

东吴基金管理有限公司关于 东吴鼎利分级债券型证券投资基金分级期届满 与基金份额到期转换的公告

《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2013 年 4 月 25 日生效，东吴鼎利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）在基金合同生效后 3 年的分级运作期内，本基金的基金份额划分为东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利 A 份额（简称：鼎利优先，基金代码：165808）、东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利 B 份额（简称：鼎利进取，基金代码：150120）两级份额。

根据基金合同的相关规定，基金合同生效后 3 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）。”（以下简称“东吴鼎利（LOF）”）。

根据基金合同和《东吴鼎利分级债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金分级运作期届满日为 2016 年 4 月 25 日。

一、鼎利 B 份额封闭期届满日的提示

根据本基金基金合同的规定，鼎利 B 份额的封闭期为自基金合同生效日之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

2016 年 4 月 25 日是鼎利 B 份额的封闭期届满日，鼎利 B 份额将在该日日终，按照其对应的基金份额净值转换成上市开放式基金（LOF）份额。

鼎利 B 份额（150120）拟定于基金份额转换基准日终止上市，终止上市的详细信息基金管理人将另行公告。

二、三年期届满后基金的存续形式

基金合同生效后 3 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”。鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，在满足上市条件的情况下，东吴鼎利（LOF）基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

三、三年期届满基金转型时鼎利 A 份额的处理方式

基金合同生效后 3 年期届满，鼎利 A 基金份额持有人可在最后一个开放日选择将其持有的鼎利 A 份额赎回，若基金份额持有人在规定时间内未提出赎回申请，其持有的鼎利 A 份额将被默认为转换为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”份额。

根据基金合同中关于“本基金基金合同生效之日起 3 年内，鼎利 A 的开放日为自基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日”的规定，2016 年 4 月 22 日为鼎利 A 份额的最后开放赎回申请日。鼎利 A 份额的基金份额持有人可作出选择赎回鼎利 A 份额或是选择不赎回鼎利 A 份额。投资者选择不赎回鼎利 A 份额的，其持有的鼎利 A 份额将于 2016 年 4 月 25 日日终转换后被默认为转入“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”份额。

四、三年期届满基金份额的转换规则

1、基金份额转换日的确定

鼎利 A 份额和鼎利 B 份额基金份额转换日为基金合同生效之日起三年后的对应日。如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

2016 年 4 月 25 日确定为鼎利 A 份额和鼎利 B 份额的基金份额转换日。

2、份额转换方式及份额计算

本基金基金份额转换基准日日终，基金管理人将鼎利 A 份额、鼎利 B 份额按照各自的基金份额净值折算成面值为 1.000 元的上市开放式基金（LOF）后的基金份额若干。

鼎利 A 份额和鼎利 B 份额转换公式为：

鼎利 A 份额转换后基金份额数 = 转换前鼎利 A 份额数 × T 日鼎利 A 基金份额净值 / 1.000

鼎利 B 份额转换后基金份额数 = 转换前鼎利 B 份额数 × T 日鼎利 B 基金份额净值 / 1.000

在实施基金份额折算时，鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的折算比率、鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）基金份额持有人持有的转型后上市开放式基金（LOF）份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

3、基金份额转换后的基金运作

基金管理人将在鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的份额全部转换为东吴鼎利（LOF）份额之日起 30 日内，开始办理东吴鼎利（LOF）的场外与场内申购和赎回业务。

基金管理人将在鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的份额全部转换为东吴鼎利（LOF）份额之日起 30 日内，在满足上市条件的情况下，申请东吴鼎利（LOF）基金份额在深圳交易所上市交易。

份额转换后东吴鼎利（LOF）开始办理申购与赎回、上市交易的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

4、份额转换的公告

（1）基金分级运作周期届满时，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案；

（2）在基金分级运作周期届满日前 30 个工作日，基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告。

（3）鼎利 A 份额、鼎利 B 份额进行份额转换结束后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

五、三年期届满基金转型后基金的投资管理

基金分级运作周期届满、转换为上市开放式基金（LOF）后，投资管理的相关内容将保持不变。如法律法规或监管部门的相关规定发生变化的，本基金履行适当程序后，投资管理的相关内容可随之改变并及时公告。

六、重要提示

1. 基金份额到期转换完成后，本基金将更名为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”。

2. 本基金封闭期到期后，鼎利 B 份额将终止在深圳证券交易所上市交易，详见基金管理人届时发布的相关公告。

3. 为保证本基金份额转换的平稳运作，自本基金的基金份额转换基准日起，基金管理人根据中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则停止

办理鼎利 A 份额、鼎利 B 份额的系统内转托管和跨系统转托管业务。届时请详见基金管理人发布的相关公告。

4. 鼎利 A 份额表现出低风险、收益稳定的明显特征。但在本次到期转换完成后，原鼎利 A 份额持有人将面临风险收益特征变化的风险，由持有低风险收益特征的鼎利 A 份额转变为持有中低风险收益特征的“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”份额，其份额净值将随市场涨跌而变化。因此，原鼎利 A 份额持有人的预期收益实现的不确定性将会增加，并还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5. 在东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）份额开放上市交易或申购、赎回之前，投资人将无法办理基金的赎回，存在一定的流动性风险。基金份额转换基准日托管在不具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位的鼎利 B 份额，转换完成后，须将转换得到的东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）份额转托管至场内具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位，或者跨系统转托管至场外销售机构，方可办理基金份额的赎回业务。

投资者可登陆本公司网站 www.scfund.com.cn，或拨打本公司客服电话 400-821-0588 咨询相关信息。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2016 年 3 月 7 日