

# 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

## 基金运作周期到期及过渡期安排的公告

中欧基金管理有限公司旗下基金中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（基金主代码：166021，以下简称“本基金”；中欧纯债添利分级债券型证券投资基金 A，基金代码：166022，以下简称“添利 A”；中欧纯债添利分级债券型证券投资基金 B，基金代码：150159，以下简称“添利 B”）于 2013 年 11 月 28 日成立。根据《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的相关规定，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。第一个运作周期到期日为 2016 年 11 月 25 日。

根据《基金合同》的相关规定，添利 B 的每个封闭运作终止日之后的第一个工作日起（含），本基金将安排不超过 5 个工作日的过渡期。过渡期末，若添利 B 的基金资产净值等于或小于 1500 万元，经基金管理人与基金托管人协商一致，无须召开基金份额持有人大会，基金管理人有权决定终止本基金的运作，不再进入下一个的添利 B 封闭运作期，并根据基金合同第二十二部分的约定进行基金财产清算。不满足上述条件时，本基金将进入下一个运作周期。

本次过渡期的开始时间为 2016 年 11 月 28 日（含），终止日期暂定为 2016 年 12 月 1 日（含）。基金管理人可以在合同约定的过渡期限内，根据过渡期的实际情况选择延长或提前终止过渡期，具体参见届时基金管理人发布的公告。

本基金管理人已于 2016 年 11 月 18 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和中欧基金管理有限公司网站（www.zofund.com）上刊登了《关于中欧纯债添利分级债券型证券投资基金运作周期到期及过渡期安排相关提示性公告》。为了保障本基金份额持有人利益，现发布本基金运作周期到期及过渡期安排的公告。

一、本基金第一个运作周期到期及过渡期相关安排说明如下：

1、2016 年 11 月 25 日为第一个运作周期到期日。在运作周期内，添利 A 自添利 B 的封闭运作起始日起每满半年开放一次，接受投资人的申购与赎回，在添利 B 的每个封闭运作终止日当天开放一次，接受投资人的赎回，但不接受投资人的

申购。在运作周期内除添利 A 的开放日以外的时间本基金不接受添利 A 申购与赎回申请。即 2016 年 11 月 25 日为添利 A 第 6 次开放日，当日仅开放添利 A 的赎回。

添利 A 的基金份额折算基准日与第 6 次赎回开放日为同一天，即 2016 年 11 月 25 日为添利 A 的折算基准日。

2、添利 B 在每个封闭运作终止日当天开放一次，接受投资人的申购与赎回。添利 B 的开放日与折算基准日、封闭期届满日为同一日，即 2016 年 11 月 25 日。开放日即折算基准日当天，接受投资人的申购和赎回。同时折算日日终，添利 B 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的添利 B 的份额数按照折算比例相应增减。

3、添利 A 和添利 B 的折算方案详见基金管理人发布的《折算方案公告》。

## 二、本基金第一个过渡期相关安排

本次过渡期的起始日为 2016 年 11 月 28 日（含），终止日暂定为 2016 年 12 月 1 日（含）。

### 1、过渡期内添利 A、添利 B 的份额配比

在办理过渡期申购时，基金管理人有权根据基金份额上限和两类份额配比进行规模控制；其中，过渡期内添利 A、添利 B 基金份额配比不超过 7：3。

### 2、过渡期的时间安排

添利 B 的每个封闭运作终止日之后的第一个工作日起（含），本基金将安排不超过 5 个工作日的过渡期。即 2016 年 11 月 28 日（含）为过渡期起始日，终止日暂定为 2016 年 12 月 1 日（含）。

过渡期包括基金份额申购、赎回和折算确认日、添利 A 的申购开放期及添利 A 的折算日三个阶段。

其中过渡期的第一个工作日为基金份额申购、赎回和折算确认日。即在 2016 年 11 月 28 日为添利 A 赎回、添利 B 申购赎回和折算确认日。登记机构及基金管理人为本基金份额持有人办理申购、赎回及折算后的添利 A 和添利 B 的登记确认，申购、赎回和折算确认日当日不接受申购与赎回。其中，基金管理人将以添利 B 开放期结束后的添利 B 份额为基准，决定是否开放添利 A 的申购。如果在添利 A 申购期起始前，添利 A 的份额余额小于 7/3 倍的添利 B 开放期末的份额余额，则开放添利 A 的过渡期申购，添利 A 的申购期为 2016 年 11 月 29 日至 2016 年 12 月 1 日，添利 A 过渡期申购的确认规则详见基金管理人届时的相关公告；如果在添利 A 申购期起始前，添利 A 的份额余额已经大于或等于 7/3 倍的添利 B 开放

期末的份额余额，则不再开放添利 A 的过渡期申购，并按添利 A 和添利 B 两级份额配比不超过 7:3 的原则，对全部添利 A 持有人份额进行调整，超出部分通过强制赎回以现金形式返还投资者。

