

信诚双盈分级债券型证券投资基金之双盈 A 份额开放赎回期间双盈 B 份额(150081)的风险提示公告

信诚双盈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 13 日生效。根据本基金《基金合同》的规定，本基金自生效之日起 3 年内，基金份额分为双盈 A 份额（基金代码：165518）和双盈 B 份额（基金代码：150081）。根据《基金合同》的有关规定，基金合同生效后 3 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，本基金将不再进行基金份额分级，并转换为上市开放式基金（LOF）份额。

双盈 A 根据基金合同的规定获取约定收益，本基金在扣除双盈 A 的应计收益后的全部剩余收益归双盈 B 享有，亏损以双盈 B 的资产净值为限由双盈 B 优先承担。双盈 A 自基金合同生效之日起 3 年内起每满 6 个月开放申购与赎回一次，但在第六个开放日仅开放赎回，不开放申购。双盈 A 的开放日为自基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日。2015 年 4 月 10 日为双盈 A 的第六个开放日（即基金合同生效后 3 年期届满基金份额转换前的最后一个开放日），双盈 A 的基金份额持有人可将其持有的双盈 A 赎回。基金份额持有人若不赎回，其持有的双盈 A 将在基金合同生效后 3 年期届满日（即 2015 年 4 月 13 日）被默认转换为上市开放式基金（LOF）份额。现就相关事项提示如下：

1、双盈 B 份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》的规定，双盈 A 份额的年约定收益率为一年期银行定期存款年利率（税后）加上 1.5%。在双盈 A 的每个开放日，本基金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整存整取基准年利率重新设定双盈 A 的年约定收益率。双盈 A 的年约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后 2 位。

目前，一年期整存整取基准年利率为 2.50%，如果 2015 年 4 月 10 日执行的一年期整存整取基准年利率仍为 2.50%，本次开放日 2015 年 4 月 10 日起（含该日）至 2015 年 4 月 13 日（含）期间双盈 A 年约定收益率将为 4.00%。若 2015 年 4 月 10 日执行的一年期整存整取基准年利率有所变动，则双盈 A 的年约定收益率将按上述方式进行调整，双盈 B 的收益分配也将进行相应调整。

根据本基金《基金合同》的规定，本基金基金合同生效后 3 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，本基金将不再进行基金份额分级，并转换为上市开放式基金（LOF）份额，故原持有双盈 B 的基金份额持有人的风险收益特征将发生一定的变化。双盈 B 为中高风险、中高收益的基金份额。在本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额之后，转换后的上市开放式基金（LOF）为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金管理人再次提醒投资者注意基金份额转换后的风险收益特征变化。

2、双盈 B 份额杠杆率变动的风险。目前，双盈 A 与双盈 B 的份额配比为 1.891831661: 3。根据《基金合同》，本次双盈 A 实施基金份额折算及开放赎回结束后，双盈 A 余额原则上不多于双盈 B 余额的三分之二。本次双盈 A 开放赎回结束后，双盈 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。

本公告发布之日（2015 年 4 月 8 日）上午双盈 B 停牌一小时。本次双盈 A 实施基金份额折

算及开放赎回结束后，本基金管理人将对双盈 A 基金份额折算及开放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。

信诚基金管理有限公司

2015年4月8日