

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债 A 份额和可转债 B 份额上市交易公告书

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

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点： 深圳证券交易所

上市时间： 2014 年 6 月 6 日

公告日期： 2014 年 6 月 3 日

目 录

一、重要声明与提示	1
二、基金概览	2
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	8
五、基金主要当事人简介.....	10
六、基金合同内容摘要.....	15
七、基金财务状况	35
八、基金投资组合	37
九、重大事件揭示	40
十、基金管理人承诺	41
十一、基金托管人承诺.....	42
十二、备查文件目录	43

一、重要声明与提示

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”）之可转债 A 份额和可转债 B 份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人东吴基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人平安银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2014 年 4 月 2 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及东吴基金管理有限公司网站（www.scfund.com.cn）上的《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金（场内简称：东吴转债）；基金代码：165809

优先收益类份额（场内简称：可转债A）基金代码：150164

进取收益类份额（场内简称：可转债B）基金代码：150165

2、基金类别：债券型。

3、基金运作方式：契约型开放式。

4、基金的分级：本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“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（基金简称“可转债A”）和进取收益类份额（基金简称“可转债B”）。可转债A份额及可转债B份额的基金份额配比始终保持7：3的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、基金发售：本基金通过场外、场内两种方式公开发售东吴转债份额。投资者场外认购所得的份额，不进行分拆。投资者场内认购所得的份额，将按7：3的基金份额配比自动分离为可转债A份额和可转债B份额。

基金合同生效后，东吴转债份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但不上市交易。在满足上市条件的情况下，可转债A份额和可转债B份额将申请上市交易，但是不开放申购和赎回等业务。

7、基金的申购与赎回：投资者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。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。

8、份额配对转换：东吴转债场内份额配对转换是指本基金的东吴转债场内的基础份额与分级份额可转债A、可转债B之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆是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。合并是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。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。份额配对转换业务将于 2014 年 6 月 6 日开始办理。

9、跨系统转托管：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。跨系统转托管业务将于 2014 年 6 月 6 日开始办理，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。

10、定期份额折算：在东吴转债份额、可转债 A 份额存续期内的每个会计年度 12 月的第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金的东吴转债份额、可转债 A 份额进行定期份额折算。对于可转债 A 份额期末的约定应得收益，即可转债 A 份额每个会计年度 11 月 30 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内东吴转债份额分配给可转债 A 份额持有人。东吴转债份额持有人持有的每 10 份东吴转债份额将按 7 份可转债 A 份额获得新增东吴转债份额的分配。持有场外东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外东吴转债份额的分配；持有场内东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内东吴转债份额的分配。经过上述份额折算，东吴转债份额和可转债 A 份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、不定期份额折算 当东吴转债份额的基金份额净值达到 1.400 元，或当可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元时，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金全部份额进行不定期份额折算。份额折算后本基金将确保可转债 A 份额和可转债 B 份额的比例为 7：3，份额折算后可转债 A 份额、可转债 B 份额和东吴转债份额的基金份额净值均调整为 1 元。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

12、基金份额总额：截至 2014 年 5 月 29 日，本基金的基金份额总额为 268,064,983.90 份，其中，东吴转债为 236,908,512.90 份，可转债 A 为 21,809,529 份，可转债 B 为 9,346,942 份。

13、基金份额净值：截至 2014 年 5 月 29 日，东吴转债的基金份额净值为 1.001 元，可转债 A 的基金份额净值为 1.003 元，可转债 B 的基金份额净值为 0.996 元。

14、本次上市交易的基金份额简称：可转债 A、可转债 B

15、本次上市交易的基金份额总额：可转债 A 为 21,809,529.00 份；可转债 B 为 9,346,942.00 份。

10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

11、上市交易日期：2014 年 6 月 6 日

12、基金管理人：东吴基金管理有限公司

13、基金托管人：平安银行股份有限公司

14、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一) 上市前基金募集情况

- 1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1471号
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同期限：不定期
- 4、本基金发售日期：2014年4月8日至2014年4月30日
- 5、发售价格：1.00元人民币
- 6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售
- 7、发售机构

(1) 本基金场外认购的销售机构：

本基金通过场外发售的销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构包括本公司上海直销中心以及本公司网上交易系统。代销机构包括平安银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中航证券股份有限公司、财富证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、光大证券有限责任公司、渤海有限责任公司、招商证券股份有限公司、齐鲁证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、平安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、厦门证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、五矿证券有限公司、天源证券经纪有限公司、财富里昂证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、万联证券、银河证券、华鑫证券有限责任公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司以及上海长量基金销售投资有限公司（以上排名不分先后）。

