

## 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,基金份额分为鼎利优先级基金份额(简称:鼎利优先,基金代码:165808)和鼎利B份额(简称:鼎利进取,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金额归鼎利B份额所有,亏损以鼎利B份额的净资产值为限由鼎利B份额承担,鼎利A份额与基金合同生效之日起每满6个月进行一次基金份额折算,同时开放一个申购与赎回日,2015年10月23日为鼎利A份额折算基准日及第5个开放申购与赎回日,现就相关事项提示如下:

1、鼎利的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限定期存款利率+0.74%个月Shibor0.5,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的金融机构人民币一年期定期存款基准利率重新调整鼎利A份额的约定收益率,本基金在扣除鼎利A的应计收益后的全部金额归鼎利B份额所有,亏损以鼎利B份额的净资产值为限由鼎利B份额承担,鼎利A份额与基金合同生效之日起每满6个月进行一次基金份额折算,同时开放一个申购与赎回日,2015年10月23日为鼎利A份额折算基准日及第5个开放申购与赎回日,现就相关事项提示如下:

目前,一年期整存整取基准利率为1.75%,如果2015年10月23日执行的一年期整存整取基准年利率仍为1.75%,本产品第一个交易日10月23日的每个月Shibor利率为3.3408%,本次开放后鼎利A份额的预期收益率将比原计划的2.90%。若2015年10月23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作出相应调整。

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1.62673193,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,原份额与鼎利A份额的份额配比原则不超过7:3,如鼎利A的申购申请与赎回申请不匹配,鼎利A份额的规模将可能变化,从而引致份额配比变化风险,进而出现杠杠变动风险。

本基金管理人将向深圳证券交易所申请鼎利B份额自2015年10月23日至2015年10月26日实施停牌,本公告发布之日(2015年10月21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》等及相关法律文件。

东吴基金管理有限公司  
2015年10月21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3年内,鼎利A的基金份额(简称:鼎利优先,基金代码:165808)折算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,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四次折算基准日与其第五个开放日为同一个工作日,即2015年10月23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、折算频率

基金份额折算基准日每满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1.00元,折算后,基金份额持有人持有的鼎利优先的份额按照折算比例相应增减。

鼎利优先的基金份额折算公式如下:

鼎利优先的基金份额折算比例=折算后折算前鼎利优先的基金份额净值/1.00

鼎利优先经折算后的份额数=折算前鼎利优先的基金份额数×鼎利优先的折算比例

鼎利优先经折算后的份额保留到小数点后2位,由此产生的误差计入基金财产。

除保留位数影响外,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具体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、本公司公告之日(2015年10月21日)上午鼎利B份额停牌一小时。

2、基金份额折算基准日(即2015年10月23日),鼎利优先在开放日办理申购、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之后的第一个工作日(即2015年10月26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《基金合同》、《招募说明书》及相关公告的有关内容);鼎利优先继续暂停交易。当日本基金管理人为持有者时,份额登记确认。

4、基金份额折算基准日之后的第二个工作日(即2015年10月27日),基金管理人将公告份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内基金份额。当日,暂停提取赎回交易。

风险提示: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》等及相关法律文件。

东吴基金管理有限公司  
二零一五年十月二十一日

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份额开放申购与赎回业务的公告

公告送出日期:2015年10月21日

1 公告基本信息

基金名称	东吴鼎利分级债券型证券投资基金
基金简称	东吴鼎利分级债券(场内简称:东吴鼎利)
基金主代码	165807
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2013年4月25日
基金管理人名称	东吴基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》、《东吴鼎利分级债券型证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2015年10月23日
赎回起始日	2015年10月23日
下属分级基金的基金代码	鼎利优先
下属分级基金是否开放申购、赎回	是
下属分级基金的交易代码	165808
下属分级基金是否开放申购、赎回	否

2 公告正文

3 公告正文

4 公告正文

5 公告正文

6 公告正文

7 公告正文

8 公告正文

9 公告正文

10 公告正文

11 公告正文

12 公告正文

13 公告正文

14 公告正文

15 公告正文

16 公告正文

17 公告正文

18 公告正文

19 公告正文

20 公告正文

21 公告正文

22 公告正文

23 公告正文

24 公告正文

25 公告正文

26 公告正文

27 公告正文

28 公告正文

29 公告正文

30 公告正文

31 公告正文

32 公告正文

33 公告正文

34 公告正文

35 公告正文

36 公告正文

37 公告正文

38 公告正文

39 公告正文

40 公告正文

41 公告正文

42 公告正文

43 公告正文

44 公告正文

45 公告正文

46 公告正文

47 公告正文

48 公告正文

49 公告正文

50 公告正文

51 公告正文

52 公告正文

53 公告正文

54 公告正文

55 公告正文

56 公告正文

57 公告正文

58 公告正文

59 公告正文

60 公告正文

61 公告正文

62 公告正文

63 公告正文

64 公告正文

65 公告正文

66 公告正文

67 公告正文

68 公告正文

69 公告正文

70 公告正文

71 公告正文

72 公告正文

73 公告正文

74 公告正文

75 公告正文

76 公告正文

77 公告正文

78 公告正文

79 公告正文

80 公告正文

81 公告正文

82 公告正文

83 公告正文

84 公告正文

85 公告正文

86 公告正文

87 公告正文

88 公告正文

89 公告正文

90 公告正文

91 公告正文

92 公告正文

93 公告正文

94 公告正文

95 公告正文

96 公告正文

97 公告正文

98 公告正文

99 公告正文

100 公告正文

101 公告正文

102 公告正文

103 公告正文

104 公告正文

105 公告正文

106 公告正文

107 公告正文