

中欧信用增利分级债券型证券投资基金之信用 A 份额开放申购与赎回

及折算期间信用 B 份额的风险提示公告

中欧信用增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 2012 年 4 月 16 日生效。根据本基金基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 年内，信用 A 将每满半年开放一次，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。现就相关事项提示如下：

1、信用 B 份额收益分配变化的风险。在基金分级运作期内，信用 A 约定年收益率为一年期银行定期存款利率加上 1.25%。其中，计算信用 A 首个约定年收益率的一年期银行定期存款利率指基金合同生效之日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率；其后信用 A 每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行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调整信用 A 的约定年收益率，信用 A 的约定收益采用单利计算，信用 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位。

目前，一年期银行定期存款基准利率为 3.00%，如果 2014 年 10 月 15 日执行的一年期银行定期存款基准利率仍为 3.00%，本次开放日后信用 A 年约定收益率将为 4.25%。若 2014 年 10 月 15 日执行的一年期银行定期存款基准利率有所变动，则信用 A 的年约定收益率将按上述方式进行调整，信用 B 的收益分配也将进行相应调整。

2、信用 B 份额杠杆率变动的风险。目前，信用 A 与信用 B 的份额配比为 2.05786602: 3。根据本基金基金合同，本次信用 A 实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，信用 A 与信用 B 的份额配比不超过 7: 3。在每一个开放日，所有经确认有效的信用 A 的赎回申请全部予以成交确认。对于信用 A 的申购申请，如果对信用 A 的全部有效申购申请进行确认后，信用 A 与信用 B 的份额配比小于 7:3，则所有经确认有效的信用 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对信用 A 的全部有效申购申请进行确认后，信用 A 与信用 B 的份额配比超过 7:3，则在经确认后的信用 A 与信用 B 的份额配比不超过 7:3 的范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。2014 年 10 月 15 日为信用 A 基金份额折算基准日及第 5 个开放申购与赎回日，如果该日信用 A 的申购申请与赎回申请不匹配，信用 A 的规模将相应变化，从而引致份额配比变化风险，进而出现杠杆率变动风险。

本基金管理人将向深圳证券交易所申请信用 B 于 2014 年 10 月 15 日至 2014 年 10 月 16 日实施停牌。本公告发布之日（2014 年 10 月 13 日）上午信用 B 停牌一小时。本次信用 A 实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，本基金管理人将对信用 A 基金份额折算及开放申购与赎回的结果进行公告。

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。

注：“信用 A”即本基金基金合同所指“增利 A”，“信用 B”即本基金基金合同所指“增利 B”。

中欧基金管理有限公司

2014年10月13日