

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(基金简称:鼎利优先,基金代码:165808)和鼎利 B 份额(基金简称: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剩余收益归鼎利 B 份额有,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,同时开放一次申购与赎回,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 B 份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》的规定,鼎利 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率 $\times 0.7$ +6 个月 Shibor $\times 0.5$ 。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 Shibor 利率重新调整鼎利 A 份额的约定年收益率。鼎利 A 份额的约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后 2 位。

目前,一年期整存整取基准年利率为 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%,本月第一个交易日 10 月 8 日的 6 个月 Shibor 利率为 3.3408%,本次开放日后鼎利 A 份额约定收益率将为 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进行相应调整。

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 1.62673119:3。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 份额和鼎利 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,从而引致份额配比变化风险,进而出现杠杆率变动风险。

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》等相关法律文件。

东吴基金管理有限公司

2015年10月21日