

关于汇添富互利分级债券型证券投资基金之互利债 A 基金份额开放 申购、赎回期间互利债 B 基金份额风险提示性公告

汇添富互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 6 日生效。根据本基金基金合同的规定,本基金基金份额分为互利 A 份额(场内简称:互利债 A,基金代码:164704)和互利 B 份额(场内简称:互利债 B,基金代码:150142)两级份额,两级份额的份额配比原则上不超过 7:3,互利债 A 份额获得应计约定收益,互利债 B 份额获得扣除互利债 A 份额本金和应计约定收益后的基金剩余净资产。本基金 3 年为一个分级运作周期,在每个分级运作周期内,互利债 A 份额自分级运作期起始日起每满 6 个月开放一次,接受申购与赎回申请,并于开放日对基金份额进行折算。2015 年 11 月 5 日为互利债 A 份额第四个开放日及基金份额折算基准日。现就相关事项提示如下:

1、互利债 B 份额收益分配变化的风险。根据本基金基金合同的规定,互利债 A 的年收益率将在每个开放日设定一次并公告。互利债 A 在本次开放日后的年收益率将根据互利债 A 的本次开放日,即 2015 年 11 月 5 日中国人民银行最新公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率重新设定互利债 A 的约定年收益率,该收益率即为互利债 A 在接下来 6 个月的年收益率,适用于该开放日(不含)到下一个开放日(含)的时间段。

计算公式如下:互利债 A 的年收益率(单利)=互利债 A 约定年收益率=一年期银行定期存款利率(税后)×1.1+利差。

利差的取值范围从 0%(含)到 2%(含),本次利差为 1.35%。

目前,1 年期银行定期存款利率为 1.50%,如果 2015 年 11 月 5 日执行的 1 年期银行定期存款基准利率仍为 1.50%,本次开放日后互利债 A 年收益率为 3.00%。

若 2015 年 11 月 5 日执行的 1 年期银行定期存款基准利率有所变动,则互利债 A 份额的年约定收益率将按上述方式进行调整,互利债 B 份额的收益分配也将进行相应调整。

2、互利债 B 份额杠杆率变动的风险。目前,互利债 A 份额与互利债 B 份

额的份额配比为 0.20: 1。本次互利债 A 份额开放申购、赎回并实施基金份额折算后，互利债 A 份额的份额余额原则上不得超过 7/3 倍互利债 B 份额的份额余额。如果互利债 A 份额的申购申请小于赎回申请，互利债 A 份额的份额规模将缩减，从而引致份额配比变化风险，进而出现杠杆率变动风险等。

基金管理人已向深圳证券交易所申请互利债 B 份额于 2015 年 11 月 3 日开市停牌一小时，当日 10: 30 复牌交易；于 2015 年 11 月 5 日至 2015 年 11 月 6 日实施停牌。本次互利债 A 份额开放申购、赎回并实施基金份额折算后，基金管理人将对互利债 A 份额开放申购、赎回及办理基金份额折算的结果进行公告。

汇添富基金高度重视投资者服务和投资者教育，特此提醒投资者需正确认知基金投资的风险和长期收益，做理性的基金投资人、做明白的基金投资人，享受长期投资的快乐！

特此公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2015 年 11 月 3 日