

# 中欧基金管理有限公司关于中欧纯债添利分级债券型证券投资

## 基金之添利 A 开放赎回期间添利 B 风险提示公告

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同已于 2013 年 11 月 28 日生效。本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额划分为添利 A（基金代码：166022）、添利 B（基金代码：150159），两者份额配比原则上不超过 7:3，本基金为添利 A 设定约定收益率，基金的资产净值将优先满足添利 A 的本金及约定收益，剩余的基金资产归添利 B 享有。

根据《基金合同》规定，本基金以添利 B 的 3 年封闭期为一个运作周期，按运作周期滚动运作。本基金的第一个运作周期起始日为添利 B 首个封闭运作期起始日即基金合同生效之日，第一个运作周期终止日为添利 B 首个封闭运作期终止日，即自添利 B 首个封闭运作期起始日起累计运作时长达到 3 年的对应日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日，即 2016 年 11 月 25 日为添利 B 的首个封闭运作周期到期日及添利 A 的赎回开放日、添利 B 的申购赎回开放日，同时为添利 A 和添利 B 份额折算基准日。现就添利 B 的风险提示如下：

1、添利 B 份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定，添利 B 的每个封闭运作终止日之后的一个工作日起，进入过渡期，直到添利 B 的下一个封闭运作起始日前的一个工作日止，过渡期结束。其中添利 A 在过渡期内的约定收益率，以过渡期起始日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币活期存款基准利率确定，按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位。添利 A 份额的约定年化收益率按照上述方式调整后，添利 B 份额的收益分配将相应调整。

2、添利 B 杠杆率变动的风险。目前，添利 A 与添利 B 的份额配比为 4.07695148:3。本次添利 A 实施基金份额折算、开放赎回以及添利 B 实施基金份额开放申购、赎回和折算结束后，添利 A 和添利 B 的规模相应变动，从而引发添利 A、添利 B 份额配比发生变化，进而导致添利 B 份额杠杆率变动风险。

3、本次添利 A、添利 B 实施基金份额折算及开放申购赎回结束后，本基金管理人将对添利 A、添利 B 基金份额折算、开放申购赎回结果进行公告。

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。

中欧基金管理有限公司

2016年11月23日