

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债 B

交易价格异常波动的风险提示公告

截至 2015 年 11 月 19 日,东吴基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债 B 基金份额(基金简称:可转债 B;交易代码:150165)二级市场交易价格出现较大波动,请投资者密切关注当日基金份额净值。2015 年 11 月 18 日,可转债 B 份额在二级市场的收盘价为 0.991 元,相对于当日 0.741 元的基金份额参考净值,溢价幅度达到 33.74%。截止 2015 年 11 月 19 日,可转债 B 份额在二级市场的收盘价为 1.019 元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失。

为此本基金管理人声明如下:

一、可转债 B 为东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金中较高风险类份额,由于可转债 B 份额内含杠杆机制的设计,可转债 B 份额净值的变动幅度将大于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之东吴转债份额(基金简称:东吴转债;交易代码:165809)和可转债 A 份额(基金简称:可转债 A;交易代码:150164)净值的变动幅度,可转债 B 份额的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。可转债 B 份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

二、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。

三、截至 2015 年 11 月 19 日收盘,东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值。不定期份额折算后,东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

四、截至本公告披露日,东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》和《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》等相关资料。

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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险，理性投资。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2015年11月20日