如果开放添利 A 过渡期申购，则过渡期的终止日为 2016 年 12 月 1 日（含）；如果未开放添利 A 过渡期申购，则过渡期的终止日调整为 2016 年 11 月 29 日。过渡期终止日当日基金管理人将对添利 A 进行第二次折算，折算日日终，添利 A 的基金份额净值调整为 1.000。

过渡期结束后的第一个工作日起，本基金进入第二个运作周期。本基金过渡期内不开放添利 A 的赎回及添利 B 的申购和赎回。

### 3、添利 A 过渡期年约定收益率

根据《基金合同》约定，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。

### 4、过渡期的基金运作安排

（1）过渡期内，基金管理人停收管理费，基金托管人停收托管费；

（2）过渡期结束后的下一工作日为添利 A 约定年化收益率起算日，即添利 B 新的封闭运作期起始日；

（3）2016 年 11 月 25 日至 2016 年 12 月 1 日本基金暂停办理转托管业务。

### 5、过渡期本基金基金份额参考净值的计算

设第 T 日为基金份额参考净值计算日， $T_a$  为自过渡期起始日（若之前进行了份额折算，则为基金折算基准日）至 T 日的运作天数， $NV_t$  为 T 日闭市后的基金资产净值， $F_a$  为 T 日添利 A 的份额余额， $F_b$  为 T 日添利 B 的份额余额， $NAV_a$  为第 T 日添利 A 的基金份额参考净值， $NAV_b$  为第 T 日添利 B 的基金份额参考净值，添利 A 的约定年收益率  $R_a$ ，运作当年实际天数设定为 Y，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

其中， $R_a$  为添利 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。

第 T 日，添利 A、添利 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

（1）当  $NV_t < F_a \times 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y)$  时，则添利 A 与添利 B 在第 T 日的基金份额参考净值为：

$$NAV_a = NV_t / F_a;$$

$$NAV_b = 0;$$

（2）当  $F_a \times 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y) \leq NV_t$  时，则添利 A 与添利 B 在第 T 日基金

份额参考净值为：

$$NAV_a = 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y) ;$$

$$NAV_b = (NV_t - NAV_a \times F_a) / F_b ;$$

### 三、重要提示

1、本次运作周期到期日，即 2016 年 11 月 25 日为添利 A、添利 B 的开放日，当日添利 A 仅开放赎回、添利 B 开放申购和赎回。

2、添利 A 在过渡期内的约定收益率适用 2016 年 11 月 28 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。

3、过渡期包括基金份额申购、赎回和折算确认日、添利 A 的申购开放期及添利 A 的折算日三个阶段。基金份额申购、赎回和折算确认日，即 2016 年 11 月 28 日不接受申购与赎回；基金管理人将以添利 B 开放期结束后的添利 B 份额余额为基准，决定是否开放添利 A 的过渡期申购。

添利 A 的申购期暂定为 2016 年 11 月 29 日至 2016 年 12 月 1 日，如果在添利 A 申购期起始前，添利 A 的份额余额已经大于或等于 7/3 倍的添利 B 开放期末的份额余额，则不再开放添利 A 的过渡期申购，并按添利 A 和添利 B 两级份额配比不超过 7:3 的原则，对全部添利 A 持有人份额进行调整，超出部分通过强制赎回以现金形式返还投资者。如果在添利 A 申购期起始前，添利 A 的份额余额小于 7/3 倍的添利 B 开放期末的份额余额，则开放添利 A 的过渡期申购。

过渡期结束后的第一个工作日起，本基金进入第二个运作周期。本基金过渡期内不开放添利 A 的赎回及添利 B 的申购和赎回。

4、过渡期内，基金管理人停收管理费，基金托管人停收托管费

5、运作到期日期间未发起赎回申请的基金份额持有人默认进入下一个运作周期，将自行承担运作周期到期日（不含）至过渡期最后一日（含）期间的基金份额净值下跌风险。

6、过渡期期间，过渡期申购的基金份额持有人将自行承担申购日（不含当日）至过渡期最后一日（含）期间的基金份额净值波动风险。

### 四、其他事项。

1、本公告仅对中欧纯债添利分级债券型证券投资基金运作周期到期及转入下一运作周期的有关事项和规定予以说明，其它未说明的事项遵循基金合同和招募说明书的规定。投资者欲了解本基金的详细情况，请登陆中欧基金管理有限公司网站（[www.zofund.com](http://www.zofund.com)）阅读本基金的基金合同、招募说明书及其更新。

2、基金管理人可综合各种情况对运作周期到期及转入下一运作周期的安排做适当调整，如有调整，具体参见基金管理人的相关公告。

3、本基金份额持有人及希望了解本基金其他有关信息的投资者，可以登录本基金管理人网站（<http://www.zofund.com>）或拨打客户服务电话（400-700-9700）咨询相关事宜。

4、本公告解释权归基金管理人。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。

投资者申请使用网上交易业务前，应认真阅读有关网上交易协议、相关规则，了解网上交易的固有风险，投资者应慎重选择，并在使用时妥善保管好网上交易信息，特别是账号和密码。

特此公告。

中欧基金管理有限公司

2016年11月23日