

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

办理定期份额折算业务的公告

根据《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将以2017年12月1日为基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度12月的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2017年12月1日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之基础份额（基金代码为：“165809”，基金简称为“东吴转债”）及东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之A份额（基金代码为：“150164”，基金简称为“可转债A”）。

三、基金份额折算方式

可转债A份额和可转债B份额按照《基金合同》第四部分“基金的分级”进行净值计算，对可转债A份额的应得收益进行定期份额折算，每10份东吴转债份额将按7份可转债A份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，可转债A份额和可转债B份额的份额配比保持7:3的比例。

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。

每个会计年度12月第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对东吴转债份额和可转债A份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度12月第一个工作日进行可转债A份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

1、可转债A份额

定期份额折算后可转债A份额的份额数 = 定期份额折算前可转债A份额的份额数。

$$\begin{aligned} & \text{可转债A份额持有人新增的场内东吴转债份额的份额数} \\ &= \frac{NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}} \end{aligned}$$

其中：

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后东吴转债份额净值

$NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债A份额净值

$NUM_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前可转债A份额的份额数

可转债A份额新增份额折算成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。

2、可转债B份额

每个会计年度的定期份额折算不改变可转债B份额净值及其份额数。

3、东吴转债份额

$$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}} = NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} - 0.7 \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)$$

东吴转债份额持有人新增的东吴转债份额

$$= \frac{0.7 \times NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前东吴转债份额净值

$NAV_{\text{东吴转债}}^{\text{后}}$: 定期份额折算后东吴转债份额净值

$NAV_{\text{可转债A}}^{\text{前}}$: 定期份额折算前可转债 A 份额净值

$NUM_{\text{东吴转债}}^{\text{前}}$: 定期份额折算前东吴转债份额的份额数

东吴转债份额的场外份额经折算后的份额数采用截位的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产;东吴转债份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

4、定期份额折算后东吴转债份额的份额数 = 定期份额折算前东吴转债份额的份额数 + 东吴转债份额持有人新增的东吴转债份额的份额数 + 可转债 A 份额持有人新增的东吴转债份额的份额数

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一)定期份额折算基准日(即2017年12月1日),本基金暂停办理申购(含定期定额投资,下同)、赎回、转托管(包括系统内转托管和跨系统转托管,下同)及配对转换业务;可转债A、可转债B交易正常。2017年12月1日晚间,基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。可转债B在整个定期折算期间交易正常进行。

(二)定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2017年12月4日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,可转债A暂停交易。2017年12月4日,本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

(三)定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2017年12月5日),基金管理人将公告份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内的基金份额。2017年12月5日,本基金恢复办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,可转债A恢复交易。

五、重要提示

(一)根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2017年12月5日可转债A即时行情显示的前收盘价为2017年12月4日的可转债A的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于可转债A折算前可能存在折溢价交易情形,折算前的收盘价扣除2017年约定收益后与2017年12月5日的前收盘价可能有较大差异,2017年12月5日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投

资风险。

(二) 本基金可转债A份额期末的约定应得收益将折算为场内东吴转债份额分配给可转债A份额的持有人,而东吴转债份额为跟踪中证转债指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此可转债A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性,其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

(三) 由于可转债A份额经折算产生的新增场内东吴转债份额数和场内东吴转债份额经折算后的份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金财产,持有极小数量可转债A份额或场内东吴转债份额的持有人存在无法获得新增场内东吴转债份额的可能性。

(四) 投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情,请登陆本公司网站:www.scfund.com.cn 或者拨打本公司客服电话:400-821-0588(免长途话费)。

风险提示:本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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。投资有风险,决策须谨慎。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2017年11月28日