东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债A份额和可转债B份额上市交易公告书

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
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2014年6月6日
公告日期：2014年6月3日

一、重要声明与提示

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”）之可转债A份额和可转债B份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人东吴基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人平安银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2014年4月2日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及东吴基金管理有限公司网站（www.scfund.com.cn）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》。

二、基金概览

1、基金名称：

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金（场内简称：东吴转债）；基金代码：165809

优先受益类份额（场内简称：可转债A）基金代码：150164

进取收益类份额（场内简称：可转债B）基金代码：150165

2、基金类别：债券型。

3、基金运作方式：契约型开放式。

4、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。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、基金发售：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。

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。

7、基金的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对东吴转债份额进行申购与赎回。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。

8、份额配对转换：东吴转债场内份额配对转换是指本基金的东吴转债场内的基础份额与分级份额可转债A、可转债B之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆是指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。合并是指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。场外的东吴转债份额不进行份额配对转换。在场外的东吴转债份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。份额配对转换业务将于2014年6月6日开始办理。

9、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。跨系统转托管业务将于2014年6月6日开始办理，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。

10、定期份额折算：在东吴转债份额、可转债A 份额存续期内的每个会计年度12月的第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金的东吴转债份额、可转债A份额进行定期份额折算。对于可转债A份额期末的约定应得收益，即可转债A份额每个会计年度11月30日份额净值超出本金1.000元部分，将折算为场内东吴转债份额分配给可转债A份额持有人。东吴转债份额持有人持有的每10份东吴转债份额将按7 份可转债A份额获得新增东吴转债份额的分配。持有场外东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外东吴转债份额的分配；持有场内东吴转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内东吴转债份额的分配。经过上述份额折算，东吴转债份额和可转债A份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、不定期份额折算 当东吴转债份额的基金份额净值达到1.400 元，或当可转债B份额的基金份额净值达到0.450 元时，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金全部份额进行不定期份额折算。份额折算后本基金将确保可转债A份额和可转债B份额的比例为7：3，份额折算后可转债A份额、可转债B份额和东吴转债份额的基金份额净值均调整为1元。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

12、基金份额总额：截至2014年5月29日，本基金的基金份额总额为268,064,983.90份，其中，东吴转债为236,908,512.90份，可转债A为21,809,529份，可转债B为9,346,942份。

13、基金份额净值：截至2014年5月29日，东吴转债的基金份额净值为1.001元，可转债A的基金份额净值为1.003元，可转债B的基金份额净值为0.996元。

14、本次上市交易的基金份额简称：可转债A、可转债B

15、本次上市交易的基金份额总额：可转债A为21,809,529.00份；可转债B为9,346,942.00份。

10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

11、上市交易日期：2014年6月6日

12、基金管理人：东吴基金管理有限公司

13、基金托管人：平安银行股份有限公司

14、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1471号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2014年4月8日至2014年4月30日

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构

（1）本基金场外认购的销售机构：

本基金通过场外发售的销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构包括本公司上海直销中心以及本公司网上交易系统。代销机构包括平安银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中航证券股份有限公司、财富证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、光大证券有限责任公司、渤海有限责任公司、招商证券股份有限公司、齐鲁证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、平安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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、广州证券有限责任公司、厦门证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、五矿证券有限公司、天源证券经纪有限公司、财富里昂证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、万联证券、银河证券、华鑫证券有限责任公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司以及上海长量基金销售投资有限公司（以上排名不分先后）。

（2）本基金场内认购的销售机构：

本基金通过场内发售的机构为爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、兴业证券、兴业证券、长城证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信证券、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

8、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为人民币267,961,793.01元，确认份额（不含利息转份额）267,961,793.01份，利息结转份额103,190.89份，总确认份额为268,064,983.90份。

上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2014年5月7日全额划入本基金托管人平安银行股份有限公司开立的托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算本基金募集期间含本息共募集268,064,983.90份基金份额，其中场外认购的基金份额为236,908,512.90份；场内认购的基金份额为31,156,471.00份。

10、基金备案情况

本基金已于2014年5月9日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2014年5月9日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2014年5月9日

12、基金合同生效日的基金份额总额：268,064,983.90份

（二）东吴转债的日常申购、赎回情况

东吴转债份额将于2014年6月6日开放日常申购、赎回，具体业务办理规则请投资者参阅2014年6月3日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《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开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

（三）可转债A与可转债B上市交易的主要内容

1、本基金的可转债A与可转债B上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2014】187号

2、上市交易日期：2014年6月6日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：可转债A、可转债B

5、交易代码：可转债A为150164、可转债B为150165

6、本次上市交易份额：可转债A为21,809,529份、可转债B为9,346,942份

7、基金资产净值的披露：用于基金信息披露的基金资产净值和东吴转债、可转债A与可转债B的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的东吴转债、可转债A与可转债B的基金份额净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的东吴转债份额托管在场外，基金份额持有人将其办理跨系统转托管至场内（证券登记结算系统）后，选择将东吴转债分拆为可转债A与可转债B后，方可上市流通。

