《基金合同》 当事人各方按有关法律法规协商解决。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基本情况

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金根据【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》（证监许可【2013】1471号）的核准，进行募集。基金合同于2014年5月9日生效，基金托管人为平安银行股份有限公司。

（二）东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型的可行性

1、法律可行性

根据《基金合同》约定，可以通过召开基金份额持有人大会的方式，变更基金名称、基金投资目标、终止基金分级运作（不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制）、取消上市交易等对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。按照《基金合同》的要求，本次基金份额持有人大会决议须以特别决议通过，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各自所持东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

因此，本基金《基金合同》的修改不存在法律方面的障碍。

2、技术运作可行性

基金管理人拥有多年投资、运营、风控经验，相关系统不存在技术操作上的障碍。

另外本次转型不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

四、本基金转型的主要风险及预备措施

（一）预防转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后对转型方案进行适当修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如转型方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交新的转型方案议案。

（二）预防基金转型后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通,避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

五、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议,欢迎及时反馈给本基金管理人。

联系人:东吴基金管理有限公司

联系电话:400-821-0588

传真:021-50509884

网站:www.scfund.com.cn

东吴基金管理有限公司

2020年6月12日