(2) 本基金场内认购的销售机构：

本基金通过场内发售的机构为爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、

财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

8、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额(不含利息)为人民币267,961,793.01元,确认份额（不含利息转份额）267,961,793.01份，利息结转份额103,190.89份，总确认份额为268,064,983.90份。

上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2014年5月7日全额划入本基金托管人平安银行股份有限公司开立的托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算本基金募集期间含本息共募集268,064,983.90份基金份额，其中场外认购的基金份额为236,908,512.90份；场内认购的基金份额为31,156,471.00份。

10、基金备案情况

本基金已于2014年5月9日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2014年5月9日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2014年5月9日

12、基金合同生效日的基金份额总额：268,064,983.90份

（二）东吴转债的日常申购、赎回情况

东吴转债份额将于2014年6月6日开放日常申购、赎回，具体业务办理规则请投资者参阅2014年6月3日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

(三) 可转债A与可转债B上市交易的主要内容

1、本基金的可转债A与可转债B上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2014】187号

2、上市交易日期：2014年6月6日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：可转债A、可转债B

5、交易代码：可转债A为150164、可转债B为150165

6、本次上市交易份额：可转债A为21,809,529份、可转债B为9,346,942份

7、基金资产净值的披露：用于基金信息披露的基金资产净值和东吴转债、可转债A与可转债B的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的东吴转债、可转债A与可转债B的基金份额净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。

8.未上市交易份额的流通规定：未上市交易的东吴转债份额托管在场外,基金份额持有人将其办理跨系统转托管至场内（证券登记结算系统）后，选择将东吴转债分拆为可转债A与可转债B后，方可上市流通。

(四) 份额配对转换业务安排

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,开通东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的份额配对转换业务,即东吴转债与可转债A、可转债B之间的配对转换,包括“分拆”和“合并”两个方面。“合并”或“分拆”每笔申请的份额数必须是10的整数倍,投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于10份。本公司可根据市场情况调整“合并”或“分拆”每笔申报份额的最低数量限制,并在调整生效前依照有关规定进行公告。

中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理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。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2014年5月29日，场内基金份额持有人户数350户，平均每户持有的场内基金份额89,018.49份。可转债A份额持有人户数为350户，平均每户持有的基金份额62,312.94份。可转债B份额持有人户数为350户，平均每户持有的基金份额26,705.55份。场外东吴转债基金份额持有人户数2216户，平均每户持有东吴转债基金份额106908.17份。

（二）持有人结构

截至2014年5月29日，本次上市交易的可转债A与可转债B基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的可转债A份额3,604,733份，占比16.53%；个人投资者持有的可转债A份额18,204,796份，占比83.47%。机构投资者持有的可转债B份额1,544,885.00份，占比16.53%；个人投资者持有的可转债B份额7,802,057.00份，占比83.47%。

（三）基金份额前十名持有人情况

本次上市交易的可转债A份额、可转债B份额前十名持有人情况

序号	持有人名称 (全称)	持有可转债 A 份额	占转债A 份额比 (%)	持有可转债 B 份额	占可转债 B 份额比 (%)
1	上海大润港务建设 集团有限公司	2,099,545.00	9.63%	899,804.00	9.63%
2	刘登峰	1,260,847.00	5.78%	540,363.00	5.78%
3	邵亚静	700,095.00	3.21%	300,041.00	3.21%
4	苏州君创投资有限 公司	700,095.00	3.21%	300,041.00	3.21%
5	周敏	700,081.00	3.21%	300,035.00	3.21%
6	苏州国际发展集团 有限公司	700,081.00	3.21%	300,035.00	3.21%

7	宁腊占	576,867.00	2.65%	247,229.00	2.65%
8	夏国芹	348,630.00	1.60%	149,413.00	1.60%
9	曾桂英	210,028.00	0.96%	90,012.00	0.96%
10	何水林	210,018.00	0.96%	90,008.00	0.96%
11	周民锋	210,018.00	0.96%	90,008.00	0.96%
合计		7,716,305.00	35.38%	3,306,989.00	35.38%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

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)

