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第二次提示性公告

东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2020年6月10日在中国证监会指定媒介及基金管理人官网（www.scfund.com.cn）发布了《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》，于2020年6月11日发布了《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第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布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第二次提示性公告。

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12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12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。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权益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。
	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	无
	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	
	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开放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开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分级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	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中转换成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份额进行配对中请转换成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

第三部分基金的基本情况	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%
	承担。	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
第四部分基金的分级	整章删除	无
第四部分基金的历史沿革	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