

关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 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2019年12月2日为份额折算基准日，对本基金东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之基础份额（基金代码为：“165809”，基金简称为“东吴转债”）及东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之A份额（基金代码为：“150164”，基金简称为“可转债A”）实施了定期份额折算，现将折算结果及恢复交易相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2019年12月2日，场外东吴转债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；可转债A份额、场内东吴转债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。份额折算比例按截位法精确到小数点后第9位，具体结果如下表所示：

基金份额名称	折算前份额	份额折算比例	折算后份额	折算后份额净值
场外东吴转债份额	2,754,750.65	1.030734876	2,839,417.57	1.025
场内东吴转债份额	2,667,569.00	1.030734726	2,749,556.00	1.025
可转债 A 份额	8,321,422.00	1.000000000	可转债 A 份额： 8,321,422.00	1.000
		0.043906969	东吴转债份额： 365,368.00	1.025

注：场外东吴转债份额经折算后产生新增的份额为场外东吴转债份额；场内东吴转债份额经折算后产生新增的份额为场内东吴转债份额；可转债A份额经折算后产生新增的份额为场内东吴转债份额。

投资者自本公告发布之日起可查询经本基金注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2019年12月4日起，本基金恢复申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）和配对转换业务。

三、重要提示

（一）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019年12月4日可转债A即时行情显示的前收盘价为2019年12月3日的可转债A的份额净值（四舍五入至0.001元），即1.000元。由于可转债A折算前存在折价交易情形，2019年12月2日的收盘价为1.026元，扣除上一个定期折算期间约定收益后为0.981元，与2019年12月4日的前收盘价存在较大差异，2019年12月4日当日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。

（二）本基金可转债A份额期末的约定应得收益折算为场内东吴转债份额分配给可转债A份额的持有人，而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，因此可转债A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

（三）由于可转债A份额经折算产生的新增场内东吴转债份额数和场内东吴转债份额经折算后的份额数将取整计算（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份额或场内东吴转债份额的持有人存在无法获得新增场内东吴转债份额的情况。

（四）投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.scfund.com.cn或者拨打本公司客服电话：400—821—0588（免长途话费）。

风险提示：本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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，决策须谨慎。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2019年12月4日