

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额

溢价风险提示公告

近期，东吴基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 B 类份额（场内简称：可转债 B；交易代码：150165）二级市场交易价格较基金份额参考净值的溢价幅度较高，2019 年 3 月 1 日，可转债 B 在二级市场的收盘价为 1.229 元，相对于当日 1.108 元的基金份额参考净值，溢价幅度达到 10.92%。截止 2019 年 3 月 4 日，可转债 B 二级市场的收盘价为 1.351 元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

1、可转债 B 表现为高风险、高收益的特征。由于可转债 B 内含杠杆机制的设计，可转债 B 基金份额参考净值的变动幅度将大于东吴转债份额（场内简称：东吴转债，场内代码：165809）参考净值和东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 A 类份额（场内简称：可转债 A，场内代码：150164）参考净值的变动幅度，即可转债 B 的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。可转债 B 的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、可转债 B 的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

3、截至本公告披露日，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

4、截至本公告披露日，东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

5、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前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书（更新）等相关法律文件。

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

2019 年 3 月 5 日