

# 长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金 不定期份额折算公告

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”）第二十部分中关于基金份额不定期折算的相关规定，当长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之长盛中证申万一带一路B份额的基金份额参考净值跌至0.250元以下（含0.250元，下同）时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2018年9月10日，本基金长盛中证证券公司B份额的基金份额参考净值为0.233元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2018年9月11日为基金份额折算基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

## 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2018年9月11日。

## 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的长盛中证证券公司份额（场内简称：“券商分级”，基金代码：502053）、长盛中证证券公司A份额（场内简称：“券商A”，基金代码：502054）、长盛中证证券公司B份额（场内简称：“券商B”，基金代码：502055）。

## 三、基金份额折算方式

长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额按照基金合同“第二十部分 基金份额的折算”规则进行不定期份额折算。

当长盛中证证券公司B份额的基金份额参考净值跌至0.250元以下时，本基金将分别对长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额和长盛中证证券公司份额进行折算，折算后本基金将确保长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的比例为1:1；折算后长盛中证证券公司份额的净值以及长盛中证证券

公司 A 份额、长盛中证证券公司 B 份额的参考净值均调整为 1 元；折算后，长盛中证证券公司 A 份额持有人获得新增的场内长盛中证证券公司份额；折算后场外长盛中证证券公司份额持有人获得新增的场外长盛中证证券公司份额、场内长盛中证证券公司份额持有人获得新增场内长盛中证证券公司份额。

当长盛中证证券公司 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下时，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 份额将按照以下公式进行不定期折算。

(1) 长盛中证证券公司 B 份额

份额折算前长盛中证证券公司 B 份额的资产与份额折算后长盛中证证券公司 B 份额的资产相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NUM_B^{\text{前}} \times NAV_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中， $NUM_B^{\text{后}}$  为折算后长盛中证证券公司 B 份额的份额数；

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

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

(2) 长盛中证证券公司 A 份额

份额折算原则：

i) 份额折算前后长盛中证证券公司 A 份额与长盛中证证券公司 B 份额始终保持 1:1 配比；

ii) 份额折算前长盛中证证券公司 A 份额的持有人在份额折算后将持有长盛中证证券公司 A 份额与新增长盛中证证券公司份额；

iii) 份额折算前长盛中证证券公司 A 份额的资产等于份额折算后长盛中证证券公司 A 份额的资产与其新增长盛中证证券公司份额的资产。

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

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

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

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；

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后长盛中证证券公司 B 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。

### （3）长盛中证证券公司份额

份额折算原则：

份额折算前长盛中证证券公司份额持有人持有的资产与份额折算后长盛中证证券公司份额持有人持有的资产相等。

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NUM^{\text{前}} \times NAV^{\text{前}}}{1.000}$$

其中， $NUM^{\text{后}}$  为折算后的长盛中证证券公司份额的份额数；

$NUM^{\text{前}}$  为折算前长盛中证证券公司份额的份额数；

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

不定期份额折算后长盛中证证券公司份额的份额数

=不定期份额折算前的长盛中证证券公司份额持有人不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 份额持有人不定期折算后持有的场内长盛中证证券公司份额的份额数

场内的长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司 A 份额、长盛中证证券公司 B 份额折算后的份额数取整计算（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

（一）不定期份额折算基准日（即2018年9月11日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额将于2018年9月11日上午开市至10:30停牌，并于2018年9月11日上午10:30恢复正常交易。该日终，

基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

(二) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2018年9月12日), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资)、赎回、转托管、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、长盛中证证券公司B份额在该日停牌一个交易日。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。

(三) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2018年9月13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(含定期定额投资)、赎回、转托管、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、长盛中证证券公司B份额将于该日开市起复牌。

(四) 2018年9月13日长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额即时行情显示的前收盘价为2018年9月12日的长盛中证证券公司份额净值以及长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额的份额参考净值, 2018年9月13日当日长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额均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。

## 六、重要提示

1、本基金长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额将于2018年9月11日上午开市至10:30停牌, 并于2018年9月11日上午10:30复牌。长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额将于2018年9月12日停牌1个交易日, 并于2018年9月13日开市起复牌。

2、2018年9月10日, 长盛中证证券公司B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元以下, 而折算基准日为2018年9月11日, 因此, 折算基准日长盛中证证券公司B份额的基金份额参考净值与折算条件0.250元可能有一定差异。

**3、特别提示:** 近日长盛中证证券公司B份额二级市场交易价格溢价较大, 不定期份额折算后, 长盛中证证券公司B份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意长盛中证证券公司B份额高溢价交易所带来的风险。

4、本基金长盛中证证券公司A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征, 但在不定期份额折算后长盛中证证券公司A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,

由持有单一的较低风险收益特征的长盛中证证券公司A份额变为同时持有较低风险收益特征的长盛中证证券公司A份额与较高风险收益特征的长盛中证证券公司份额，因此原长盛中证证券公司A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，长盛中证证券公司份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原长盛中证证券公司A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、本基金长盛中证证券公司B份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，长盛中证证券公司B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、本长盛中证证券公司B份额表现为高风险、高收益预期的特征，不定期份额折算后，其杠杆倍数将恢复到初始杠杆水平，长盛中证证券公司B份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日（2018年9月11日）当天买入，可能遭受重大损失，敬请投资者注意投资风险。

7、由于长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

8、原长盛中证证券公司A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的长盛中证证券公司场内份额分拆为长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额。

9、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销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买长盛中证证券公司A份额，在不定期份额折算后，则折算新增的长盛中证证券公司份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将长盛中证证券公司A份额卖出，或者在折算后将新增的长盛中证证券公司份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

10、根据上海证券交易所的相关业务规则，场内的长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额折算后的份额数取整计算（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。

11、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《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

12、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及招募说明书或者通过本基金管理人网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）或客户服务电话（400-888-2666或010-62350088）咨询。

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。

长盛基金管理有限公司

2018年9月11日