

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金不定期 份额折算结果及恢复交易的公告

根据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）基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，东吴基金管理有限公司（以下简称：本公司）以 2016 年 1 月 11 日为份额折算基准日，对东吴转债份额的场外份额、场内份额以及可转债 A 份额、可转债 B 份额实施不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2016 年 1 月 11 日，东吴转债份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产；东吴转债份额的场内份额、可转债 A 份额、可转债 B 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。份额折算比例按截尾法精确到小数点后第 9 位，折算结果如下表所示：

基金份额名称	折算前份额 (单位：份)	折算比例	折算后份额 (单位：份)	折算后基金份额净值（单位：元）
东吴转债 场外份额	8,669,967.60	0.825234624	7,154,757.45	1.000
东吴转债 场内份额	106,677,253.00	0.825234624	120,808,262.00 注 1	1.000
可转债 A 份额	54,645,628.00	0.405399549	22,153,312.00	1.000
		0.599764376	32,774,501.00 注 2	
可转债 B 份额	23,419,555.00	0.405399547	9,494,276.00	1.000

注 1：该“折算后份额”为折算后场内东吴转债份额之和，包括原场内东吴转债份额经折算后的份额以及原可转债 A 份额经折算后的新增场内东吴转债份额。

注 2：该“折算后份额”为可转债 A 份额经折算后产生的新增东吴转债场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自 2016 年 1 月 13 日起，本基金恢复申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）和配对转换业务，可转债 A、可转债 B 将于 2016 年 1 月 13 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并将于 2016 年 1 月 13 日上午 10:30 复牌。

根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2016 年 1 月 13 日可转债 A 份额、可转债 B 份额即时行情显示的前收盘价调整为前一交易日（2016 年 1 月 12 日）可转债 A 份额、可转债 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），分别为 1.000 元和 1.050 元。2016 年 1 月 13 日当日可转债 A 份额和可转债 B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

三、其他需要提示的事项

1、可转债 A 份额、可转债 B 份额、东吴转债份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量可转债 A 份额、可转债 B 份额、东吴转债份额的场内份额持有人，可能存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的情况。

2、本基金可转债 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后可转债 A 份额持有人的风险收益特征可能发生了较大变化，由持有单一的低风险收益特征的可转债 A 份额变为同时持有低风险收益特征的可转债 A 份额与较低风险收益特征东吴转债份额，因此原可转债 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，东吴转债份额为跟踪中证转债指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原可转债 A 份额持有人还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金可转债 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，由目前的杠杆恢复到初始的 3.33 倍杠杆水平，相应地，可转债 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也可能相应减小。

4、由于可转债 A 份额、可转债 B 份额折算前存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，可转债 A 份额、可转债 B 份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价率所带来的风险。

5、本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

6、如有疑问，请拨打本公司客户服务热线：400-821-0588（免长话费），或登陆本公司网站 www.scfund.com.cn 获取相关信息。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2016 年 1 月 13 日