法定代表人：任少华

总经理：任少华

设立日期：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

工商登记注册的法人营业执照文号：310115000854513

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1 亿元人民币

联系人：吴靖

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	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	4900	49%
上海兰生（集团）有限公司	3000	30%
江阴澄星实业集团有限公司	2100	21%
合 计	10,000	100%

2. 简要情况介绍：

东吴基金管理有限公司设有投资管理部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、研究策划部、集中交易室、营销管理部、北京营销中心、上海营销中心、广州营销中心、苏州分公司、产品策略部、营销策划部、理财中心、总经理办公室、人力资源部、基金事务部、信息技术部、北京办事处、财务管理部和监察稽核部、风险管理部等 22 个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金，于

2005 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第二只产品东吴价值成长双动力股票型证券投资基金，于 2006 年 12 月 15 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动股票型证券投资基金，于 2008 年 4 月 23 日基金合同生效，托管行为华夏银行股份有限公司。公司已管理的第四只产品东吴优信稳健债券型证券投资基金，于 2008 年 11 月 5 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第五只产品东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金，于 2009 年 5 月 6 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第六只产品东吴新经济股票型证券投资基金，于 2009 年 12 月 30 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第七只产品东吴货币市场证券投资基金，于 2010 年 5 月 11 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第八只产品东吴新创业股票型证券投资基金，于 2010 年 6 月 29 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第九只产品东吴中证新兴产业指数证券投资基金，于 2011 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十只产品东吴增利债券型证券投资基金，于 2011 年 7 月 27 日基金合同生效，托管行为中信银行股份有限公司。公司已管理的第十一只产品东吴新产业精选股票型证券投资基金，于 2011 年 9 月 28 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十二只产品东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)，于 2012 年 3 月 9 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十三只产品东吴保本混合型证券投资基金，于 2012 年 8 月 13 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十四只产品东吴内需增长混合型证券投资基金，于 2013 年 1 月 30 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十五只产品东吴鼎利分级债券型证券投资基金，于 2013 年 4 月 25 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十六只产品东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金，于 2014 年 3 月 19 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十七只产品东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金，于 2014 年 5 月 9 日基金合同生效，托管行为平安银行股份有限公司。

3、人员情况

截至 2014 年 5 月 29 日，公司员工总数 107 人，其中：正式员工 107，外包员工 0

人。学历构成如下：博士 4 人占比 4%，硕士 59 人占比 55%，本科 37 人占比 35%，大专及以下 7 人占比 6%。

4、信息披露负责人及咨询电话

徐军 021—50509888

5、本基金基金经理

杨庆定，男，1972 年 10 月出生，2006 年 9 月毕业于上海交通大学，获管理学博士学位。自 2005 年 6 月起一直从事证券研究及投资工作。曾先后任职于大公国际资信评估有限责任公司上海分公司、上海证券有限公司、东吴基金管理有限公司、太平资产管理有限公司，2013 年 4 月再次加入东吴基金管理有限公司，担任公司固定收益部副总经理及东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

(二) 基金托管人

1、基本情况

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：孙建一

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：5,123,350,416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：李玉彬

联系电话：(0755) 2216 8677

平安银行股份有限公司（简称：平安银行，股票简称：平安银行，股票代码：000001）是原深圳发展银行股份有限公司以吸收合并原平安银行股份有限公司的方式完成两行整合并更名后的银行，是总部设在深圳的全国性股份制商业银行。中国平安保险（集团）

股份有限公司（以下简称“中国平安”）及其控股子公司持有平安银行股份共计约 26.84 亿股，占比约 52.38%，为平安银行的控股股东。

截至 2013 年底，平安银行资产总额 18,917.41 亿元，较年初增长 17.75%；存款总额 12,170.02 亿元，较年初增长 19.18%；贷款总额（含贴现）8,472.89 亿元，较年初增长 17.55%；在拨备大幅增长的情况下，实现归属母公司股东净利润 152.31 亿元，同比增长 13.64%。截至 2013 年底，按照中国银监会《商业银行资本管理办法（试行）》，平安银行资本充足率 9.90%、一级资本充足率 8.56%、核心一级资本充足率 8.56%；按照中国银监会《商业银行资本充足率管理办法》及相关规定计算，资本充足率 11.04%、核心资本充足率 9.41%。

截至 2013 年底，平安银行拥有分行 38 家，各类网点 528 家，基本形成对东北、华北、华东、华南、中部、西南和西北地区的全面覆盖；在香港设有代表处，并与境内外众多国家和地区逾 2000 家银行建立了代理行关系。

