

## 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得约定收益,本基金在扣除鼎利A的设计收益后的全部剩余收益归鼎利B份额所有,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,同时开放申购与赎回,2014年10月24日为鼎利A份额折算基准日及第3个开放申购与赎回日。现就相关事项提示如下:

一、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率为一年定期存款利率 $\times 0.7 + 6\text{个月} S_{1,1} b_{1,0} r \times 0.5$ 。在鼎利A每年的第一个开放日,基金管理人将根据开放日首日中国人民银行公布的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S1,1ibor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原则保留到小数点后两位。

目前,一年期整存整取基准年利率为3.00%,如果2014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S1,1ibor利率为4.90%,本次开放日后鼎利A份额的约定收益率将为4.50%。若2014年10月24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份额的份额配比也将进行相应调整。

二、鼎利A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2.29196784:3。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份额与鼎利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,从而导致份额配比变化风险,进而出现杠杆率变动风险。

本基金基金管理人将向深圳证券交易所申请鼎利B份额自2014年10月24日至2014年10月27日实施停牌。本公司公告发布之日(2014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,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。

基金管理人秉承以诚实信用、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  
2014年10月22日

## 东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利A份额折算方案的公告

根据《东吴鼎利分级债券型证券投资基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及《东吴鼎利分级债券型证券投资基金招募说明书》的规定,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》生效之日起每满6个月的最后一个工作日。

现将折算的具体事宜公告如下:

一、折算基准日

鼎利优先的基金份额第三次折算基准日与其第三个开放日为同一个工作日,即2014年10月24日。

二、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鼎利优先所有份额。

三、折算比例

自基金合同生效之日起3年内,每满6个月对鼎利优先进行一次基金份额折算。

四、折算方式

折算日当日,鼎利优先的基金份额净值调整为1,000元,折算后,基金份额持有人持有的鼎利优先的份额数按折算比例相应增减。

鼎利优先的基金份额净值比例=折算日折算前鼎利优先的基金份额净值/1,000

鼎利优先折算后的份额数=折算前鼎利优先的份额数×鼎利优先的折算比例  
鼎利优先折算后的份额数保留到小数点后2位,由此产生的误差计入基金财产。除保留位数因四舍五入外,基金份额折算对鼎利优先持有人的权益无实质性影响。

在实施基金份额折算后,折算日折算前鼎利优先基金份额净值、鼎利优先折算比例的累计计算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

五、基金份额折算期间的基金业务办理

1.本公司公告发布之日(2014年10月22日)上午鼎利B份额开市停牌一小时。

2.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),鼎利优先开放办理申购、赎回业务,基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

3.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

4.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

5.基金份额折算期间的基金业务办理

6.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

7.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),鼎利优先开放办理申购、赎回业务,基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

8.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

9.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

10.基金份额折算期间的基金业务办理

11.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

12.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

13.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

14.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

15.基金份额折算期间的基金业务办理

16.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

17.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

18.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

19.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

20.基金份额折算期间的基金业务办理

21.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

22.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

23.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

24.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

25.基金份额折算期间的基金业务办理

26.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

27.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

28.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

29.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

30.基金份额折算期间的基金业务办理

31.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

32.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

33.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

34.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

35.基金份额折算期间的基金业务办理

36.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

37.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

38.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

39.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

40.基金份额折算期间的基金业务办理

41.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

42.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

43.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

44.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

45.基金份额折算期间的基金业务办理

46.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

47.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

48.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

49.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

50.基金份额折算期间的基金业务办理

51.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

52.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

53.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

54.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

55.基金份额折算期间的基金业务办理

56.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

57.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

58.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先开放日的详细信息敬请参见基金《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的内容说明;鼎利进取继续暂停交易。当日,本公司基金管理人将公告基金份额折算基准日后的第二个工作日(即2014年10月28日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

59.基金份额折算基准日后的第三个工作日(即2014年10月29日),基金管理人将公告基金份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,鼎利进取恢复交易。

60.基金份额折算期间的基金业务办理

61.本公司公告发布之日(2014年10月22日)下午鼎利B份额开市停牌一小时。

62.基金份额折算基准日(即2014年10月24日),基金管理人对鼎利优先进行份额折算;东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利B份额(以下简称“鼎利B”)暂停交易。

63.基金份额折算基准日后的第一个工作日(即2014年10月27日),基金管理人对鼎利优先暂停办理申购、赎回业务直至下一个开放日。有关鼎利优先