

# 中海基金管理有限公司关于中海惠丰纯债分级债券型证券投资

## 基金之惠丰 A 份额开放申购与赎回期间惠丰 B 份额

### ( 150154 ) 交易风险提示公告

中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同已于 2015 年 9 月 28 日进入第二个运作周期。本基金在分级运作期内，基金份额划分为惠丰 A（基金代码：163910）、惠丰 B（基金代码：150154）两级份额，两者的份额配比原则上不超过 7：3。本基金为惠丰 A 设立约定年收益率，基金的资产净值将优先满足惠丰 A 的本金及约定收益，剩余的基金资产归惠丰 B 享有。根据《基金合同》的规定，本基金在分级运作期内，惠丰 A 自分级运作周期起始日起每 6 个月开放一次，惠丰 B 封闭运作并上市交易。2016 年 9 月 27 日为惠丰 A 第 2 个开放赎回日，2016 年 9 月 28 日为惠丰 A 基金份额折算基准日及第 2 个开放申购日。现就惠丰 B 的风险提示如下：

1、惠丰 B 份额收益分配变化的风险。惠丰 A 份额根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个分级运作周期起始日及每个申购开放日（最后 1 个申购开放日除外）设定一次并公告。计算公式为：惠丰 A 份额的年约定收益率（单利）=1 年期银行定期存款基准利率（税前）+利差

其中，1 年期银行定期存款基准利率为本次申购开放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，利差的取值为 2.1%，该收益率即为惠丰 A 份额接下来 6 个月的年收益率，适用于该申购开放日（不含）到下个申购开放日（含）的时间段。惠丰 A 份额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。

惠丰 A 份额的约定年收益率按照上述方式调整后，惠丰 B 份额的收益分配将相应调整。

2、惠丰 B 份额杠杆率变动的风险。目前，惠丰 A 与惠丰 B 的份额配比为 6.97357326：3。本次惠丰 A 实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，基金管理人按照经确认后的惠丰 A 份额不超过 7/3 倍惠丰 B 的份额范围内，对全部有效申购申请进行成交确认。如果确认的惠丰 A 份额申购申请数量与赎回申请数量不一致，惠丰 A 的规模将相应变化，从而引发惠丰 A、惠丰 B 份额配比发生变化，进而导致惠丰 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丰 B 自 2016 年 9 月 23 日上午 9：30 分至 10：30 分停牌 1 小时，2016 年 9 月 27 日至 2016 年 9 月 29 日停牌 3 天。本次惠

丰 A 实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，本基金管理人将对惠丰 A 基金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。

中海基金管理有限公司

2016 年 9 月 23 日