

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”）“第二十部分、基金份额折算”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”）之可转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 7 月 8 日，本基金可转债 B 份额的基金份额净值为 0.181 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 7 月 9 日为基准日办理不定期份额折算业务。截至 2015 年 7 月 8 日，可转债 B 收盘价为 0.873 元，溢价率高达 382.32%。

不定期份额折算后，可转债 B 杠杆倍数将大幅降低，恢复到初始杠杆水平，可转债 B 的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日（2015 年 7 月 9 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。

在出现极端损失的情况下，可转债 B 份额的净资产可能归零，如果在不定期份额折算基准日可转债 B 份额的净资产归零，由于进行不定期份额折算，依据折算公式，在折算后可转债 B 份额持有人持有的份额数量也将归零。请投资者注意投资风险。

东吴基金管理有限公司

2015 年 7 月 9 日