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 7 个处室，目前部门人员为 42 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)。

3、基金托管业务经营情况

2008 年 8 月 6 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。

(三) 基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层

办公地址：中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层

法定代表人：姚建华

经办注册会计师：王国蓓、陈启明

电话：+86(10)8508 5000

传真：+86(10)8518 5111

六、基金合同内容摘要

一、基金合同当事人的权利和义务

(一) 基金管理人的权利与义务

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：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (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；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (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；

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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：

(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；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(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资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(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托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 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。

(二) 基金托管人的权利与义务

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：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其

他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(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。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

-
- (12) 从基金管理人处接收并保存基金份额持有人名册；
 - (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
 - (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
 - (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；
 - (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
 - (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
 - (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
 - (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
 - (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
 - (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
 - (22) 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。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

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。

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，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

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：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

-
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
 - (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
 - (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
 - (7) 监督基金管理人的投资运作；
 - (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；
 - (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (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；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (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；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- (9) 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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。

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。

(一) 召开事由

-
- 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：
- (1) 终止《基金合同》；
 - (2) 更换基金管理人；
 - (3) 更换基金托管人；
 - (4) 转换基金运作方式；
 - (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；
 - (6) 变更基金类别；
 - (7) 本基金与其他基金的合并；
 - (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
 - (9) 变更基金份额持有人大会程序；
 - (10) 终止可转债 A 份额与可转债 B 份额的运作；
 - (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；
 - (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；
 - (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会；
 - (14) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
 - (15) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
 - (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
 - (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
 - (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(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；

(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

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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。

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。

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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（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召集人确定。

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：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(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）。

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。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(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%）；

(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；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（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。

（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。

（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：

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解释和说明。

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。

（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（以权益登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。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

（6）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，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。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

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。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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过。

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。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符

合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

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。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（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。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

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。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案生效后，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。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（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。

五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

（一）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。

（二）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。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(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%；

(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%；

(3) 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；

(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%；

(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%；

(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%；

(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%；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(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%；

(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%；

(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。

(12) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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。

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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序

后，则本基金投资不再受相关限制。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督

2、禁止行为

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：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。

2、基金资产净值、基金份额净值的公告方式

(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公告一次基金资产净值和东吴转债份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额净值。

(2) 在可转债 A 份额与可转债 B 份额上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，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。

(3) 在开始办理东吴转债份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，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。

(4) 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额的基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、东吴转债份额、可转债 A 份额与可转债 B 份额各自的基金资产净值、东吴转债份额的基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

一、《基金合同》的变更

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。

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》的规定在指定媒体公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 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。

基金合同受中国法律管辖。

(九) 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人销售机构的办公场所和营业场所查阅

七、基金财务状况

深圳证券交易所所在本基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金截至 2014 年 5 月 29 日资产负债表如下:

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年5月29日
资 产:	
银行存款	267719200.11
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	350043.00
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	350043.00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	541491.90
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	268610735.01
负债和所有者权益	
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	102894.20
应付托管费	29398.35

应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	29673.09
负债合计	161965.64
所有者权益：	-
实收基金	268,064,983.90
未分配利润	383785.47
所有者权益合计	268448769.37
负债和所有者权益总计	268610735.01

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2014 年 5 月 29 日，本基金的投资组合如下：

（一）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	固定收益投资	350043.00	0.13
	其中：债券	350043.00	0.13
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	267719200.11	99.67
6	其他各项资产	541491.90	0.20
7	合计	268610735.01	100

（二）按行业分类的股票投资组合

本基金未持有股票

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金未持有股票

（四）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）	占基金资产净值的比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	350043.00	0.13
8	其他	-	-
9	合计	350043.00	0.13

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	128003	华天转债	3,000	350043.00	0.13
2					
3					
4					
5					

(六) 按市值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金未持有资产支持证券

(七) 投资组合报告附注

1、报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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、 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期末，本基金未持有股票。

3、报告期末，其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	541491.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	541491.90

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	128003	华天转债	350043.00	0.13

5、报告期末，指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票。

6、报告期末，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。

九、重大事件揭示

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同已于 2014 年 5 月 9 日正式生效，基金管理人已于 2014 年 5 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同生效公告。

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。

（三）如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

- （一）中国证监会核准基金募集的文件
- （二）《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》
- （三）《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》
- （四）《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件。

东吴基金管理有限公司

2014年6月3号