

东吴基金管理有限公司东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 份额不定期份额折算的风险提示公告

根据《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）中关于不定期份额折算的相关规定，当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）之 B 类份额（可转债 B 份额）的基金份额参考净值达到或跌破 0.450 元时，东吴可转债 A 份额（场内简称：可转债 A，基金代码：150164）、东吴可转债 B 份额（场内简称：可转债 B，基金代码：150165）、东吴转债份额（场内简称：东吴转债，基金代码：165809）将进行不定期份额折算。

截至 2017 年 12 月 4 日，本基金可转债 B 份额的基金份额净值为 0.440 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同，本基金将以 2017 年 12 月 5 日为基准日办理不定期份额折算业务。截至 2017 年 12 月 4 日，可转债 B 收盘价为 0.510 元，溢价率为 15.91%。不定期份额折算后，B 类份额杠杆倍数将大幅降低，恢复到初始杠杆水平，B 类份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日（2017 年 12 月 5 日）当天盲目投资，可能遭受重大损失，敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2017 年 12 月 5 日