（上接B9版）

（3）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险控制委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

（4）监察稽核部：监察稽核部负责公司内控机制与制度的建立、监察、评估和建议。

（5）业务部门、风险管理是每一个业务部门最首要的责任，部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

4、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度；公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制；建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制；建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序；建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立有效的内部监控系统；建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段；采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训；制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

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%；在按备久福增长的情况下，实现归属母公司股东净利润182.31亿元，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。

平安银行总行设产代管事业部，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信贷产品开发与管理,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12月任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（待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01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,制券机制严格有效;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、投资指令等情况进行监督,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,与基金管理人进行确认核实,督促其纠正,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、林袁袁

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　魏娜

电话:025-84711188

传真:025-84716883

六、基金的分级

一、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资产合并投资运作。

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。

7、无论是按照份额折算,还是不定期份额折算(有关本基金的份额折算详见“第十七部分 基金份额折算”),其所产生的东吴转债份额不进行自动分离,投资者可选择将上述折算产生的东吴转债份额按7:3 的比例分拆为可转债A份额和可转债B份额。

三、东吴转债份额的份额折算规则

T 日东吴转债份额的基金份额净值=T 日闭市后的基金资产净值 / T日本基金基金份额的总数。

其中:

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

本基金T 日基金份额总数为东吴转债份额、可转债A份额和可转债B份额数量的总和。

四、可转债A份额和可转债B份额的净值计算规则

可转债A份额和可转债B份额具有不同的净值计算规则,即可转债A份额和可转债B份额的风险和收益特征不同。

在基金存续期内，基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对可转债A份额和可转债B份额分别进行基金份额净值计算。

基金净资产优先分配可转债A份额的本金及可转债A份额的约定收益,可转债A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额;本基金在优先分配可转债A份额的本金及可转债A份额的约定收益后的剩余净资产分配于可转债B份额，可转债B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

在基金存续期内,可转债A份额和可转债B份额的净值计算规则如下:

1、可转债A份额的约定年收益率为“一年期银行定期存款年利率(税后)+3.0%”,其计算可转债A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率(税后)是指基金合同生效日或生效后每个定期折算周前首日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期存款基准年利率,年基准收益以1.00 元为基准进行计算。

2、基金每个工作日对可转债A份额和可转债B份额进行净值计算。在进行可转债A份额和可转债B份额各自的净值计算时,基金净资产优先确保可转债A份额的本金及可转债A份额累计约定应得收益,之后的剩余净资产计为可转债B份额的净资产。可转债A份额累计约定应得收益,由可转债A份额约定每日收益率乘以截至计算日可转债A份额应计收益的天数进行单利计算确定;可转债A份额约定每日收益率=可转债A份额约定年收益率/当年天数.

3、每10 份东吴转债份额所代表的资产净值等于 份可转债A份额3 份可转债B份额的资产净值之和。

4、在本基金的基金合同生效日所在定期折算期间或存续的某一完整定期折算期间内,若未发生基金合同规定的不定期份额折算,则可转债A份额在净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日或自该定期折算期间首日至计算日的实际天数计算;若发生基金合同规定的不定期份额折算，则可转债A份额在净值计算日应计收益的天数应按照当前定期折算期间内最近一次不定期份额折算日次日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证可转债A份额的基金份额持有人的约定得收益,如在某一定期折算期间内本基金财产出现极端损失情况下,可转债A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定得收益甚至损失本金的风险。

五、可转债A份额和可转债B份额的净值计算

依据可转债A份额和可转债B份额的净值计算规则,按照下述的公式分别计算并公告T 日东吴转债份额、可转债A份额和可转债B份额的净值:

东吴转债份额、可转债A份额和可转债B份额的基金份额净值的计算,均保留到小数点后3 位,小数点后第4 位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1 日公告,如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

七、基金的募集

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1471号文备案。

二、基金类型和存续期间

1. 基金的类别:债券型证券投资基金。

2. 基金的运作方式:契约型开放式。

3. 基金存续期间:不定期。

三、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

四、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资人、机构投资人和合格境外机构投资人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。

五、募集规模

本基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

六、募集方式与场所

投资人可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。本基金发售结束后,投资人场外认购的全部份额将确认为东吴转债份额并登记在注册登记系统持有人基金账户下;投资人场内认购的全部份额将按7:3的比率确认为可转债A份额与可转债B份额并登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

