东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书

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
二零一四年四月

【重要提示】

本基金根据【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》(证监基金字【2013】1471号)注册募集。

基金管理人保证《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”)的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。从整体运作来看,基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。从两类分额看,可转债A分额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率(税后)+3.00%,表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。可转债B分额获得剩余收益,带有适当的杠杆效应,表现出预期风险较高,预期收益相对较高的特点。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守,诚实信用,谨慎勤勉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,投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

一、绪言

本《招募说明书》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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、其他有关规定及《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“本基金合同”或“基金合同”)编写。

本《招募说明书》阐述了东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人对未在本《招募说明书》中载明的信息,或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1.基金或本基金:指东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金
2.基金管理人:指东吴基金管理有限公司
3.基金托管人:指平安银行股份有限公司
4.基金合同或本基金合同:指《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5.托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6.招募说明书:指《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7.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》
8.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份额上市交易公告书》
9.法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
10.《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会第三十次会议修订、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
11.《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12.《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13.《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
14.中国证监会:指中国证券监督管理委员会
15.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
16.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,基金简称“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与可转债B的基金份额配比始终保持7∶3的比例不变
17.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
18.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
19.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
20.基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
21.个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
22.机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
23.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
24.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
25.基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
26.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
27.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
28.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
29.直销机构:指东吴基金管理有限公司
30.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代理协议,代为办理场外基金销售业务的机构
31.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
32.代销机构:指除场外代销机构和场内代销机构的合称
33.销售机构:指本基金的直销机构和代销机构
34.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
35.注册登记机构:指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
36.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
37.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
38.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
39.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票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
40.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
41.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
42.基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
43.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
44.存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
45.工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
46.工日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
47.T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
48.开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
49.开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
50.《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》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
51.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
52.申购:指基金合同生效后,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
53.赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
54.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换A份额、可转换B份额的行为
55.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换A份额、可转换B份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面
56.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
57.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
58.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
59.基金转换:指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
60.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
61.系统内转托管: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
62.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
63.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
64.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%
65.元:指人民币元
66.基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
67.基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
68.基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
69.基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
70.基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
71.指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
72.不可抗力:指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

一、基金管理人概况
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
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
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%
江阴盛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、风险管理部等职能部门。公司已管理的第一只产品东吴基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。

