

**东吴保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及
东吴配置优化混合型证券投资基金转型后
运作相关业务规则的公告**

东吴保本混合型证券投资基金（以下使用其全称或简称“本基金”、“东吴保本”）为契约型开放式证券投资基金，基金管理人为东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”），基金托管人为中国农业银行股份有限公司，基金注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金保证人为中国投融资担保有限公司（原“中国投资担保有限公司”，下同）。

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于核准东吴保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]506号），于2012年7月11日至2012年8月8日进行了募集。募集期间募集及利息结转的基金份额共计775,673,452.62份基金份额，有效认购户数为9,382户。本基金于2012年8月13日正式成立，简称为“东吴保本”，基金代码为“582003”。本基金保本周期期限三年，自本基金基金合同生效日（即2012年8月13日）起至三个公历年后对应日止，即2015年8月13日。

根据本基金基金合同的约定，“保本周期届满时，在符合本基金存续条件下，即本基金保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人和基金托管人认可的其他机构，为本基金下一保本周期提供保本保障，并且基金管理人与之签订

《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求，本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期的具体起止日期以本基金管理人届时公告为准。如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称相应变更为“东吴配置优化混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。。”

东吴保本混合型证券投资基金保本周期到期，因未能符合保本基金存续条件，将按照《基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金，即“东吴配置优化混合型证券投资基金”（以下使用其全称或简称“东吴配置优化”）。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码“582003”亦保持不变。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略及基金费率等按照《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

现将本基金保本周期到期安排及东吴配置优化混合型证券投资基金转型后运作的相关业务规则说明如下：

一、基金份额持有人保本周期到期后的选择

1、保本周期到期选择期的时间安排

本基金保本周期到期选择期（即“到期期间”）为保本周期到期日及其后三个工作日，即自2015年8月13日（含）起至2015年8月18日（含）止。基金份额持有人可在保本周期到期选择期内的交易时间里，通过基金管理人和各销售机构进行到期选择。

2、保本周期到期选择期内基金份额持有人的选择方式

在上述保本周期到期选择期内，本基金的基金份额持有人有以下三种选择方式：

- （1）赎回基金份额；
- （2）将基金份额转换为基金管理人管理的其他基金；
- （3）基金份额持有人继续持有转型后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”的基金份额。

3、保本周期到期选择期内的相关费用安排

（1）基金份额持有人选择赎回基金份额的，无需就其认购并持有到期的基金份额在到期期间的赎回支付赎回费用。

（2）基金份额持有人选择将基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的，无需就其认购并持有到期的基金份额在到期期间的转换支付赎回费用，但需根据其所转入基金的费率体系支付申购补差费。

（3）基金份额持有人选择继续持有转型后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”基金份额的，无需就此支付任何交易费用，其持有期将从原份额取得之日起连续计算。

（4）保本周期到期选择期（除保本周期到期日）内，本基金免收管理费、托管费。

4、保本周期到期选择期内相关业务操作

(1) 基金赎回或转换出采取“未知价”原则，即赎回价格或转换出的价格以申请当日收市后本基金基金份额净值计算。

(2) 在到期期间，如基金份额持有人没有作出到期选择，则基金管理人将默认基金份额持有人选择继续持有转型后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”的基金份额。基金管理人默认基金份额持有人进行到期操作的日期为到期期间的最后一个工作日

(3) 在到期期间，本基金接受赎回、转换出申请，不接受申购和转换转入申请。

(4) 到期期间，除暂时无法变现的基金财产外，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

(5) 本基金赎回业务办理地点

投资者可以通过本公司直销中心及网上直销交易平台、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公

司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、中航证券有限公司、安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、平安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、九州证券有限公司、长城国瑞证券有限公司、国金证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、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、广州证券股份有限公司、五矿证券有限公司、上海华信证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司,办理本基金的赎回业务。如上述业务办理机构发生变动,本公司将按照规定在指定媒体上另行公告。

(6) 本基金转换出业务办理地点

投资者可以通过本公司直销中心及网上直销交易平台、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限

公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、中航证券有限公司、安信证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、齐鲁证券有限公司、平安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、九州证券有限公司、长江证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、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、上海华信证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司办理转换

出业务。如上述业务办理机构发生变动，本公司将按照规定在指定媒体上另行公告。

一般而言，上述销售机构中未销售本公司旗下所有基金的，则只办理该机构所销售的本公司旗下基金之间已开通的转换业务。此外，本公司网上直销交易平台仅办理部分已开通的基金转换业务，具体情况请参见本基金管理人网站或相关公告。

