

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转型份额 转换与变更登记的公告

根据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”)基金份额持有人大会决议,东吴基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)决定对本基金进行基金份额转换与变更登记,转型为东吴中证可转换债券指数证券投资基金。基金份额转换由基金管理人办理,并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。

一、基金份额转换和变更登记

1、转换基准日:2020年8月11日。

2、转换对象:转换基准日登记在册的东吴转债份额、可转债A份额、可转债B份额。

3、基金份额转换

基金管理人在份额转换基准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,注册登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。在份额转换基准日,东吴转债份额的场内份额、可转债A份额、可转债B份额将最终转换为东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额的场内份额,东吴转债份额的场外份额将最终转换为东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金份额的场外份额。

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。

4、基金份额变更登记

注册登记机构进行基金份额的变更登记。

5、基金份额转换结果公告

本基金份额转换及注册登记机构变更登记完成后，基金管理人将在指定媒介对份额转换结果予以公告。

如果基金份额转换过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额转换与变更登记。

二、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 2020 年 8 月 12 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》将自同一起失效。

三、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，即 2020 年 8 月 13 日（含）至 2020 年 11 月 12 日（含）期间，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。

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。

四、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。

五、其他

投资者欲了解详细情况，可登录本公司网站（www.scfund.com.cn）或者拨打本公司的客户服务电话 400-821-0588 进行咨询。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金管理人管理的基金时应认真阅读基金相关法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2020 年 8 月 5 日