

## 中欧基金管理有限公司

### 关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金办理到期份额折算业务的公告

根据《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，中欧鼎利分级债券型证券投资基金（简称“本基金”）将以 2017 年 6 月 16 日为折算基准日办理到期份额折算业务。相关事项公告如下：

#### 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，自基金合同生效日或上一基金份额折算日次日始至满三年的最后工作日止，如果期间每个工作日鼎利 B 份额的份额净值都大于 0.300 元，则最后工作日为基金份额到期折算基准日。本基金成立于 2011 年 6 月 16 日，上一基金份额折算日为 2014 年 6 月 16 日，本基金自 2014 年 6 月 16 日次日始至满三年的最后工作日为 2017 年 6 月 16 日，且期间每个工作日鼎利 B 份额的份额净值都大于 0.300 元，即本次基金份额到期折算的折算基准日为 2017 年 6 月 16 日。

#### 二、基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的本基金所有份额。包括中欧鼎利分级债券型证券投资基金之中欧鼎利份额（包括场外份额和场内份额，场内简称“中欧鼎利”，基金代码：166010）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金之 A 份额（场内简称“鼎利 A”，基金代码：150039）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金之 B 份额（场内简称“鼎利 B”，基金代码：150040）。

#### 三、基金份额折算方式

基金份额到期折算和基金份额到点折算的折算方法一致，均按以下方法在基金份额折算日对所有基金份额进行折算：

##### 1. 中欧鼎利份额的份额折算

基金份额折算日折算后，中欧鼎利份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。折算后，中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额的份额数按照中欧鼎利份额折算比例相应增加、缩减或不变。若折算前，中欧鼎利份额净值大于 1.000 元，则折算后中欧鼎利份额持有人持有的中欧鼎利份额增加；若折算前，中欧鼎利份额净值小于或等于 1.000 元，则折算后中欧鼎

利份额持有人持有的中欧鼎利份额缩减或不变。

中欧鼎利份额的折算比例 = 折算日折算前中欧鼎利份额的基金份额净值 / 1

中欧鼎利份额经折算后的份额数 = 折算日折算前中欧鼎利份额的份额数 × 中欧鼎利份额的折算比例

中欧鼎利份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；中欧鼎利份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

## 2. 鼎利 A 份额与鼎利 B 份额的份额折算

基金份额折算日折算后，鼎利 A 份额与鼎利 B 份额按照折算前各自的基金份额净值折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额的场内份额，具体折算公式如下：

鼎利 A (B) 份额的折算比例 = 折算日折算前鼎利 A (B) 份额的基金份额净值 / 1

鼎利 A (B) 份额折算为净值为 1.000 元的中欧鼎利份额数量 = 折算前鼎利 A (B) 份额数量 × 鼎利 A (B) 份额的折算比例

鼎利 A 份额、鼎利 B 份额折算成的中欧鼎利份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

## 3. 折算后中欧鼎利份额场内份额的分拆

在基金份额折算后，将中欧鼎利份额的场内份额按照 7:3 的比例分拆成鼎利 A 份额与鼎利 B 份额。届时，分拆后的鼎利 A 份额、鼎利 B 份额与中欧鼎利份额的场内份额和场外份额的净值均为 1.000 元。

## 四、基金份额折算期间的基金业务办理

根据 2017 年 6 月 13 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（[www.zofund.com](http://www.zofund.com)）的《中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金暂停场内申购和跨系统转托管（仅限场外转场内）业务的公告》的安排，本基金于 2017 年 6 月 14 日起暂停办理场内申购（场外申购不受影响）、跨系统转托管（仅限场外转场内）业务，具体恢复时间另行公告。基于上述事项，本金额折算期间的基金业务办理安排具体如下：

1、份额折算基准日（即 2017 年 6 月 16 日），本基金暂停办理场外申购、场外赎回、场内赎回、定期定额投资、基金转换、系统内转托管、跨系统转托管（场内转场外）及配对转换业务；鼎利 A、鼎利 B 交易正常。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额

折算比例。

2、份额折算基准日后的第一个工作日（即 2017 年 6 月 19 日），本基金暂停办理场外申购、场外赎回、场内赎回、定期定额投资、基金转换、系统内转托管、跨系统转托管（场内转场外）、配对转换业务，鼎利 A、鼎利 B 暂停交易。当日，本基金注册登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记及分拆确认。

3、份额折算基准日后的第二个工作日（即 2017 年 6 月 20 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理场外申购、场外赎回、场内赎回、定期定额投资、基金转换、系统内转托管、跨系统转托管（场内转场外）、配对转换业务，鼎利 A、鼎利 B 自 2017 年 6 月 20 日上午开市起恢复交易。

4、根据深圳证券交易所《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 6 月 20 日的鼎利 A、鼎利 B 即时行情显示的前收盘价为 2017 年 6 月 19 日的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于鼎利 A、鼎利 B 折算前可能存在折溢价交易情形，鼎利 A、鼎利 B 折算前的收盘价扣除基准收益后与 2017 年 6 月 20 日的前收盘价可能有较大差异，2017 年 6 月 20 日可能出现交易价格大浮动波动的情形。

## 五、重要提示

1. 由于鼎利 A、鼎利 B 份额折算成中欧鼎利份额的场内份额数和中欧鼎利份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产，持有较少鼎利 A、鼎利 B 份额数或场内中欧鼎利份额数的份额持有人存在无法获得新增场内中欧鼎利份额的可能性。

2. 本次基金份额到期折算并拆分后，原鼎利 A 份额和鼎利 B 份额的份额持有人持有基金份额的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的低风险收益特征的鼎利 A 份额或较高风险收益特征的鼎利 B 份额变为同时持有低风险收益特征鼎利 A 份额与较高风险收益特征鼎利 B 份额。

3、本基金办理份额折算业务的具体事项以本公告规定的事项为准。

4、投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请登陆本公司网站：[www.zofund.com](http://www.zofund.com) 或者拨打本公司客服电话：400-700-9700, 021-68609700。

## 六、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。  
敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中欧基金管理有限公司

2017年6月13日