

## 东吴基金管理有限公司

### 东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 份额

#### 不定期份额折算的风险提示公告

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》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关规定,当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 B 类份额(可转债 B 份额)的基金份额参考净值达到或跌破 0.450 元时,东吴可转债 A 份额(场内简称:可转债 A,基金代码:150164)、东吴可转债 B 份额(场内简称:可转债 B,基金代码:150165)、东吴转债份额(场内简称:东吴转债,基金代码:165809)将进行不定期份额折算。

截至 2017 年 12 月 4 日,本基金可转债 B 份额的基金份额净值为 0.440 元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同,本基金将以 2017 年 12 月 5 日为基准日办理不定期份额折算业务。截至 2017 年 12 月 4 日,可转债 B 收盘价为 0.510 元,溢价率为 15.91%。不定期份额折算后,B 类份额杠杆倍数将大幅降低,恢复到初始杠杆水平,B 类份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日(2017 年 12 月 5 日)当天盲目投资,可能遭受重大损失,敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2017 年 12 月 5 日