

东吴基金管理有限公司

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金实施转型的 提示性公告

东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理的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”）自 2020 年 6 月 11 日起，至 2020 年 7 月 12 日 17:00 止以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《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》（以下简称“本次会议议案”）。本次会议议案于 2020 年 7 月 13 日表决通过，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。基金管理人已于 2020 年 7 月 14 日在规定媒介发布了《东吴基金管理有限公司关于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结果暨决议生效的公告》。

根据本次基金份额持有人大会决议，现将实施转型的有关事项提示如下：

一、本基金转型选择期开始日：2020 年 7 月 14 日，本基金转型选择期截止日：2020 年 8 月 10 日。

本次持有人大会决议生效后，本基金转型选择期为 2020 年 7 月 14 日起至 2020 年 8 月 10 日。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。基金管理人已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，并已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。

二、可转债 A 份额、可转债 B 份额终止上市交易

为实施转型，基金管理人将按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》、《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》等有关规定向深圳证券交易所申请可转债 A 份额、可转债 B 份额的终止上市。届时，本基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则及时发布本基金的终止上市公告。

三、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。

四、关于基金合同等法律文件的修订

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有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金合同》、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议》，并据此编制《东吴中证可转换债券指数证券投资基金招募说明书》。本基金已经中国证监会证监许可[2018]1393号《关于准予东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册。自基金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》、《东吴中证可转换债券指数证券投资基金托管协议》生效，原《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》、《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

五、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”，确权完成及转型后基金开通相关业务后，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。转型后场内基金份额后续事项的实施安排详见相关公告。

基金份额持有人在未确权前，若东吴中证可转换债券指数证券投资基金进行收益分配，未确权基金份额持有人的收益分配方式为红利再投资。

经过确权后持有人持有的原登记在场内证券登记结算系统的基金份额，持有期限自确权登记日起计算；基金份额持有人原登记在场外登记系统的基金份额，持有期限自其认/申购东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金份额的申请确认之日起计算。

六、重要提示

本基金转型前后,原可转债 A 份额和可转债 B 份额的基金份额持有人所持份额的风险收益特征将发生较大变化。转型后东吴中证可转换债券指数证券投资基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金转型后不在交易所上市交易。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2020 年 7 月 14 日