

风险提示书

您应当已经完整阅读基金合同、招募说明书、份额发售公告等法律文件，充分理解权利、义务及基金的风险收益特征，并愿意承担相应的投资风险。本揭示书将向您重点揭示产品的特有风险、特定安排、主要费用、您的重要权利、信息披露、冷静期和回访、投诉及争端解决方式等事项。

本基金为债券型证券投资基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，产品风险等级为中低风险等级（R2）。

（一）本基金的特定风险：

（1）指数化投资相关的风险

本基金投资于待偿期在 1 年-5 年（包含 1 年和 5 年）的标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的债券仓位，在债券市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

（2）标的指数的风险

1) 标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

2) 标的指数波动的风险

标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3) 标的指数计算出错的风险

指数编制方法的缺陷可能导致标的指数的表现与总体市场表现产生差异，从而使基金收益发生变化。同时，中债金融估值中心有限公司不对指数的实时性、完整性和准确性做出任何承诺。标的指数值可能出现错误，投资者若参考指数值进行投资决策可能导致损失。

4) 标的指数变更的风险

根据基金合同的约定，如果指数发布机构退出或由于指数编制方法等重大变

更导致该指数不宜继续作为标的指数等原因,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。

届时基金合同将发生变更,基于原标的指数的投资政策将会改变,基金投资组合将随之调整,基金的风险收益特征将与新的标的指数一致,投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

5) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

1) 本基金采用优化抽样复制法,组合与标的指数之间可能存在差异,组合中还会保留部分现金或其他债券品种。此外,标的指数成份券取价规则和基金估值方法之间可能存在差异,使本基金存在跟踪误差;

2) 由于标的指数调整成份券或变更编制方法,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差;

3) 由于标的指数成份券在标的指数中的权重发生变化,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差;

4) 由于成份券流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差;

5) 由于基金投资过程中的证券交易成本,以及基金管理费、基金托管费和

销售服务费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

6) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；

7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入券数的限制，基金投资组合中某些债券的持有比例与标的指数中该债券的权重可能不完全相同；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

(5) 成份券停牌或违约的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌或违约，发生成份券停牌或违约时可能面临基金因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

(6) 本基金主要投资于政策性金融债，可能面临以下风险：

1) 政策性银行改制后的信用风险

若未来政策性银行进行改制，政策性金融债券的性质有可能发生较大变化，债券信用等级也可能相应调整，基金投资可能面临一定信用风险；

2) 政策性金融债流动性风险

政策性金融债市场投资者行为具有一定趋同性，在极端市场环境下，可能集中买入或卖出，存在流动性风险；

3) 投资集中度风险

政策性金融债发行人较为单一，若单一主体发生重大事项变化，可能对基金净值表现产生较大影响。

(7) 本基金投资范围包括国债期货，可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

(二) 本基金可能因政策变更、市场下跌、投资与市场发生背离、估值发生偏差等原因发生亏损。

(三) 发生巨额赎回时，您的赎回申请可能不能全部确认。基金实施备用流动性风险管理工具的，您的申赎申请、赎回款项支付等可能受到相应影响。

(四) 本基金管理费，0.15%/年；托管费，0.05%/年；本基金分为 A、C 两类份额，分别适用不同销售费率；其它详见招募说明书。

(五) 您享有如下权利：1、分享基金收益；2、参与清算分配；3、申请赎回或转让基金份额；4、要求召开或自行召集持有人大会，并行使表决权；5、查阅或复制信息披露资料；6、监督管理人的投资运作；7、依法提起诉讼或仲裁。

(六) 基金成立后，开始办理申赎前，至少每周披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值；开始办理申赎后，每个开放日的次日披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值；半年度和年度最后一日的次日，披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。每年结束之日起三个月内，披露基金年度报告；上半年结束之日起两个月内，披露基金中期报告；每个季度结束之日起 15 个工作日内，披露基金季度报告。您可以登陆公司网站（www.hexaamc.com）或查阅指定报刊有关信息和其它临时公告。

(七) 您通过柜台直销投资的，享有 3 分钟冷静期。交易确认后，公司将抽取一定比例客户进行回访；普通投资者（机构）通过传真交易方式投资的，至少回访两次。

(八) 您可通过客服电话(400-100-3783)或电子邮件(service@hexaamc.com)进行投诉；**亦可向上海国际经济贸易仲裁委员会提起仲裁。**

请投资者在投资前认真阅读本风险揭示书，并请在本风险揭示书后签署确

认。

(以下无正文)

以上《风险揭示书》的各项内容，本人/单位已阅读并完全理解。

抄录：以上《风险揭示书》的各项内容，本人/单位已□□并□□□□。

(请基金投资人/被授权人认真阅读后抄录)

机构公章及法定代表人签章

自然人签字

经办人/被授权人签字