

# 长盛中证全指证券公司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《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）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，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2016 年 11 月 30 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的规定，本基金基金份额定期折算基准日为每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）11 月份最后一个交易日。本次定期折算的折算基准日为 2016 年 11 月 30 日。

## 二、基金份额折算对象

基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的长盛中证证券公司份额（包括场外份额和场内份额）、长盛中证证券公司 A 份额。

## 三、基金份额折算方式

在折算基准日，本基金将按照以下规则进行基金的折算：长盛中证证券公司份额和长盛中证证券公司 A 份额基金合同规定的份额参考净值计算规则进行计算；对于长盛中证证券公司 A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛中证证券公司份额。每两份长盛中证证券公司份额将按一份长盛中证证券公司 A 份额获得新增长盛中证证券公司份额的分配，场内长盛中证证券公司份额持有人折算后获得新增场内长盛中证证券公司份额，场外长盛中证证券公司份额持有人折算后获得新增场外长盛中证证券公司份额。

折算后长盛中证证券公司 A 份额和长盛中证证券公司 B 份额的比例仍为 1:1，长盛中证证券公司 A 份额参考净值调整为 1.000 元。

### 1) 长盛中证证券公司 A 份额

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

长盛中证证券公司 A 份额折算后新增的长盛中证证券公司份额数

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

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后长盛中证证券公司 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前长盛中证证券公司 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前长盛中证证券公司 A 份额的参考净值；

$NAV^{\text{后}}$  为折算后长盛中证证券公司份额的份额净值；

$NAV^{\text{前}}$  为折算前长盛中证证券公司份额的份额净值；

2) 定期份额折算不改变长盛中证证券公司 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

3) 长盛中证证券公司份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

原长盛中证证券公司份额持有人定期折算后持有的长盛中证证券公司份额的份额数为  $= \frac{NUM^{\text{前}} \times NAV^{\text{前}}}{1.000}$

其中，

$NAV^{\text{后}}$  为折算后长盛中证证券公司份额的份额净值；

$NAV^{\text{前}}$  为折算前长盛中证证券公司份额的份额净值；

$NUM^{\text{前}}$  为折算前长盛中证证券公司份额的份额数。

定期折算后长盛中证证券公司份额的份额数=原长盛中证证券公司份额持有人定期折算后持有的长盛中证证券公司份额的份额数+长盛中证证券公司 A 份额折算后新增的长盛中证证券公司份额数

场内的长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司 A 份额折算成的新增长盛中证证券公司份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。

#### 四、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 2016 年 11 月 30 日），本基金暂停办理长盛中证证券公司份额的申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）及配对转换业务；长盛中证证券公司份额、

长盛中证证券公司 A 份额和长盛中证证券公司 B 份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日长盛中证证券公司份额的基金份额净值和长盛中证证券公司 A 份额、长盛中证证券公司 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 2016 年 12 月 1 日），本基金长盛中证证券公司份额暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，长盛中证证券公司份额和长盛中证证券公司 A 份额暂停交易，长盛中证证券公司 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 2016 年 12 月 2 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，长盛中证证券公司份额和长盛中证证券公司 A 份额于该日开市起复牌，长盛中证证券公司 B 份额正常交易。

## 五、重要提示

1、根据上海证券交易所相关规定，2016 年 12 月 2 日长盛中证证券公司 A 份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2016 年 12 月 1 日长盛中证证券公司 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于长盛中证证券公司 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，长盛中证证券公司 A 份额折算前（2016 年 11 月 30 日）的收盘价扣除约定应得收益后与 2016 年 12 月 2 日的前收盘价可能有较大差异。长盛中证证券公司 A 份额 2016 年 12 月 2 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、根据上海证券交易所相关规定，2016 年 12 月 2 日长盛中证证券公司份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2016 年 12 月 1 日长盛中证证券公司份额的基金份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于长盛中证证券公司份额折算前可能存在折溢价交易情形，长盛中证证券公司份额折算前（2016 年 11 月 30 日）的收盘价与 2016 年 12 月 2 日的前收盘价可能有较大差异。长盛中证证券公司份额 2016 年 12 月 2 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。

3、由于场内的长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司 A 份额折算成的新增长盛中证证券公司份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份

额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。因此，折算前持有较少场内长盛中证证券公司份额或长盛中证证券公司 A 份额的持有人存在无法获得新增长盛中证证券公司份额的可能性。

4、由于长盛中证证券公司 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盛中证证券公司份额，折算后其份额持有人的风险收益特征将发生一定变化：由持有单一的低风险、收益相对稳定的长盛中证证券公司 A 份额变为同时持有低风险、收益相对稳定的长盛中证证券公司 A 份额与较高风险、较高收益的长盛中证证券公司份额，敬请长盛中证证券公司 A 份额持有人注意。

投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn) 或者拨打本公司客服电话：400—888—2666。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长盛基金管理有限公司

2016 年 11 月 25 日