

东吴鼎利分级债券型证券投资基金之鼎利 A 份额折算和申购与赎回结果的公告

东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）于 2015 年 10 月 21 日在指定媒体及本公司网站（www.scfund.com.cn）发布了《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》（简称“《开放公告》”）、《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》（简称“《折算公告》”）和《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》（简称“《风险提示公告》”）。2015 年 10 月 23 日为鼎利 A 的第 5 个基金份额折算基准日及开放申购与赎回日，现将相关事项公告如下：

一、本次鼎利 A 的基金份额折算结果

根据《折算公告》的规定，2015 年 10 月 23 日，折算后，鼎利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，鼎利 A 的折算比例为 1.02064329。折算前，鼎利 A 的基金份额总额为 230,137,305.07 份，折算后，鼎利 A 的基金份额总额为 234,888,096.20 份。各基金份额持有人持有的鼎利 A 经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。

投资者自 2015 年 10 月 27 日起（含该日）可在销售机构查询其原持有的鼎利 A 份额的折算结果。

二、本次鼎利 A 开放申购与赎回的确认结果

根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的鼎利 A 的赎回申请全部予以成交确认，据此确认的鼎利 A 赎回总份额为 195,084,286.5 份。

鼎利 B 的份额数为 424,416,720.09 份。根据《基金合同》的规定，本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，鼎利 A 的份额余额原则上不得超过 7/3 倍鼎利 B 的份额余额（即 990,305,680.21 份，下同）。

对于鼎利 A 的申购申请，如果对鼎利 A 的全部有效申购申请进行确认后，鼎利 A 的份额余额小于或等于 7/3 倍鼎利 B 的份额余额，则所有经确认有效的鼎利 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对鼎利 A 的全部有效申购申请进行确认后，鼎利 A 的份额余额大于 7/3 倍鼎利 B 的份额余额，则在经确认后的鼎利 A 份额余额不超过 7/3 倍鼎利 B 的份额余额范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

经本公司统计，2015 年 10 月 23 日，鼎利 A 的有效申购申请总额为 0 元，有效赎回申请总份额为 195,084,286.5 份。本次鼎利 A 的全部有效申购申请经确认后，鼎利 A 的份额余额小于 7/3 倍鼎利 B 的份额余额，为此，基金管理人对全部有效申购申请予以成交确认。

本基金管理人已经于 2015 年 10 月 26 日根据上述原则对本次鼎利 A 的全部申购与赎回申请进行了确认，并为投资者办理了有关份额权益的注册登记变更手续。投资者可于

2015年10月27日起到各销售网点查询申请与赎回的确认情况。投资者赎回申请成功后,本基金管理人将自2015年10月26日起7个工作日内通过相关销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户。

本次鼎利A实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后,本基金的总份额为464,220,529.79份,其中,鼎利A总份额为39,803,809.7份,鼎利B的基金份额未发生变化,仍为424,416,720.09份,鼎利A与鼎利B的份额配比为0.28135421:3。

根据《基金合同》的规定,鼎利A自2015年10月24日起(含该日)的年收益率(单利)根据鼎利A的本次开放日,即2015年10月23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即2015年10月8日的6个月Shibor利率重新调整鼎利优先的约定年收益率进行计算,计算公式为鼎利优先约定年收益率=一年期银行定期存款利率 \times 0.7+6个月Shibor \times 0.5:

$$\text{鼎利A的年收益率(单利)} = 1.75\% \times 0.7 + 3.3408\% \times 0.5 = 2.90\%$$

鼎利A的年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。

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》等相关法律文件。

东吴基金管理有限公司

2015年10月27日