
中银互利分级债券型证券投资基金运作周期到期后

互利 B 份额（150156）风险提示公告

中银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 9 月 24 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:中银互 A,基金代码:163826)和互利 B 份额(场内简称:中银互 B,基金代码:150156)两级份额,两级份额的份额配比原则上不超过 7:3,互利 A 份额获得应计约定收益,互利 B 份额获得扣除互利 A 份额本金和应计约定收益后的基金剩余净资产。本基金 2 年为一个分级运作周期,在每个分级运作周期内,互利 A 份额自分级运作周期起始日起每 6 个月开放一次申购、赎回(第四个开放日仅开放赎回,不开放申购),并于开放日对基金份额进行折算。2015 年 9 月 23 日为互利 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 B 份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定,基金管理人将于第一个分级运作周期到期日针对下一个分级运作周期起始日(含)到该分级运作周期内互利 A 第 1 个申购开放日(含)的时间段互利 A 的约定年收益率进行设定并公告。计算公式如下:

互利 A 份额的年约定收益率 = 1.1 × 一年期定期存款利率 + 利差

互利 A 份额的应计收益的金额采用单利计算。互利 A 份额的年化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。互利 A 的约定年收益率按照上述方式调整后,互利 B 的收益分配将相应调整。

2、互利 B 份额杠杆率变动的风险。目前,互利 A 份额与互利 B 份额的份额配比为 1:6.43。过渡期互利 A 份额申购期内,对于互利 A 申购申请,本基金以互利 B 的份额余额为基准,在不超过互利 B 的份额余额范围的 7/3 倍内对互利 A 的申购进行份额限制。过渡期内互利 A、互利 B 的申购赎回可能会引发互利 A、互利 B 份额配比发生变化,进而导致互利 B 份额杠杆率变动风险。

基金管理人拟向深圳证券交易所申请中银互利分级债券型证券投资基金之互利 B 份额(场内简称:中银互 B,代码:150156)2015 年 9 月 18 日 9:30 至 10:30 停牌一小时,并自 2015 年 9 月 23 日开始停牌,并在下一个分级运作周期开始后 1 个月内申请在深圳证券

交易所复牌。

风险提示：

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，了解拟投资基金的风险收益特征，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司

2015年9月18日