

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告

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”）的基金合同于 2014 年 5 月 9 日正式生效。

根据《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”）的相关规定，本基金通过场外、场内两种方式公开发售东吴转债份额。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：东吴转债，基金代码：165809）；场内认购的全部份额将按 7：3 的比例确认为东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之 A 份额（场内简称：可转债 A，基金代码：150164）与东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之 B 份额（场内简称：可转债 B，基金代码：150165）。本基金基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对东吴转债份额进行申购与赎回。可转债 A 份额、可转债 B 份额只上市交易，不接受申购与赎回。

为满足投资人的需求，东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自 2014 年 6 月 6 日起开通东吴转债、可转债 A、可转债 B 之间的份额配对转换业务。具体事项公告如下：

一、份额配对转换业务

1、份额配对转换：指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。

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

3、合并：指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 份额申请转换成 10 份东吴转债份额的场内份额的行为。

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

二、份额配对转换的业务办理机构

投资人可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务。

截至 2014 年 3 月 25 日，具有基金分拆转换及合并转换业务资格的深圳证券交易所会员单位包括：国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、西南证券、银河证券、中信证券（浙江）、湘财证券、民生证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、中信万通证券、东兴证券、东吴证券、信达证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、南京证券、上海证券、新时代、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、东海证券、中银国际证券、恒泰证券、国盛证券、华西证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、第一创业、金元证券、中航证券、华林证券、德邦证券、西部证券、广发华福证券、华龙证券、中金公司、财通证券、华鑫证券、瑞银证券、中投证券、中山证券、红塔证券、西藏同信证券、日信证券、联讯证券、江海证券、天源证券、银泰证券、国金证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、华融证券、财达证券、天风证券、中天证券、大通证券、华创证券、首创证券、国开证券。

中国证券登记结算有限责任公司将对具备基金分拆转换及合并转换业务资格的证券公司名单进行更新，投资者可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站（www.chinaclear.cn）查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

三、份额配对转换的业务办理时间

深圳证券交易所交易日上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00（基金管理人公告暂停份额配对转换业务时除外）。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告。

四、份额配对转换的原则

1、投资人通过业务办理机构提出份额配对转换申请的，以份额为单位进行“分拆”或“合并”申报。

2、申请进行“分拆”或“合并”的东吴转债份额的场内份额必须是 10 的整数倍。

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

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

5、 份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

五、份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。

投资者可以通过拨打本公司客服热线（400-821-0588）或登录本公司网站（www.scfund.com.cn）获取相关信息。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2014 年 6 月 3 日