

# 长信基金管理有限责任公司关于长信利鑫分级债券型证券投资基金之

## 利鑫 A 份额开放赎回期间利鑫 B 份额 ( 150042 ) 的风险提示公告

长信利鑫分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同已于 2011 年 6 月 24 日生效。本基金《基金合同》生效之日起 5 年内，基金份额划分为利鑫 A（基金代码 163004）、利鑫 B（基金代码 150042）两级份额，两者的份额配比原则上不超过 2:1。本基金为利鑫 A 设立约定年化收益率，基金的资产净值将优先满足利鑫 A 的本金及约定收益，剩余的基金资产归利鑫 B 享有。根据本基金《基金合同》的规定，经与本基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司确认，本基金在分级运作期内，利鑫 A 每满 6 个月进行一次基金份额折算并进行开放，利鑫 A 的基金份额折算基准日与开放日为同一天。利鑫 B 封闭运作并上市交易。

2016 年 6 月 23 日为利鑫 A 份额的最后一个基金份额折算基准日及开放日，该日仅开放利鑫 A 份额的赎回业务，现就本次利鑫 A 份额开放赎回期间利鑫 B 份额的风险提示如下：

1、利鑫 B 份额收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定，本基金将于每个利鑫 A 的开放日针对下一期利鑫 A 的约定年化收益率进行设定并公告，计算公式为：利鑫 A 的年收益率（单利）=

$1.1 \times 1$  年期银行定期存款利率+0.8%

其中，1 年期银行定期存款利率为届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率，按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位。利鑫 A 份额的约定年化收益率按照上述方式调整后，利鑫 B 份额的收益分配将相应调整。

因利鑫 A 份额将于 2016 年 6 月 24 日日终转换后被默认转入“长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）”份额，故本次的约定收益适用于 2016 年 6 月 24 日当日。

2、利鑫 B 份额杠杆率变动的风险。目前，利鑫 A 与利鑫 B 的份额配比为 0.12796790:1。本次利鑫 A 实施基金份额折算及开放赎回结束后，利鑫 A 的规模将缩减，从而引发利鑫 A、利鑫 B 份额配比发生变化，进而导致利鑫 B 份额杠杆率变动风险，本基金管理人将对利鑫 A 基金份额开放赎回的结果进行公告。

本基金转换为长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）后，原利鑫 B 将不再上市交易，本基金管理人已向深圳证券交易所申请终止本基金利鑫 B 的基金份额上市交易，终止上市日为 2016 年 6 月 24 日。

本公告发布之日（2016 年 6 月 21 日）开市起至 10:30 利鑫 B 停牌一小时。

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。

长信基金管理有限责任公司

2016 年 6 月 21 日