附件 7 高风险产品（长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）
风险揭示书
尊敬的投资者：
为了更好地帮助您了解长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基
金”）的风险，根据相关法律法规规定，特提供本风险揭示书，请您认真仔细阅读，综合考
虑自身的资产与收入状况、投资经营、风险偏好与自身风险承受能力，慎重决定是否继续购
买本基金。
一、产品基本信息
基金名称长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金
基金简称长信中证一带一路指数
基金主代码 502016 基金运作方式契约开放式
基金合同生效日 2015 年 8 月 17 日
基金管理人长信基金管理有限责任公司
基金托管人广发证券股份有限公司
基金合同存续期不定期
基金份额上市的证券交易所上海证券交易所
上市日期长信一带一路A、长信一带一路B：2015年8月24日；长信一带
一路份额：2016年2月1日
下属分级基金简称长信一带一路 A 长信一带一路 B 长信一带一路
下属分级基金场内简称带路 A 带路 B 带路分级
下属分级基金的交易代码 502017 502018 502016 二、产品特征
投资目标本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪
律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长
率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误
差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过
0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的
有效跟踪。
投资策略本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，
按照成份股在中证一带一路主题指数中的基准权重
构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其
权重的变化进行相应的调整。
业绩比较基准 95%×中证一带一路主题指数收益率＋5%×银行人
民币活期存款利率（税后）

三、产品费用及费率
1、申购费（场内、场外费率相同）
申购金额（M，含申购费）申购费率
M＜100 万 1.2%
100 万≤M＜200 万 0.8%
200 万≤M 1000 元每笔
2、赎回费
长信一带一路份额场内场外赎回费率都为 0.50%，其中不低于赎回费总额的 25%归基金
资产，未归入基金资产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
3、管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。
4、托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22%的年费率计提。
5、指数使用许可费
指数使用许可费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提。
四、信息披露
本基金的信息披露符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他
有关规定：
公开披露信息披露频率
基金招募说明书、基金合同、基金托管协议每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书
基金份额发售公告披露招募说明书的当日
《基金合同》生效公告收到中国证监会确认文件的次日
《上市交易公告书》本基金的基金份额上市交易 3 个工作日前
基金资产净值公告、基金份额（参考）净值公告、
基金份额累计净值公告
半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）次
日公告半年度或年度最有一个交易日基金资产净值
和长信一带一路份额的基金份额净值和基金份额累
计净值、长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份
额的基金份额参考净值
长信一带一路份额申购、赎回价格每个交易日次日披露交易日当天申购、赎回价格
基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报
告和基金季度报告
每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告；
上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报
告；
在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基
金季度报告
临时报告本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告

本基金信息披露方式：
本基金选定的信息披露报纸名称中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金定期报告及临时公告的管理人互联
网网址 www.cxfund.com.cn 五、本基金运作的特有的风险及可能引起的损失
本基金为分级基金，投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险：：
1、杠杆机制引起的风险
本基金为跟踪指数的股票型分级基金，具有高风险、高预期收益的特征。由于长信一带
一路 B 份额内含杠杆机制的设计，长信一带一路 B 份额的参考净值的变动幅度将大于长信
一带一路份额的净值和长信一带一路 A 份额的参考净值的变动幅度，即长信一带一路 B 份
额的净值变动的波动性要高于其他两类份额。
2、基金份额的折/溢价交易风险
长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，
基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额
配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平，但长信一带一路 A 份额和长信一
带一路 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换机制
的影响，长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的交易价格可能会相互影响。
3、基金份额风险收益特征变化风险
根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基
金份额折算后，长信一带一路 A 份额持有人或长信一带一路 B 份额持有人将会获得一定比
例的长信一带一路份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化
的风险。
4、基金份额折算风险
1)在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。
场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，
舍去部分所代表的资产计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最
小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。因此，在
基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。
2)份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买长信一带一路 A 份额或长信一带一
路 B 份额的一部分投资人可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全
部具备中国证监会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投
资人赎回基金份额。因此，如果投资人通过不具备基金代销资格的证券公司购买长信一带一
路 A 份额或长信一带一路 B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的长信一带一路份额
并不能被赎回。此风险需要引起投资人注意，投资人可以选择在份额折算前将长信一带一路
A 份额或长信一带一路 B 份额，或者将新增的长信一带一路份额通过转托管业务转入具有
基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。5、份额配对转换业务中存在的风险
基金合同生效后，在长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额
的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理长信一带一路份额与长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改
变长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；
另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能
存在不能及时确认的风险。
6、基金的收益分配
在存续期内，本基金将不进行收益分配（除未来法律法规或监管机构允许的情况外）。
本基金管理人将根据基金合同的约定对本基金实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新
增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后的新增份额的方式获取投资回报，但是，投
资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不
仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。
7、基金终止上市风险
根据交易所相关监管规定，基金上市期间出现下列情形之一的，基金管理人应当及时向
本所报告并发布终止上市风险提示公告，披露基金将终止上市及相关安排等事项，基金进入
终止上市程序：
（一）分级基金基础份额和子份额持有人合计少于1000人或者规模合计低于5000万份，
且在 10 个交易日内未消除的；
（二）除分级基金以外的其他基金持有人少于 1000 人，且在 60 个交易日内未消除的。
六、普通投资者相关权利
购买本产品的普通投资者，享有如下权利：

1、您当日的交易可在当日交易时间内进行撤销。
2、对持有高风险等级基金产品或者服务的普通投资者进行定期回访。回访内容包括但
不限于以下信息：
（一）受访人是否为投资者本人；
（二）受访人是否已知晓基金产品或者服务的风险以及相关风险警示；
（三）受访人是否已知晓自己的风险承受能力等级、购买的基金产品或者接受的服务的
风险等级以及适当性匹配意见；
（四）受访人是否知晓承担的费用以及可能产生的投资损失；
（五）基金募集机构及其工作人员是否存在《证券投资基金销售管理办法》第二十二条
规定的禁止行为。
七、普通投资者诉讼方式及纠纷解决安排
普通投资者公开投诉渠道包括：电话、信函、传真、电子邮件等，以及证监督管理机构
和其他部门单位转办的投诉，以保证投资者可以通过任何一种可供选择的联系方式向本公司
提出诉讼并得到有效处理何反馈。
我公司纠纷解决流程：
1、登记及受理
2、调查、取证及处理
3、落实处理方案
4、电话或书面回复投资者
5、投诉事项处理完毕后，做好工作总结及记录，完善内控制度。
投资者确认：本人已认真阅读《高风险产品—长信一带一路主题指数证券投资基金风险
揭示函》，充分知晓并自愿承担该基金可能面临的各类风险，听取经营机构适当性意见的基
础上，根据自身能力审慎决策，独立承担投资风险。经本人审慎考虑，仍坚持申请购买该产
品/服务，并自愿承担由此可能产生的一切不利后果和损失。基金销售机构及工作人员没有
在销售基金过程中主动推介该基金产品的信息。
投资者签字/盖章: 年月日