

中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金之惠裕 A 份额开放申购赎回期间惠裕 B 份额（150114）交易风险提示公告

《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）已于 2013 年 1 月 7 日生效。根据《基金合同》的规定，中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金（场内简称：中海惠裕，基金代码：163907，以下简称“本基金”）自生效之日起 3 年内，基金份额分为惠裕 A 份额（基金代码：163908）和惠裕 B 份额（基金代码：150114）。根据《基金合同》的有关规定，基金合同生效后 3 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，本基金将不再进行基金份额分级，并转换为上市开放式基金（LOF）份额。惠裕 A 自基金合同生效之日起 3 年内起每满 6 个月开放申购与赎回一次。2016 年 1 月 6 日为惠裕 A 的第六个开放日（即基金合同生效后 3 年期届满基金份额转换前的最后一个开放日），接受投资者的申购与赎回。现就惠裕 B 的风险提示如下：

1、惠裕 B 收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定，在惠裕 A 的最后 1 个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定惠裕 A 的年收益率，该收益率适用于该开放日（不含）到基金合同生效后 3 年期届满日（含）的时间段。计算公式为：惠裕 A 的年收益率（单利）=1 年期银行定期存款基准利率+1.4%。

其中，1 年期银行定期存款基准利率为本次惠裕 A 开放日（2016 年 1 月 6 日）中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率，惠裕 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第 2 位。惠裕 A 的约定年收益率按照上述方式调整后，惠裕 B 的收益分配将相应调整。（2016 年 1 月 7 日交易结束前本基金仍划分为惠裕 A、惠裕 B 两级份额。）

根据本基金《基金合同》的规定，本基金基金合同生效后 3 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，本基金将不再进行基金份额分级，并转换为上市开放式基金（LOF）份额，故原持有惠裕 B 的基金份额持有人的风险收益特征将

发生一定的变化。惠裕 B 为较高风险、较高收益的基金份额。在本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额之后，转换后的上市开放式基金（LOF）为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金管理人再次提醒投资者注意基金份额转换后的风险收益特征变化。

2、惠裕 B 杠杆率变动的风险。目前，惠裕 A 与惠裕 B 的份额配比为 0.24639739:3。本次开放日内惠裕 A 的申购赎回可能会引发惠裕 A、惠裕 B 份额配比发生变化，进而导致惠裕 B 份额杠杆率变动风险。

基金管理人将向深圳证券交易所申请惠裕 B 自 2016 年 1 月 4 日上午自开市至 10:30 分停牌 1 小时。本次惠裕 A 实施基金份额折算及开放赎回结束后，本基金管理人将对惠裕 A 基金份额折算及开放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。

中海基金管理有限公司

2016 年 1 月 4 日