

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

运作周期到期及转入下一运作周期的相关规则公告

中海基金管理有限公司旗下中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金（基金代码：163909；以下简称：本基金；中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金 A：基金代码：163910；以下简称：惠丰 A；中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金 B：基金代码：150154；以下简称：惠丰 B）于 2013 年 9 月 12 日成立。根据《中海惠丰纯债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 2 年为一个运作周期，按运作周期滚动的方式运作。本基金于 2015 年 9 月 11 日结束第一个运作周期，并自 2015 年 9 月 28 日起进入第二个运作周期，第二个运作周期到期日为本运作周期起始日的 2 个公历年后对应工作日，即为 2017 年 9 月 28 日。

根据《基金合同》的相关规定，运作周期到期后的次日起（含），本基金将安排不超过 10 个工作日的过渡期。基金管理人在过渡期内办理本基金的赎回等事宜。本次过渡期的时间为 2017 年 9 月 29 日（含）至 2017 年 10 月 19 日（含）。2017 年 10 月 20 日为本基金第三个运作周期起始日。

本基金第二个运作周期到期及过渡期操作规则说明如下：

一、本基金第二个运作周期到期操作规则

1、2017 年 9 月 28 日为第二个运作周期到期日。在分级运作周期内，惠丰 A 自分级运作周期起始日起每 6 个月开放一次，接受申购与赎回申请（第 4 次开放日不开放申购，只开放赎回）；每个分级运作周期的第 4 个惠丰 A 的开放日只开放赎回，开放日为分级运作周期到期日。在分级运作周期内除惠丰 A 的开放日以外的时间本基金不接受惠丰 A 的申购与赎回申请。即 2017 年 9 月 28 日为惠丰 A 第 4 次开放日，当日仅开放惠丰 A 的赎回。

惠丰 A 的赎回价格以惠丰 A 份额的赎回开放日的基金份额净值为基础进行计算。惠丰 A 不收取赎回费用。

2、惠丰 B 的封闭期自分级运作周期起始之日起至 2 个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日或该公历年不存在对应日，则封闭期届满日为该日之前的最后一个工作日。惠丰 B 的基金份额折算日与其封闭期届满日为同一日，即 2017 年 9 月 28 日。折算日日终，惠丰 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惠丰 B 的份额数按照折算比例相应增减。

3、惠丰 A 的基金份额折算日与前 3 个惠丰 A 的申购开放日为同一个工作日，与第 4 个惠丰 A 的赎回开放日为同一个工作日。即 2017 年 9 月 28 日为惠丰 A 的折算日。

4、惠丰 A 和惠丰 B 的折算方案详见基金管理人发布的《折算方案公告》。

二、本基金第二个过渡期操作规则

本次过渡期的时间为 2017 年 9 月 29 日（含）至 2017 年 10 月 19 日（含）。

1、过渡期内惠丰 A、惠丰 B 的份额配比

在过渡期内，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，过渡期内惠丰 A、惠丰 B 的份额配比不超过 73。

2、过渡期的时间安排

第二个运作周期到期后的次日起（含），本基金将安排不超过 10 个工作日的过渡期，即 2017 年 9 月 29 日（含）至 2017 年 10 月 19 日（含）。

过渡期依次包括份额折算确认日、惠丰 B 的开放期两个阶段。

其中过渡期的第一个工作日为份额折算确认日，即 2017 年 9 月 29 日为惠丰 A、惠丰 B 的份额折算确认日。登记机构及基金管理人将为本基金份额持有人办理折算后的惠丰 A 和惠丰 B 的登记确认，份额折算确认日不接受申购与赎回。

自过渡期的第二个工作日起本基金将进入惠丰 B 的开放期，即本次过渡期安排 2017 年 10 月 9 日（含）至 2017 年 10 月 19 日（含）为惠丰 B 的开放期，仅开放惠丰 B 的赎回。惠丰 B 的开放期结束后，将不再开

放惠丰 A 的申购。基金管理人将以惠丰 B 的开放期结束后的惠丰 B 余额为基准，如果惠丰 A 的份额余额已经大于或等于 7/3 倍的惠丰 B 开放期末的份额余额，将按惠丰 A 和惠丰 B 两级份额配比不超过 7:3 的原则，对全部惠丰 A 按比例进行确认，超出部分以现金形式返还投资者。

过渡期结束后第一个工作日（即 2017 年 10 月 20 日）起，本基金进入第三个分级运作周期。本基金过渡期内不开放惠丰 A 的赎回（惠丰 A 的赎回只能在开放日，即 2017 年 9 月 28 日进行）。

3、过渡期基金份额的赎回原则

（1）基金份额赎回采用未知价原则，即赎回价格以申请当日收市后计算的对应基金份额净值为基准进行计算；

（2）基金份额根据份额赎回的原则，即赎回以份额申请；

（3）基金份额的当日的赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。基金管理人、登记机构或证券交易所另有规定的，从其规定；

（4）基金份额持有人可将其全部或部分惠丰 A 或惠丰 B 赎回，单笔赎回不得少于 1 份。某笔赎回导致基金份额持有人在某一销售机构全部交易账户的惠丰 A 或惠丰 B 余额少于 1 份的，基金管理人有权将该基金份额持有人在销售机构托管的该类基金剩余份额一次性全部赎回。各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（5）投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