场外将通过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)公开发售;场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销资格的会员单位发售(具体名单见基金份额发售公告)。本基金募集期间获得基金代销资格并具有深交所会员单位资格的证券公司经深交所确认后也可代理场内的基金份额发售,尚未取得基金代销业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市交易后,代理投资人通过深交所交易系统参与本基金的买卖。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准,对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

七、认购安排

1. 认购时间:2014年4月8日 至2014年4月25日,具体业务办理时间以各销售机构的规定为准。

八、基金份额的认购

1.基金份额的发售面值、认购价格、认购费用

（1）本基金份额的初始面值为人民币1.00元,挂牌价格为人民币1.00元。

（2）认购费用

本基金场外认购采取金额认购的方式,场内认购采取份额认购的方式,投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算,认购费率随认购金额的增加而递减,具体费率如下:

认购金额(M,含申购费)	认购费率
M<10万元	0.40%
10万元≤M<100万元	0.30%
100万元≤M<200万元	0.10%
M≥200万元	按笔收取,每笔1000元

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

（3）场外认购份额的计算

本基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为东吴转债份额。

基金的认购金额包括认购费用和净认购金额,认购份额的计算方法如下:

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用时:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率);

认购费用=认购金额-净认购金额;

认购份额=(净认购金额+认购期利息)/ 基金份额初始面值

场外认购份额的计算结果保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人投资100,300 元认购本基金,对应费率为0.3%,假设该笔认购产生利息45元,则认购份额数为:

净认购金额=100,300/(1+0.3%)=100,000.00元

认购费用=100,300-100,000.00=300.00元

认购份额=(100,000+45)/1.00=100,045.00份

即:投资人投资100,300元认购本基金份额,在基金合同生效时,投资人账户登记有本基金100,045.00份。

（4）场内认购金额和利息折算份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式,计算公式为:

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额=净认购金额+认购费用

利息折算的份额=利息/挂牌价格

场内认购份额的计算结果保留到整数位(最小单位为1份),小数点以后的部分舍去,余额计入基金财产。

例:某投资人投资认购100,000份基金份额,若会员单位设定的认购费率为0.3%,假设该笔认购产生利息45元,基金份额挂牌价格为1.00元,其认购份额数为:

净认购金额=1.00×100,000=100,000元

认购费用=1.00×100,000×0.3%= 300.00元

认购金额=1.00×(1+0.3%)×100,000=100,300元

利息折算的基金份额=45/1.00=45份

即:经确认的基金份额为100,045份,场内认购的全部份额将按7:3的比率确认为可转债A份额与可转债B份额。

2.投资者对基金份额的认购

（1）本基金的认购时间安排、认购者认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

（2）认购的方式及确认

1）投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

2）投资者在募集期内可以多次认购基金份额,但已申请的认购一旦被登记机构确认,就不再接受撤销申请。

3）投资者在T日规定时间内提交的认购申请,通常应在T+2日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

（3）认购的限额

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,投资者认购金额申请,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最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50,000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。

基金管理人可根据市场状况和投资者需求调整直销机构的最低认购标准,并及时公告。九、募集资金和息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。

十、募集期间的资金与费用

基金募集期间募集的资金存入专门帐户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

八、基金合同的生效

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,基金合同生效;否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足募集生效条件,基金管理人应当承担下列责任:

1.以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2.基金募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息。

3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬.基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三.基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后,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,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情况的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

九、可转债A份额与可转债B份额的上市交易

基金合同生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的可转债A份额与可转债B份额分别在深圳证券交易所上市交易。基金份额上市后,投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价方式买卖可转债A份额和可转债B份额。

一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

可转债A份额与可转债B份额上市后,登记在证券登记结算系统中的可转债A份额与可转债B份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的东吴转债份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并分拆成可转债A份额与可转债B份额后,方可上市交易。

二、上市交易的时间

可转债A份额与可转债B份额在基金合同生效后3个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人最迟在上市前3个工作日在指定媒体上刊登公告。

三、上市交易的规则

（1）可转债A份额与可转债B份额分别采用不同的交易代码上市交易;

（2）可转债A份额与可转债B份额分别设置涨跌幅限制;