(7) 本基金转换出业务适用的基金范围

本基金可转换旗下基金范围参见本基金管理人网站相关业务规则及各基金相关公告。如果未来开通本基金与本基金管理人旗下其他基金之间的转换业务，基金管理人将及时公告。

(8) 基金份额持有人选择将所持有本基金转换为基金管理人管理的其他基金的，转入基金份额持有期自基金转换申请确认日起重新计算。

二、东吴保本混合型证券投资基金保本赔付事宜

1、认购并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金或继续持有转型后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”的基金份额，均适用下述条款规定。

2、本基金为基金份额持有人持有到期的基金份额提供的保本金额为：本基金募集期内认购本基金的投资者认购并持有到期的基金份额的认购金额（即认购保本金额，包括该等基金份额的净认购金额、认购费用以及募集期间的认购利息），按照基金合同其他约定未获得

可享受保本条款确认的基金份额除外。如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于其认购并持有到期的基金份额的保本金额，差额部分即为“保本差额”，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

3、保本差额的具体赔付方式：

根据基金合同的相关约定，本基金保本周期到期日发生需保本赔付情形的，按如下方式操作：

1) 在发生保本赔付的情况下，基金管理人应按基金合同的约定在保本周期到期日后 4 个工作日内将保本差额支付至本基金在基金托管人处开立的账户；基金管理人无法全额履行保本义务的，基金管理人在保本周期到期日后 5 个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的 5 个工作日内，将需清偿的款项划入本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人支付给基金份额持有人。

2) 担保人将上述清偿款项全额划入本基金在基金托管人处开立的账户中后即全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。清偿款项的分配与支付由基金管理人负责。资金到账后，基金管理人应按照基金合同的约定进行分配和支付。

基金管理人最迟应在保本周期到期日后 20 个工作日（含第 20 个工作日）内将保本差额支付给基金份额持有人。

3) 若持有到期的基金份额持有人选择在持有到期后继续持有变

更后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”的基金份额，基金管理人将基金份额持有人选择继续持有变更后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”的基金份额在该基金基金合同生效日前一日所对应的基金资产净值作为转入该基金的转入金额，并由基金管理人在保本周期到期日后的 20 个工作日内将保本差额现金支付给投资人。

4)本基金第一个保本周期由中国投融资担保有限公司作为担保人，为基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任保证。

5)保本周期到期日后(不含保本周期到期日)至其实际操作日(含该日)的净值下跌风险由基金份额持有人自行承担。

三、东吴配置优化混合型证券投资基金的转型后运作

1、在本基金保本周期到期选择期截止日的次日，即 2015 年 8 月 19 日起“东吴保本混合型证券投资基金”转型为“东吴配置优化混合型证券投资基金”。东吴配置优化基金合同及托管协议即日生效。

2. 对于投资者在本基金募集期内认购的基金份额、保本周期内申购或转换入的基金份额，选择或默认选择转为转型后的东吴配置优化混合型证券投资基金的基金份额的，转入金额等于选择或默认选择转为东吴配置优化混合型证券投资基金的基金份额在《东吴配置优化混合型证券投资基金合同》生效日前一工作日所对应的基金资产净值。

3、东吴配置优化的申购、赎回业务自本基金保本周期到期选择期截止日次日起不超过 3 个月的时间内开始办理。本公司应在开始办

理申购、赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。投资者提交的东吴配置优化相关交易申请，适用东吴配置优化的费率体系。

4、基金份额持有人选择继续持有变更后的“东吴配置优化混合型证券投资基金”的基金份额的，对应基金份额的持有期将自基金份额持有人认购东吴保本的基金份额注册登记日起连续计算。但基金份额持有人后续选择按照相关基金合同的约定，在其所持有的东吴配置优化及本公司旗下其他基金间办理转换业务的，转入基金份额持有期自基金转换申请确认日起重新计算。

5、基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管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。

6、东吴配置优化的投资目标、投资范围、投资策略、基金费率、业务开通情况、销售机构及其他具体操作事宜按照该基金基金合同及招募说明书等相关规定进行运作，详见刊登在 2015 年 8 月 10 日《中国证券报》和《证券时报》以及公司网站上的《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同摘要》及《东吴配置优化混合型证券投资基金招募说明书》。《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》及《东吴配置优化混合型证券投资基金托管协议》也同时登载于本公司网站。

本公告的最终解释权归本公司所有。投资者欲了解详情，请登录

本公司网站（www.scfund.com.cn）查阅相关公告或拨打本公司客户服务电话（400-821-0588、021-50509666）咨询相关事宜。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

二〇一五年八月十日