

**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之鼎利A份额开放赎回期
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，两者的份额配比原则上不超过 7:3。本基金为鼎利A份额设立约定年化收益率，基金的净资产将优先满足鼎利A份额的本金及约定收益，剩余的净资产归鼎利B份额享有。根据本基金《基金合同》的规定，经与本基金托管人交通银行股份有限公司确认，本基金在分级运作期内，鼎利A份额每满 6 个月进行一次基金份额折算并进行开放，鼎利A份额的基金份额折算基准日与开放日为同一天。鼎利B份额封闭运作并上市交易。

2016 年 4 月 22 日为鼎利 A 份额的最后一个基金份额折算基准日及开放日，该日仅开放鼎利 A 份额的赎回业务，现就本次鼎利 A 份额开放赎回期间鼎利 B 份额的风险提示如下：

1、鼎利 B 份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定，本基金将于每个鼎利A份额的开放日针对下一期鼎利A份额的约定年化收益率进行设定并公告，计算公式为：鼎利A约定年收益率 = 一年期银行定期存款利率 × 0.7 + 6 个月 Shibor × 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，一年期定期存款基准利率 1.50%，如果 2016 年 4 月 22 日执行的一年期一年期定期存款基准利率仍为 1.50%，本月第一个交易日 2016 年 4 月 1 日

的 6 个月Shibor利率为 2.8720%,本次开放日后鼎利A份额年约定收益率将为 2.49%。若 2016 年 4 月 22 日执行的一年期定期存款基准利率有所变动,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。

因鼎利 A 份额将于 2016 年 4 月 25 日日终转换后被默认转入“东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF)” 份额,故本次的约定收益适用于 2016 年 4 月 25 日当日。

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 0.09378474:1。本次鼎利 A 份额实施基金份额折算及开放赎回结束后,鼎利 A 份额的规模将缩减,从而引发鼎利 A 份额、鼎利 B 份额配比发生变化,进而导致鼎利 B 份额杠杆率变动风险,本基金管理人将对鼎利 B 份额基金份额开放赎回的结果进行公告。

本基金转换为东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF) 后,原鼎利 B 份额将不再上市交易,本基金管理人已向深圳证券交易所申请终止本基金鼎利 B 份额的基金份额上市交易,终止上市日为 2016 年 4 月 25 日。本公告发布之日 (2016 年 4 月 20 日) 开市起至 10:30 鼎利 B 份额停牌一小时。

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

2016 年 4 月 20 日