惠丰 A 和惠丰 B 的销售机构可能不同，具体销售方式和销售机构详见本招募说明书及相关公告。

4、过渡期赎回的费用

在过渡期的惠丰 B 的开放期内进行惠丰 B 的赎回，不收取赎回费用。

5、过渡期内赎回的程序

（1）赎回的申请方式

在过渡期内，基金投资者必须在惠丰 B 的开放期的业务办理时间提出赎回申请。

投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

（2）赎回申请的成交确认原则

过渡期的惠丰 B 的开放期内，对于惠丰 B 赎回申请，所有经确认有效的赎回申请全部予以成交确认。

6、赎回金额的计算

（1）本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（2）赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率为 0。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

7、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，销售机构停收销售服务费；

（2）过渡期结束后的下一工作日为惠丰 A 约定年化收益率起算日，即第三个分级运作周期起始日；

（3）惠丰 B 自过渡期起始日开始停牌，并在下一个分级运作周期开始后 1 个月内申请在深圳证券交易所复牌；

（4）2017 年 9 月 27 日至 2017 年 10 月 9 日本基金暂停办理跨系统转托管业务。

8、过渡期内惠丰 A 和惠丰 B 的基金份额净值计算

在过渡期内，惠丰 A 不再获取约定收益，两级份额同涨同跌、各负盈亏。

T 日惠丰 A 份额净值 = T 日中海惠丰纯债分级债券型基金资产净值 / ($T-1$ 日惠丰 A 份额资产净值 / $T-1$ 日中海

惠丰纯债分级债券型基金资产净值)/T日惠丰 A 份额数

T日惠丰 B 份额净值=T日中海惠丰纯债分级债券型基金资产净值(T-1日惠丰 B 份额资产净值/T-1日中海惠丰纯债分级债券型基金资产净值)/T日惠丰 B 份额数

惠丰 A 份额、惠丰 B 份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

三、重要提示

1、本次分级运作周期到期日(含)至过渡期最后一日(含)期间不开放惠丰 A 及惠丰 B 的申购业务。

本次分级运作周期到期日，即 2017 年 9 月 28 日为惠丰 A 第 4 次开放日，当日仅开放惠丰 A 的赎回。

本次过渡期依次包括份额折算确认日和惠丰 B 的开放期两个阶段。份额折算确认日，即 2017 年 9 月 29 日不接受申购与赎回；本次过渡期安排 2017 年 10 月 9 日(含)至 2017 年 10 月 19 日(含)为惠丰 B 的开放期，在此期间仅开放惠丰 B 的赎回。惠丰 B 的开放期结束后，将不再开放惠丰 A 的申购。

过渡期结束后第一个工作日(即 2017 年 10 月 20 日)起，本基金进入第三个分级运作周期。本基金过渡期内不开放惠丰 A 的赎回(惠丰 A 的赎回只能在开放日进行)。

2、过渡期内，基金管理人停收管理费，基金托管人停收托管费，销售机构停收销售服务费。

3、过渡期期间，默认进入下一个运作周期的基金份额持有人将自行承担分级运作周期到期日(不含)至过渡期最后一日(含)期间的基金份额净值下跌风险。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2017 年 10 月 9 日惠丰 B 即时行情显示的前收盘价将调整为 2017 年 9 月 29 日惠丰 B 的基金份额参考净值，至惠丰 B 复牌前及惠丰 B 复牌不再进行前收盘价调整。

5、本基金若连续 20 个工作日基金资产规模低于 3000 万元，根据《基金合同》的约定，本基金将进入终止基金合同的有关程序。

四、本基金的销售机构

1、直销机构

(1) 中海基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：杨皓鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788(免长途话费)或 021-38789788

公司网址：www.zhfund.com

(2) 中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

负责人：李想

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：郑健

客户服务电话：400-888-9788(免长途话费)

公司网站：www.zhfund.com

2、其他销售机构(排名不分先后)

(1) 场外代销机构

广发银行股份有限公司(仅代销 A 类份额)、中国工商银行股份有限公司(仅代销 A 类份额)、中国农业银行

股份有限公司(仅代销 A 类份额)、交通银行股份有限公司(仅代销 A 类份额)、招商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、国联证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、国金证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、国海证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中信期货有限公司、华西证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、联讯证券股份有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、中国民族证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、北京电盈基金销售有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、众升财富(北京)基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司(仅代销 A 类份额)、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中期资产管理有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、泰诚财富基金销售(大连)有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京虹点基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司、奕丰金融服务(深圳)有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、北京广源达信基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、北京懒猫金融信息服务有限公司、一路财富(北京)信息科技有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、上海攀赢金融信息服务有限公司、凤凰金信(银川)基金销售有限公司、上海云湾投资管理有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、北京肯特瑞财富管理公司及上海朝阳永续基金销售有限公司。

(2) 场内代销机构

惠丰 B 办理场内申购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员,具体包括:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、开源证券、万联证券、五矿证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在惠丰 B 上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与惠丰 B 的上市交易。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

五、其他事项

1、本公告仅对中海惠丰纯债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,请登陆中海基金管理有限公司网站(www.zhfund.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。
- 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.zhfund.com>）或拨打客户服务电话（400-888-9788）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

中海基金管理有限公司

2017年9月25日