二、主要人员情况
1.董事会成员
吴永敏先生,董事长,硕士研究生,高级审计师、高级经济师,中共党员。历任苏州市财政局科员、苏州市税务局副科长、苏州市税务局三分局副长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长、东吴证券股份有限公司董事长、党委书记,现任东吴基金管理有限公司董事长。
金燕萍女士,副董事长,大学,高级政工师,中共党员。历任上海外贸总公司党委委员、党委办公室副主任,上海海外公司党总支书记,上海广告公司党委副书记、副总经理,上海实业(集团)有限公司办事处常务副主任、党总支书记、上海兰生(集团)有限公司总裁助理、投资管理部总经理。现任上海兰生(集团)有限公司顾问。
任少华先生,董事,博士研究生,经济师,中共党员。历任苏州市人民检察院助理检查员,苏州中辰期货公司总经理助理,苏州证券投资部总经理、总经理,东吴证券股份有限公司董事、副总经济师、东吴证券股份有限公司资产管理总部总经理、总经济师、总裁助理兼任期货券商组长、研究所所长,东吴证券股份有限公司党委委员、副总裁,东吴期货有限公司董事长。现任东吴基金管理有限公司总经理。
吴亮先生,董事,硕士,经济师,中共党员。历任农行无锡分行国际业务部综合部副经理、农行无锡锡山支行国际业务部经理、农行无锡分行国际业务部副总经理,农行江阴市支行副行长,现任江阴港星实业集团有限公司副总裁。
王金来先生,董事,大学,经济师,中共党员。历任苏州市二轻局秘书、苏州市经济体制改革委员会副科长、处长、助理调研员,兼苏州市证券期货监督管理办公室证券处处长和苏州市企业上市工作办公室证券处处长,东吴证券股份有限公司投行总部副总经理,东吴证券股份有限公司董事长助理兼行政总监。现任东吴证券股份有限公司顾问。
戴晓雄先生,董事,硕士,历任上海复星高科技(集团)有限公司财务、审计副总监、上海兰生(集团)有限公司财务副总监、财务金融部总经理。现任上海五金矿产发展有限公司副总经理。
贝政新先生,独立董事,大学,教授,博士生导师。历任中国社科院经济研究所研究员、所长助理,现任中国社科院经济研究所副所长。
张平先生,独立董事,教授,博士生导师。历任中国社科院经济研究所研究员、所长助理,现任中国社科院经济研究所副所长。
陈如奇先生,独立董事,大专学历,中共党员,高级经济师。历任新疆人民银行巴州中心支行科员,新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长,交通银行上海分行处长、副行长,交通银行广州分行行长,交通银行香港分行总经理等职。
2.监事会成员
沈国强先生,监事长,大专,经济师。历任人民银行盐城分行、苏州分行科员、副科长、副主任科员、苏州证券业务部、经济管理部、研究发展中心、投行总经理,苏州证券经纪总监兼经纪管理部、研究发展中心总经理,苏州证券总裁助理兼市场发展部总经理,苏州证券公司、苏州证券有限责任公司董事长、东吴证券监事会主席兼总裁助理、稽核部负责人,东吴证券监事会主席、稽核部负责人。
周忠明先生,监事,硕士研究生,会计师,中共党员。曾任江苏澄星磷化工股份有限公司副总经理兼财务总监、董事长,现任江阴海星航实业集团有限公司副总裁。
黎瑛女士,员工监事,硕士研究生,经济师,中共党员。曾就职于上海证券综合研究有限公司、长城证券有限责任公司,现任东吴基金管理有限公司研究总监兼研究策划部总经理。
3.高管人员
吴永敏先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)
任少华先生,总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)
王炯先生,常务副总经理,硕士研究生,经济师,中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员、苏州证券西北街营业部负责人、东吴证券办公室副主任、总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理等职务,现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。
徐军女士,督察长,大学,会计师、审计师,中共党员。历任苏州市审计局财政、金融审计处科员、副处长,东吴证券财务部总经理,东吴基金管理有限公司财务负责人、公司总裁助理等职务,现任东吴基金管理有限公司督察长。
4. 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、太平洋产寿险有限公司,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。
5.投资决策委员会成员
任少华 公司总经理;
程 涛 公司总经理助理兼首席投资官;
黎 瑛 公司研究总监兼研究策划部总经理;
凌 鹏 公司研究副总监;
丁 鹏 固定收益部总经理;
杨庆定 固定收益部副总经理;
刘元海 投资管理部副总经理。
上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责
1.依法募集基金,办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜;
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、勤勉尽责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财产分别管理,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,除《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;
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,并且保证投资人有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信息披露文件,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。

四、基金托管人
一、基金托管人情况
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%;在扣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,现有员工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,具备《中国证券业执业证书》。长期从事银行工作,具有较为市资金实践经验,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,主持全面工作;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,主持全面工作;2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长,主持全面工作;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,主持全面工作;自2008年2月加盟平安银行并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,尤其是对银行有关各项监管政策比较熟悉。2011年1月至今平安银行资产托管事业部副总经理;2013年5月起主持平安银行资产托管事业部工作(持中国证券监督管理委员会核准)。
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。

二、基金托管人的内部风险控制制度说明
1、内部控制目标
作为基金托管人,平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求,自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格;确保基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益;确保内部控制和风险管理体系的有效性;防范和化解经营风险,确保业务的安全、稳健运行,促进经营目标的实现。
2、内部控制组织结构
平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部,是全行资产托管业务的管理和运营部门,专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理工作,具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。
3、内部控制制度及措施
资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员全部具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。
三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
1、监督方法
依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。
2、监督流程
(1)每工作日按时通过监控子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,金额超限的,并及时报告中国证监会。
(2)收到基金管理人的投资指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。
(3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。
(4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

五、相关服务机构

一、基金份额发售机构
1.直销机构:
东吴基金管理有限公司直销中心
注册地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
办公地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
法定代表人:任少华
联系人:吴靖
直销电话:(021)50509880
传真:(021)50509884
客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)、(021)50509666
网站:www.scfund.com.cn
2.场外代销机构:
(1)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系人:张莉
电话:021-38637673
客服电话:40066-99999(免长途费)0755-961202
公司网址:www.pingan.com
(2)其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。
3.场内代销机构
(1)东吴转债份额的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体发售机构见本基金份额发售公告。
(2)东吴转债份额募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为东吴转债份额的场内发售机构,并及时公告。

