

# 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

## 运作周期到期后惠丰 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 2013 年 9 月 12 日生效。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。2017 年 9 月 28 日为本基金的运作周期到期日及惠丰 A 的赎回开放日，同时为惠丰 A 和惠丰 B 份额折算基准日。现就惠丰 B 的风险提示如下：

1、惠丰 B 收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定，基金管理人将于每个分级运作周期起始日针对分级运作周期起始日（含）到惠丰 A 第 1 个申购开放日（含）的时间段惠丰 A 的约定年收益率进行设定并公告。计算公式为：惠丰 A 的年收益率（单利）=1 年期银行定期存款基准利率+2.1%。

其中，1 年期银行定期存款基准利率为分级运作周期起始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，惠丰 A 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 的约定年收益率按照上述方式调整后，惠丰 B 的收益分配将相应调整。

2、惠丰 B 杠杆率变动的风险。目前，惠丰 A 与惠丰 B 的份额配比为 0.122167803。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。过渡期内惠丰 A、惠丰 B 的赎回可能会引发惠丰 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 2017 年 9 月 25 日上午 9:30 分至 10:30 分停牌 1 小时，2017 年 9 月 28 日起开始停牌，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。

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。

本基金实施基金份额折算及开放赎回结束后，本基金管理人将对本基金份额折算及开放赎回的结果进行公告。同时，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。

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

2017 年 9 月 25 日