（四）份额配对转换业务安排

东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自2014年6月6日起，开通东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金的份额配对转换业务，即东吴转债与可转债A、可转债B之间的配对转换，包括“分拆”和“合并”两个方面。“合并”或“分拆”每笔申请的份额数必须是10的整数倍，投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于10份。本公司可根据市场情况调整“合并”或“分拆”每笔申报份额的最低数量限制，并在调整生效前依照有关规定进行公告。

中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理资格的证券公司名单进行更新，投资者可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站（www.chinaclear.cn）查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2014年5月29日，场内基金份额持有人户数350户，平均每户持有的场内基金份额89,018.49份。可转债A份额持有人户数为350户，平均每户持有的基金份额62,312.94份。可转债B份额持有人户数为350户，平均每户持有的基金份额26,705.55份。场外东吴转债基金份额持有人户数2216户，平均每户持有东吴转债基金份额106908.17?份。

（二）持有人结构

截至2014年5月29日，本次上市交易的可转债A与可转债B基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的可转债A份额3,604,733份，占比16.53%；个人投资者持有的可转债A份额18,204,796份，占比83.47%。机构投资者持有的可转债B份额1,544,885.00份，占比16.53%；个人投资者持有的可转债B份额7,802,057.00份，占比83.47%。

（三）基金份额前十名持有人情况

本次上市交易的可转债A份额、可转债B份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有可转债A份额	占转可债A份额比（%）	持有可转债B份额	占可转债B份额比（%）
1	上海大润港务建设集团有限公司	2,099,545.00	9.63%	899,804.00	9.63%
2	刘登峰	1,260,847.00	5.78%	540,363.00	5.78%
3	邵亚静	700,095.00	3.21%	300,041.00	3.21%
4	苏州君创投资有限公司	700,095.00	3.21%	300,041.00	3.21%
5	周破	700,081.00	3.21%	300,035.00	3.21%
6	苏州国际发展集团有限公司	700,081.00	3.21%	300,035.00	3.21%
7	宁腊古	576,867.00	2.65%	247,229.00	2.65%
8	夏国芹	348,630.00	1.60%	149,413.00	1.60%
9	曾桂英	210,028.00	0.96%	90,012.00	0.96%
10	何水林	210,018.00	0.96%	90,008.00	0.96%
11	周民锋	210,018.00	0.96%	90,008.00	0.96%
合计		7,716,305.00	35.38%	3,306,989.00	35.38%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

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

总经理：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

工商登记注册的法人营业执照文号：310115000854513

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

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%
江阴澄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22个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉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增利债券型证券投资基金，于2011年7月27日基金合同生效，托管行为中信银行股份有限公司。公司已管理的第十一只产品东吴新产业精选股票型证券投资基金，于2011年9月28日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十二只产品东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF），于2012年3月9日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十三只产品东吴保本混合型证券投资基金，于2012年8月13日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十四只产品东吴内需增长混合型证券投资基金，于2013年1月30日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十五只产品东吴鼎利分级债券型证券投资基金，于2013年4月25日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十六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。公司已管理的第十七只产品东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金，于2014年5月9日基金合同生效，托管行为平安银行股份有限公司。

3、人员情况

截至2014年5月29日，公司员工总数107人，其中：正式员工107，，外包员工0人。学历构成如下：博士4人占比4%，硕士59人占比55%，本科37人占比35%，大专及以下7人占比6%。

4、信息披露负责人及咨询电话

徐军 021－50509888

5、本基金基金经理

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、太平资产管理有限公司，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。

（二）基金托管人

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%；在拨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，目前部门人员为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、国际注册私人银行家，具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作，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；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；2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长；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；自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理，一直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，尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托管部副总经理；2013年5月起任平安银行资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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。

（三）基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

办公地址：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

法定代表人：姚建华

经办注册会计师：王国蓓、陈启明

电话：+86(10)8508 5000

传真：+86(10)8518 5111

六、基金合同内容摘要

一、基金合同当事人的权利和义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集基金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国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、谨慎勤勉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，不得利用基金财产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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（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基金收益；

（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）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）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；

（18）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和银行监管机构，并通知基金管理人；

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）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。

（三）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

东吴转债份额、可转债A份额 及可转债B 份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果可转债A份额与可转债B份额的运作出现终止，则在终止可转债A份额与可转债B份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守《基金合同》；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）终止可转债A份额与可转债B份额的运作；

（11）终止可转债A份额与可转债B份额上市交易，但因可转债A份额与可转债B份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（12）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（13）代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各基金份额总数10%以上（含10%，每一级份额均应占各该级份额总数的10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额的10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，就同一事项书面要求召开基金份额持有人大；

（14）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（15）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（6）根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定，本基金修改可转债A份额与可转债B份额的上市与交易规定；

（7）在不变更本基金合同其他约定的条件下，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更东吴转债份额的收益分配方式

（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上（含10%，每一级份额均应占各该级份额总数的10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额总数的10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人。本占同以下相同表述与此具有相同含义）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上（含10%，每一级份额均应占各该级份额总数的10%以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额总数的10%以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人。本占同以下相同表述与此具有相同含义）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

5、代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的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。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的，召集人可以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基金份额的持有人参加，方可召开（下同）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以