

# 关于富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金之恒利 A 份额 开放赎回期间恒利 B 份额的风险提示公告

《富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2014 年 3 月 10 日生效，根据基金合同的有关规定，富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同生效后 3 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）”。

根据基金合同规定，2017 年 3 月 9 日为恒利 A 份额（简称：国富恒利分级债券 A，基金代码：164510）的最后开放赎回申请日。恒利 A 基金份额持有人可在恒利 A 最后一个开放日选择将其持有的恒利 A 赎回，若基金份额持有人在规定时间内未提出赎回申请，其持有的恒利 A 将于 2017 年 3 月 10 日日终转换后被默认为转入“富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）” C 类份额。

基金合同生效后 3 年期届满前，基金管理人将提前公告并提示恒利 A 的处理方式。2017 年 3 月 9 日为恒利 A 份额的开放赎回申请日，即在该日 15:00 前接受办理恒利 A 份额的赎回业务。

现就此次恒利 A 份额开放赎回期间恒利 B 份额的风险提示如下：

1、恒利 B 份额收益分配变化的风险。根据基金合同规定，本基金将于每个恒利 A 的开放日，根据该日中国人民银行执行的金融机构人民币一年期银行定期存款基准利率重新设定恒利 A 的约定年基准收益率，计算公式如下：

恒利 A 份额的约定年基准收益率=1.4×人民币一年期银行定期存款利率

基金管理人可以根据市场情况，保留将恒利 A 份额的约定年基准收益率在此基础上上调不超过 20% 的权利。

为保护基金份额持有人利益，基金管理人根据市场情况，决定将恒利 A 份额自第六个开放日后的约定年基准收益率在此基础上上调，上调幅度为 20%。约定年基准收益率的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

假设 2017 年 3 月 9 日中国人民银行执行的金融机构人民币一年期银行定期存款基准利率为 1.50%，本次开放日后恒利 A 约定年基准收益率为 2.52%。（因恒利 A 份额将于 2017 年 3 月 10 日日终转换后被默认转入“富兰克林国海恒利债券型证券投资基金（LOF）” C 类份额，故本次的约定收益适用于 2017 年 3 月 10 日当日。）恒利 A 具有低风险、收益相对稳定的特征，但是，本基金为恒利 A 设置的

约定年基准收益率并非保证收益，在极端情况下，如果基金在短期内发生大幅度的投资亏损，恒利 A 可能不能获得收益甚至可能面临投资受损的风险。

恒利 A 的约定年基准收益率按照上述方式调整后，恒利 B 份额的收益分配将相应调整。

2、恒利 B 份额杠杆率变动的风险。目前，恒利 A 与恒利 B 的份额配比为 0.63962523:3。本次恒利 A 实施基金份额折算及开放赎回结束后，恒利 A 的赎回将引致份额配比发生变化，进而出现杠杆率变动风险。

3、本次恒利 A 实施基金份额折算及开放赎回结束后，本基金管理人将对恒利 A 基金份额折算及开放赎回的结果进行公告。

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。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，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国海富兰克林基金管理有限公司

2017 年 3 月 7 日