

东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利A份额开放申购与赎回 及折算期间鼎利B份额（150120）的风险提示公告

东吴鼎利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同已于2013年4月25日生效。根据本基金《基金合同》的规定，本基金自生效之日起3年内，基金份额分为鼎利A份额（基金代码：165808）和鼎利B份额（基金代码：150120），两者的份额配比原则上不超过7:3。鼎利A份额根据基金合同的规定获取约定收益，本基金在扣除鼎利A的应计收益后的全部剩余收益归鼎利B份额有，亏损以鼎利B份额的资产净值为限由鼎利B份额承担。鼎利A份额自基金合同生效之日起每满6个月进行一次基金份额折算，同时开放一次申购与赎回，2013年10月24日为鼎利A份额折算基准日及第1个开放申购与赎回日。现就相关事项提示如下：

1、鼎利B份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》的规定，鼎利A份额的年约定收益率为一年期银行定期存款年利率 $\times 0.7 + 6$ 个月Shibor $\times 0.5$ 。在鼎利A份额的每个开放日，基金管理人将根据开放日首日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率以及开放日所在月份第一个交易日的6个月Shibor利率重新调整鼎利A份额的约定年收益率。鼎利A份额的年约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后2位。

目前，一年期整存整取基准年利率为3.00%，如果2013年10月24日执行的一年期整存整取基准年利率仍为3.00%，本月第一个交易日10月8日的6个月Shibor利率为4.22%，本次开放日后鼎利A份额年约定收益率将为4.21%。若2013年10月11日执行的一年期整存整取基准年利率有所变动，则鼎利A份额的年约定收益率将按上述方式进行调整，鼎利B份额的收益分配也将进行相应调整。

2、鼎利B份额杠杆率变动的风险。目前，鼎利A份额与鼎利B份额的份额配比为4.92145936：3。根据《基金合同》，本次鼎利A份额实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，原则上鼎利A份额和鼎利B份额的份额配比原则上不超过7:3。如果鼎利A的申购申请与赎回申请不匹配，鼎利A份额的规模将相应变化，从而引致份额配比变化风险，进而出现杠杆率变动风险。

本基金管理人将向深圳证券交易所申请鼎利B份额自2013年10月24日至2013年10月25日实施停牌。本公告发布之日（2013年10月22日）上午鼎利B份额停牌一小时。本次鼎利A份额实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，本基金管理人将对鼎利A份额

折算及开放申购与赎回的结果进行公告。

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时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。

东吴基金管理有限公司

2013 年 10 月 22 日