

# 中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金转型份额转换与变更登记的公告

中欧鼎利分级债券型证券投资基金（以下简称中欧鼎利分级债券基金或本基金）的基金合同于 2011 年 6 月 16 日生效，本基金的基金份额包括中欧鼎利分级债券型证券投资基金之基础份额，（以下简称中欧鼎利分级债券份额，基金代码：166010，场内简称中欧鼎利）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金 A 份额（以下简称鼎利 A 份额，基金代码：150039，场内简称鼎利 A）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金 B 份额（以下简称鼎利 B 份额，基金代码：150040，场内简称鼎利 B）。

根据《中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》和《中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金实施转型的提示性公告》，中欧基金管理有限公司（以下简称基金管理人）决定对中欧鼎利分级债券基金进行基金份额转换与变更登记，转型为中欧鼎利债券型证券投资基金（以下简称中欧鼎利债券基金）。基金份额转换由基金管理人办理，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记，并提示实施转型的其他事项如下：

## 一、基金份额转换和变更登记

1、基金转换基准日：2017 年 9 月 15 日

2、转换对象：转换基准日登记在册的中欧鼎利分级债券份额、鼎利 A 份额、鼎利 B 份额。

## 3、基金份额的转换

### （1）转换前基金份额净值的计算

1) 转换前中欧鼎利分级债券份额的基金份额净值计算

转换前中欧鼎利分级债券份额的基金份额净值=转换基准日的基金资产净值 / 转换基准日本基金的基金份额（包括中欧鼎利分级债券份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额）余额总数。

2) 转换前鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值计算

转换基准日为上一折算日后第 t 个自然日，中欧鼎利分级债券份额、鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值分别为 NAV<sub>t</sub>、NAV(A)<sub>t</sub>、NAV(B)<sub>t</sub>，上一折算日次日的一年期银行定存利率为 R。转换前鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的基金份额净值计算如下：

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 1\%) \cdot t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.7NAV(A)_t) / 0.3$$

### （2）基金份额转换公式

本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：

1) 将鼎利 A 份额与鼎利 B 份额转换成中欧鼎利分级债券份额的场内份额。

在份额转换基准日日终，以中欧鼎利分级债券份额的基金份额净值为基准，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额按照各自的基金份额净值转换成中欧鼎利分级债券份额的场内份额。鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）基金份额持有人持有的转换后中欧鼎利分级债券份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的转换比率 = 份额转换基准日鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的基金份额净值 / 份额转换基准日中欧鼎利分级债券份额的基金份额净值

鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）基金份额持有人持有的转换后中欧鼎利分级债券份额的场内份额数 = 基金份额持有人持有的转换前鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的份额数 × 鼎利 A 份额（或鼎利 B 份额）的转换比率

2) 将中欧鼎利分级债券份额转换成中欧鼎利债券基金份额，中欧鼎利债券基金份额数 = 中欧鼎利分级债券份额数。

### （3）基金份额转换结果的公告

本基金此次份额转换结果及注册登记机构变更登记完成后，基金管理人将在指定媒介对份额转换结果予以公告。

如果基金份额转换过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额转换与变更登记。

## 二、修订后基金合同等法律文件的生效及基金名称的变更

根据《关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》、《中欧基金管理有限责任公司关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》、《中欧鼎利分级债券型证券投资基金托管协议》分别修订为《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》、《中欧鼎利债券型证券投资基金托管协议》，并据此编制《中欧鼎利债券型证券投资基金招募说明书》。中欧鼎利分级债券型证券投资基金已经中国证监会证监许可[2017]1044号《关于准予中欧鼎利分级债券型证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册。《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》、《中欧鼎利债券型证券投资基金托管协议》将自中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金份额转换基准日的次一工作日，即2017年9月18日起生效，同日，中欧鼎利分级债券型证券投资基金正式更名为中欧鼎利债券型证券投资基金。

## 三、中欧鼎利分级债券、中欧鼎利债券基金份额的申购赎回安排

因中欧鼎利分级债券型证券投资基金实施转型，本基金将自2017年9月15日起暂停办理场外申购、场内赎回、场外赎回、定期定额投资、转换、跨系统转托管（场内转场外）业务（场内申购、场外转场内业务已于2017年6月14日暂停，详见2017年6月13日发布的公告），并自2017年9月15日起终止办理中欧鼎利分级债券份额、鼎利A份额、鼎利B份额三类份额间的配对转换业务。转型为中欧鼎利债券型证券投资基金后的申购（仅限场外）、赎回、转换、定投、跨系统转托管（仅限场内转场外）将于2017年9月19日开始办理。

## 四、关于转型后场内基金份额后续安排

自《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》生效的次一交易日起三个月内，即2017年9月19日至2017年12月18日期间，持有中欧鼎利债券型证券投资基金场内份额的基金份额持有人，可以进行场内赎回，或进行场外开户和跨系统转托管（仅限场内转场外）从而将中欧鼎利债券型证券投资基金场内份额转换为中欧鼎利债券型证券投资基金场外份额。《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》生效后三个月后，关闭场内赎回、场内份额的跨系统转托管业务，原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额，将转登记至本基金管理人开立的中国证券登记结算有限责任公司场外基金账户上，届时仍持有中欧鼎利债券型证券投资基金场内份额余额的投资人，需根据基金管理人届时发布的相关公告，对其持有的基金份额进行重新确认与登记，此过程即为确权，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。

## 五、对基金份额持有人的影响及基金风险发生变化的提示

本基金转型前后，原鼎利A份额和鼎利B份额的份额持有人持有基金份额的风险收益特征将发生较大变化，由持有低风险收益特征的鼎利A份额或较高风险收益特征的鼎利B份额变为持有中欧鼎利份额。转型后，本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和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。

本基金转型后不在交易所上市交易。

特此公告。

中欧基金管理有限公司

2017年9月12日