二、注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-59378839
传真:010-59378907
联系人:朱立元

三、律师事务所和经办律师
名称:北京市君泽君律师事务所
住所:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层
办公地址:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层
负责人:王冰
电话:010-66523388
传真:010-66523399
经办律师:余红征、林袁真

四、会计师事务所和经办注册会计师
名称:江苏天衡会计师事务所有限公司
注册地址:南京市正洪街18号东宇大厦8楼
办公地址:南京市正洪街18号东宇大厦8楼
法定代表人:余瑞玉
经办注册会计师:谈建忠 魏顺
电话:025-84711188
传真:025-84716883

六、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。

二、基金基本运作概要
1、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。投资者场内认购所得的东吴转债份额自动分离,由基金管理人委托注册登记机构进行,无需基金份额持有人申请。可转债A份额、可转债B份额与东吴转债份额的交易、申购、赎回等业务,并按规定执行。
2、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。
3、基金合同生效后,基金管理人申请将可转债A份额和可转债B份额上市交易,办理东吴转债份额与可转债A份额和可转债B份额之间的份额配对转换业务。
4、投资者可在场内申购和赎回东吴转债份额,也可选择将其持有的东吴转债份额场内份额按7∶3的比例分拆成可转债A份额和可转债B份额后进行二级市场交易。
5、投资者可在二级市场买入或卖出可转债A份额和可转债B份额,也可以将其持有的上述两类份额按照7∶3的配比合并为东吴转债份额后进行赎回。
6、投资者可在场外申购和赎回东吴转债份额。场外认购和申购的东吴转债份额不进行份额配对转换,但基金合同另有规定的除外。场外的东吴转债份额可以通过跨系统转托管至场内后,可按照场内的东吴转债份额配对转换规则进行操作。

(下转A19版)

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金份额发售公告

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
二零一四年四月

重要提示

1.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”)的募集已获中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1471号文注册。
2.本基金是债券型证券投资基金,运作方式为契约型开放式。
3.本基金的管理人为东吴基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”),注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。
4.东吴转债基金份额通过场内、场外发售机构进行公开发售。场外发售机构为基金管理人的直销网点和场外代销机构的代销网点;场内发售机构为通过深证证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售。
5.本基金自2014年4月8日起至2014年4月25日止公开发售。
6.本基金募集对象为中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者及中国证监会批准的合格境外机构投资者(法律、法规和有关规定禁止购买者除外)。个人投资者指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人。机构投资者指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构。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办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者。
7.若投资者欲通过场外认购本基金,需开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。若已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的,则不需要再次办理开户手续。若投资者欲通过场内认购本基金,需具有深圳证券账户,其中,深圳证券账户是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立的深圳证券交易所人民币普通股票账户(以下简称“深圳A股账户”)或证券投资基金账户。除法律法规另有规定,一个投资者只能开设和使用一个基金账户;不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。
8.本基金场外认购采用金额认购的方式。在本基金代销机构的代销网点及网上直销交易系统进行场外认购时,投资者以金额申请,每个基金账户首笔认购的最低金额为人民币1,000元,每笔追加认购的最低金额为1,000元。直销机构或各代销机构对基低认购限额及交易级差有其他规定的,以其业务规定为准。本基金发售期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制。基金管理人可根据市场情况,调整本基金认购和追加认购的最低金额。
场内认购单笔最低认购份额为1,000份,超过50,000份的须为1,000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。如发生未日比例确认,认购申请确认不受最低认购数量的限制。
9.基金发售机构对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表基金发售机构确定接受了该购申请。申请的成功确认以以基金合同生效后,注册登记机构或基金管理公司的确认登记为准。投资者可以在基金合同生效后第二天起到原认购机构查询。
10. 根据中国证监会的规定,一个投资人只能开设和使用一个基金账户;不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。
11.本公告仅对“东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金”募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解“东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金”的详细情况,请详细阅读2014年4月2日刊登在《中国证券报》、2014年4月2日的《上海证券报》、2014年4月2日的《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招募说明书》。?
12.本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站www.scfund.com.cn、平安银行网站www.bank.pingan.com、东吴证券股份有限公司网站www.dwzq.com.cn。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格,了解基金募集