

中欧信用增利分级债券型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的提示性公告

《中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2012 年 4 月 16 日生效，中欧信用增利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）在基金合同生效后 3 年的分级运作期内，本基金的基金份额划分为中欧信用增利分级债券型证券投资基金之信用 A 份额（简称：信用 A，基金代码：166013）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金之信用 B 份额（简称：信用 B，基金代码：150087）两级份额。信用 A 每满半年开放一次，接受基金投资者的集中申购与赎回，信用 B 封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。

本基金管理人已于 2015 年 3 月 3 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.lcfunds.com）上刊登了《中欧信用增利分级债券型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的公告》。为了保障本基金份额持有人利益，现发布本基金分级期届满与基金份额转换的提示性公告。

一、分级运作期满后基金的存续形式

基金合同生效后 3 年基金分级运作期届满，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金无需召开基金份额持有人大会，即可按照基金合同的约定转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）”。信用 A、信用 B 将以各自的份额净值为基准转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额。本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额后，基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

二、分级运作期到期信用 A 的处理方式

基金合同生效 3 年后基金分级运作期届满，信用 A 基金份额持有人可在信用 A 最后一个开放日选择将其持有的信用 A 赎回，若基金份额持有人在规定时间内未提出赎回申请，其持有的信用 A 将被默认为转入“中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）”份额。

综上，基金管理人决定，2015 年 4 月 15 日为信用 A 份额的最后开放赎回申请日。信用 A 的基金份额持有人可作出选择赎回信用 A 份额或是不选择赎回信用 A 份额。投资者不选择赎回信用 A 份额的，其持有的信用 A 份额将于 2015 年 4 月 16 日日终转换后被默认为转入“中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）”份额。

三、分级运作期到期的份额转换规则

1、基金份额转换日的确定

信用 A 和信用 B 基金份额转换日为基金合同生效之日起 3 年后的对应日。如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。2015 年 4 月 16 日确定为信用 A 和信用 B 的基金份额转换日。

2、基金份额转换方式及份额计算

本基金基金份额转换日日终，基金管理人将根据信用 A 和信用 B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换日登记在册的基金份额实施转换。信用 A、信用 B 的场外份额将转换为上市开放式基金（LOF）场外份额，信用 B 的场内份额将转换为上市开放式基金（LOF）场内份额。转换后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则将相应增加或减少。

份额转换计算公式：

信用 A 转换后基金份额数 = 转换前信用 A 份额数 × T 日信用 A 基金份额参考净值 / T 日基金份额净值

信用 B 转换后基金份额数 = 转换前信用 B 份额数 × T 日信用 B 基金份额参考净值 / T 日基金份额净值

信用 A 和信用 B 的转换比例、信用 A 和信用 B 基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金（LOF）份额数的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

3、基金份额转换日当日及后续申购与赎回的计算

在基金份额转换日后不超过 30 天内，本基金申请上市交易，并开放场内与场外日常申购、赎回业务。份额转换后的本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期，见基金管理人届时发布的相关公告。

四、基金分级运作期到期后的投资管理

基金分级运作期届满并转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资策略不变，有关投资限制继续符合基金合同的约定，并符合相关法律法规的规定。

五、重要提示

1、基金份额到期转换完成后，本基金将更名为“中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）”。

2、信用 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。但在本次到期转换完成后，原信用 A 份额持有人将面临风险收益特征变化的风险，由持有低风险收益特征的信用 A 份额转变为持有相对较高风险收益特征的中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）份额，其份额净

值将随市场涨跌而变化。因此，原信用 A 份额持有人的预期收益实现的不确定性将会增加，并还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、基金份额到期转换完成后，基金管理人将按照基金合同的规定，向深圳证券交易所申请基金的上市交易。届时请详见基金管理人发布的相关公告。

4、在中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）上市交易或开放申购、赎回之前，投资人将无法进行基金份额的申购、赎回或交易，存在一定的流动性风险。

投资者可登陆本公司网站 www.lcfunds.com，或拨打本公司客服电话 400-700-9700、021-68609700 咨询相关信息。

特此公告。

中欧基金管理有限公司

2015 年 4 月 9 日