东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金所持有的债券估值调整公告

为使本基金管理人旗下相关基金的估值公平、合理，根据中国证监会《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会发[2017]第13号）、东吴基金管理有限公司（以下简称"本公司"）的估值政策和程序等有关规定，经与相关托管银行协商一致，我司决定于2020年6月8日起对本公司旗下基金所持有"16 信威 01"（债券代码136192）、"16 信威 03"（债券代码 136610）进行估值调整。

特此公告。

东吴基金管理有限公司
2020年6月10日

东吴增利债券型证券投资基金继续暂停申购业务的提示性公告

公告送出日期：2020年6月10日

1 公告基本信息

基金名称	东吴增利债券型证券投资基金		
基金简称	东吴增利		
基金主代码	582002		
基金管理人名称	东吴基金管理有限公司		
公告依据	根据法律法规及《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》、《东吴增利债券型证券投资基金招募说明书》等相关规定。		
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2019年9月18日	
	暂停申购的原因说明	为保证东吴增利债券型证券投资基金的稳定运作，保护基金份额持有人利益，故继续暂停东吴增利债券型证券投资基金的申购业务	
下属基金的基金简称	东吴增利A	东吴增利C	
下属基金的交易代码	582002	582202	
该下属基金是否暂停申购	是	是	

2、其他需要提示的事项

1. 东吴基金管理有限公司（以下简称"本公司"）已于2019年9月17日发布《东吴增利债券型证券投资基金暂停申购（含定期定额）、转换转入业务的公告》，根据《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》规定："如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。"，故发布此提示性公告。

2. 在东吴增利债券型证券投资基金暂停申购业务期间，本公司将正常办理该基金的赎回业务。

3. 本公告仅对本公司管理的东吴增利债券型证券投资基金暂停申购业务有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，可通过本公司网站查阅本基金的相关法律文件。

4. 如恢复办理东吴增利债券型证券投资基金的申购业务，本公司将另行公告，敬请投资者注意。

5. 本公告涉及上述业务的最终解释权归本公司所有。

本公司承诺依照诚实信用、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。投资有风险，决策需谨慎。

如有疑问，请拨打本公司客户服务热线：400-821-0588，或登陆本公司网站www.scfund.com.cn获取相关信息。

特此公告。

东吴基金管理有限公司
二零二零年六月十日

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

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"。

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，或未能在规定时间之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、本基金首次停牌时间为本公告发布之日（2020年6月10日）开市起至当日10:30停牌。本基金第二次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10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10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，或未能在规定时间之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人，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	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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"《流动性风险规定》"）和其他有关法律法规。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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"《流动性风险规定》"）和其他有关法律法规。
	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。 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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	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。 中国证监会对东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的变更注册，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。	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。
第二部分 释义	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	1、基金或本基金：指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
	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	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会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，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会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈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
	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	15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
	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 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 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 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	无
	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	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
	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	20、投资人/投资者：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
	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	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
	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 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 31、直销机构：指东吴基金管理有限公司 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代理协议，代为办理场外基金销售业务的机构 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 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	无
	35、销售机构：指本基金的直销机构和代销机构	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
	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	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
	37、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	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受东吴基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
	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 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	无
	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	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
	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	无
	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	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
	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	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
	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	无
	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	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
	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	无
	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 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 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 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 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	无
	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	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
	63、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 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	无
	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金的标的指数。
	五、基金份额分级 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。 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。	无
	六、基金的投资目标 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。	五、基金的投资目标 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。
	七、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为2亿份。 七、基金份额面值和认购费用 本基金份额发售面值为人民币1.00元。 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。	无
	无	七、基金份额的类别 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。
第四部分基金的分级	整章删除	无
第四部分基金的历史沿革	无	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。 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。 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。 东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于****年**月**日审议并通过《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》，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》自同一日起失效。
第五部分基金份额的发售	整章删除	无
第六部分基金备案	整章删除	无
第五部分基金的存续	无	《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，基金管理人应当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。
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赎回。	一、申购和赎回场所 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。
	二、东吴转债份额申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 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。 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。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 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。 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。 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。	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 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。 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。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 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。 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。
	三、东吴转债份额申购与赎回的原则 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； 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； 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； 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。	三、申购与赎回的原则 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； 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； 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。
	四、东吴转债份额申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 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。 2、申购和赎回的款项支付 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。 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。 3、申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申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。 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。	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 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。 2、申购和赎回的款项支付 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。 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。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。 3、申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申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。 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。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。 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。
	五、东吴转债份额申购和赎回的数量限制 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。 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。 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。 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。	五、申购和赎回的数量限制 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。 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。 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。 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。
	六、东吴转债份额申购和赎回的价格、费用及其用途 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。 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。 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。 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。不低于赎回费总额的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日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。 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。 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人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。 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。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本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。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的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，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。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。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。 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。 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。 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，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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。 8、当发生大额申购或赎回情形时，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。
	七、拒绝或暂停申购的情形 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： 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。	七、拒绝或暂停申购的情形 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： 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、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 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。 发生上述第1、2、3、5、6、7、10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。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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登记系统无法正常运行； 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。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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，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。
	九、巨额赎回的情形及处理方式 1、巨额赎回的认定 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。 2、巨额赎回的处理方式 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。 （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。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。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。 （3）如发生单个开放日内单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（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。 （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。 3、巨额赎回的公告 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个交易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。	九、巨额赎回的情形及处理方式 1、巨额赎回的认定 若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（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）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。 2、巨额赎回的处理方式 当本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。 （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。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。 （3）当基金发生巨额赎回且单个开放日内单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。 （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。 3、巨额赎回的公告 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个交易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。
	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 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。 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。 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，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。	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 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。
	十二、基金的非交易过户 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。 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。	十二、基金的非交易过户 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。 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。
	十三、基金的转托管 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。 2、系统内转托管 系统内转托管是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。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。 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。 3、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。 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。	十三、基金的转托管 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。
	十五、基金的冻结和解冻 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。	十五、基金份额的冻结和解冻 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。
	无	十六、基金份额的转让 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。

（下转B078版）