

## 长信基金管理有限责任公司

# 关于长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定及上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，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”）将于2015年12月15日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

### 一、基金份额折算基准日

根据本基金基金合同关于“本基金基金份额定期折算基准日为每年12月15日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），若距离上一次基金份额折算不满3个月则可不进行折算”之约定，本基金自2015年8月17日基金合同生效之日起至今未进行折算，故本年度本基金基金份额的定期折算基准日为2015年12月15日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日即2015年12月15日登记在册的长信一带一路A份额、长信一带一路份额。

### 三、基金份额折算方式

定期份额折算后长信一带一路A份额的基金份额参考净值调整为1.000元，基金份额折算基准日折算前长信一带一路A份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分将折算为长信一带一路份额的场内份额分配给长信一带一路A份额持有人。长信一带一路份额持有人持有的每两份长信一带一路份额将按一份长信一带一路A份额获得新增长信一带一路份额的分配，经过上述份额折算后，长信一带一路份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，长信一

一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

有关计算公式如下：

### 1、长信一带一路份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长信一带一路份额的资产净值} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

长信一带一路份额持有人新增的长信一带一路份额

$$= \frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：折算后长信一带一路份额的基金份额净值，下同

$NAV_A^{\text{前}}$ ：折算前长信一带一路 A 份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：折算前长信一带一路份额的份额数，下同

持有场外长信一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外长信一带一路份额的分配；持有场内长信一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内长信一带一路份额的分配。

### 2、长信一带一路 A 份额

定期份额折算后长信一带一路 A 份额的基金份额参考净值=1.000 元

定期份额折算后长信一带一路 A 份额的份额数=定期份额折算前长信一带一路 A 份额的份额数

长信一带一路 A 份额持有人新增的场内长信一带一路份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：折算前长信一带一路 A 份额的份额数，下同

### 3、长信一带一路 B 份额

定期份额折算不改变长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

### 4、折算后的长信一带一路份额总份额数

折算后长信一带一路份额的总份额数=折算前长信一带一路份额的份额数+

长信一带一路份额持有人新增的长信一带一路份额的份额数+长信一带一路 A 份额持有人新增的场内长信一带一路份额的份额数

#### 四、折算份额数的处理方式

折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

#### 五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即2015年12月15日），长信一带一路份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管及配对转换业务；长信一带一路A份额和长信一带一路B份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日长信一带一路份额的基金份额净值和长信一带一路A份额、长信一带一路B份额的基金份额参考净值并进行份额折算。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2015年12月16日），长信一带一路份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管及配对转换业务，长信一带一路A份额暂停交易，长信一带一路B份额正常交易。当日，本基金注册登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2015年12月17日），基金管理人将公告基金份额折算结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，长信一带一路份额恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管及配对转换业务，长信一带一路A份额于该日开市起复牌，长信一带一路B份额正常交易。

#### 六、风险揭示

1、基金份额的折/溢价交易风险 根据上海证券交易所相关规定，2015年12月17日长信一带一路A份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为2015年12月16日长信一带一路A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于长信一带一路A份额折算前可能存在折溢价交易情形，长信一带一路A份额折算前（2015年12月15日）的收盘价扣除约定应得收益后与2015年12月17日的前收盘价可能有

较大差异。长信一带一路A份额2015年12月17日当日可能出现交易价格大幅波动的情形，敬请投资者注意投资风险。

#### 2、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的风险

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。

#### 3、份额折算后新增份额可能面临无法赎回的风险

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。

#### 4、基金份额风险收益特征变化风险

由于长信一带一路A份额定期折算基准日参考净值超出1.000元的部分将折算为场内长信一带一路份额，折算后其份额持有人的风险收益特征将发生一定变化：由持有单一的预期风险低、预期收益低的长信一带一路A份额变为同时持有预期风险低、预期收益低的长信一带一路A份额与预期风险较高、预期收益较高的长信一带一路份额，敬请长信一带一路A份额持有人注意。

### 七、投资者可通过以下途径咨询有关详情

长信基金管理有限责任公司

客户服务专线：4007005566（免长话费）

网站：[www.cxfund.com.cn](http://www.cxfund.com.cn)

风险提示：本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前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长信基金管理有限责任公司

2015年12月10日