（3）可转债A份额与可转债B份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

四、上市交易的费用

可转债A份额与可转债B份额上市交易的费用,按照深圳证券交易所上市开放式基金的有关规定办理。

五、上市交易的行情提示

可转债A份额与可转债B份额在深圳证券交易所挂牌交易、交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示可转债A份额与可转债B份额的一级市场净值。

六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

可转债A份额与可转债B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

七、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本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。

十、东吴转债份额的申购与赎回

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终止销售机构,并予以公告。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。

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、证券交易所或其他证券市场或其他特殊情况,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体上公告。

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。

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体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,其东吴转债份额的申购、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;

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整,基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

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

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

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。

五、东吴转债份额申购与赎回的数量限制

1.投资人办理东吴转债份额场外申购时,单笔申购最低金额为1,000元人民币(含申购费),每笔追加认购的最低金额为1,000元,通过直销中心单笔申购最低金额为1,000元人民币(含申购费),每笔追加认购的最低金额为1,000元。通过本基金管理人网上交易系统办理东吴转债份额申购业务的单笔申购最低金额为1,000元(含申购费),每笔追加认购的最低金额为1,000元。

2.通过会员单位办理场内东吴转债份额的申购时,单笔最低申购金额为50,000元(含申购费),同时申购金额必须是整数金额。

3.基金份额持有人赎回东吴转债份额的最低份额为100份,最低账面份额为100份。

4.投资者的赎回申请将导致其单个交易账户内留存的基金份额不足基金管理人规定的最低持有份额时,投资者应一次全部赎回;如投资者未一次全部提交赎回申请,销售机构有权以投资者在其单个交易账户内留存的该基金全部份额为限,办理赎回。(如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金份额等原因导致的账户余额少于基低持有份额的情况,不受此限)

5.基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定中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体上公告并报中国证监会备案。

六、东吴转债份额申购费率、赎回费率

1.申购费率

本基金对申购设置费差费率,申购费率随申购金额的增加而递减,最高申购费率不超过5%,投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。基金的申购费率如下:

申购金额(M,含申购费)	申购费率
M<10万元	0.5%
10万元≤M<100万元	0.4%
100万元≤M<200万元	0.2%
M≥200万元	按笔收取,每笔1000元

申购费用由投资人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2.赎回费率

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定,基金的赎回费率如下:

	持有期限(N,持有时间)	赎回费率
场外赎回费	N<3个月	0.50%
	3个月≤N<1年	0.30%
	1 年≤N<2年	0.05%
	N≥2 年	0
场内赎回费	本基金场内赎回费为固定值0.30%,不按份额持有时间分段设置赎回费率	

(注:其中1个月为30天,3个月为90天;1年为365日,2年为730日)

东吴转债份额的场内赎回费率为固定值0.3%。

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。

3.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体上公告。

4.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。

5.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。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、东吴转债份额场外申购份额的计算:

东吴转债份额的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日东吴转债份额净值

当申购费用为固定金额时,申购份数的计算方法如下:

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日东吴转债份额净值

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退还至投资人资金账户。

例如,某投资人投资50,250元场外申购东吴转债份额,对应申购费率为0.5%,假设申购当日东吴转债份额净值为1.080元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额=50,250.00/(1+0.5%)=50,000.00元

申购费用=50,250.00-50,000.00=250.00元

申购份数=50,000.00/1.080=46,296.30份

即:该投资人可得到46,296.30份东吴转债份额。

2、东吴转债份额赎回金额的计算:

本基金采用“份额赎回”方式,赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算。计算公式:

赎回总金额=赎回份额×T日东吴转债份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金额保留至五入方法,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。

例如:某基金份额持有人赎回其持有的100,000份东吴转债份额场外份额,持有时间是150天,对应的赎回费率为0.3%,假设赎回当日东吴转债份额净值是1.210元,则可得到的净赎回金额为:

赎回总金额=100,000×1.210=121,000.00元

赎回费用=121,000×0.3%=363.00元

净赎回金额=121,000-363=120,637.00元

即:该基金份额持有人可得到的净赎回金额为120,637.00元。

3、东吴转债份额的基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4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。

八、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:

1.因不可抗力导致基金无法正常运作。

2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3.证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4.基金管理人认为接受某笔或某批申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5.基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1,2,3,5,6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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,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。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1.因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3.证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4.法律两个或两个以上开放日主题赎回。

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结算登记系统无法正常运行;

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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,应将可支付部分按申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