

中海惠利纯债分级债券型证券投资基金开放申购与赎回及惠利

A 份额折算结果的公告

中海基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）于 2016 年 6 月 15 日在指定媒体及本公司网站（www.zhfund.com）发布了《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金开放申购和赎回业务公告》（简称“《开放公告》”）和《中海惠利纯债分级债券型证券投资基金之惠利 A 份额折算方案的公告》（简称“《折算公告》”）。2016 年 6 月 20 日为第二运作周期内惠利 A 的第 1 个赎回开放日和惠利 B 的第 1 个申购、赎回开放日，2016 年 6 月 21 日为惠利 A 的第 1 个基金份额折算基准日及申购开放日，现将相关事项公告如下：

一、本次惠利 A 的基金份额折算结果

根据《折算公告》的规定，2016 年 6 月 21 日，惠利 A 的基金份额净值为 1.018 元，据此计算的惠利 A 的折算比例为 1.018，折算后，惠利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人原来持有的每 1 份惠利 A 相应增加至 1.018 份。折算前，惠利 A 的基金份额总额为 34,691,262.64 份，折算后，惠利 A 的基金份额总额为 35,315,705.37 份。各基金份额持有人持有的惠利 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。具体份额以注册登记机构的确认结果为准。

投资者自 2016 年 6 月 23 日起（含该日）可在销售机构查询其原持有的惠利 A 份额的折算结果。

二、本次惠利 A 和惠利 B 开放申购与赎回的确认结果

根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的惠利 A 的赎回申请全部予以成交确认，2016 年 6 月 20 日，惠利 A 的基金份额净值为 1.018 元，据此确认的惠利 A 赎回及转换出的总份额为 55,343,451.52 份。

根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的惠利 B 的申购和赎回申请全部予以成交确认，2016 年 6 月 20 日，惠利 B 的基金份额净值为 1.021 元，据此确认的惠利 B 申购及转换入所得份额数为 155,300,932.99 份，惠利 B 赎回总份额为 46,418,752.82 份。最终惠利 B 实际份额总份额为 2,338,806,175.02 份。

根据《基金合同》的规定，本基金在分级运作期内，惠利 A 的份额余额原则上不得超过 7/3 倍惠利 B 的份额余额（即 5,457,214,408.38 份，下同）。

对于惠利 A 的申购申请，如果对惠利 A 的全部有效申购申请进行确认后，惠利 A 的份额余额小于或等于 7/3 倍惠利 B 的份额余额，则所有经确认有效的惠利 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对惠利 A 的全部有效申购申请进行确认后，惠利 A 的份额余额大于 7/3 倍惠利 B 的份额余额，则在经确认后的惠利 A 份额余额不超过 7/3 倍惠利 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，2016 年 6 月 20 日，惠利 A 的有效赎回及转换出申请总份额为 55,343,451.52 份，惠利 B 的有效赎回申请总份额为 46,418,752.82 份，惠利 B 的有效申购及转换入申请所得总份额为 155,300,932.99 份，2016 年 6 月 21 日，惠利 A 的有效申购申请总额为 5,397,869,203.14 元，转换入份额为 215,087.00 份。本次惠利 A 的全部有效申购及转换入申请经确认后，惠利 A 的份额余额将小于 7/3 倍惠利 B 的份额余额，为此，基金管理人对于全部有效申购申请予以成交确认。

本基金管理人已经于 2016 年 6 月 21 日根据上述原则对本次惠利 A 和惠利 B 的赎回申请进行了确认，6 月 22 日根据上述原则对本次惠利 A 的全部申购申请进行了确认，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 2016 年 6 月 23 日起到各销售网点查询申购与赎回的确认情况。投资者赎回申请成功后，本基金管理人将自 2016 年 6 月 20 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。

本次开放申购与赎回及惠利 A 实施基金份额折算后，本基金的总份额为

7,772,206,170.53 份，其中，惠利 A 总份额为 5,433,399,995.51 份，惠利 B 总份额为 2,338,806,175.02 份，惠利 A 与惠利 B 的份额配比为 2.32315104:1。

根据《基金合同》的规定，惠利 A 自 2016 年 6 月 21 日起（不含该日）的年约定收益率（单利）根据惠利 A 的本次申购开放日，即 2016 年 6 月 21 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 1.5%+利差（2.3%）进行计算，故：

惠利 A 的年约定收益率（单利）=1.5%+2.3%=3.8%

惠利 A 的年约定收益率以百分数形式表示，其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。

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。

中海基金管理有限公司

二〇一六年六月二十三日