

关于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结果及恢复交易的公告

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”）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，长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以 2019 年 3 月 7 日为份额折算基准日，对该日交易结束后登记在册的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”）之基础份额（即长盛中证证券公司份额的份额，场内简称：券商分级，代码：502053，包括场外份额、场内份额）、长盛中证证券公司 B 份额（场内简称：券商 B，代码：502055）实施不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2019 年 3 月 7 日，长盛中证证券公司份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；长盛中证证券公司份额的场内份额、长盛中证证券公司 B 份额经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。份额折算比例按截位法精确到小数点后第 6 位，具体折算结果如下表所示：

基金份额名称

（注 1）

折算前份额

（单位：份）

折算前基金份额

净值（或基金份额

参考净值，单

位：元）

份额折算比

例

折算后基金

份额（单位：份）

折算后基金份额

净值（或基金份额

参考净值，单位：

元）

场外长盛中证证

券公司份额 59,561,710.64 1.593 1.571726 93,614,749.92 1.013

场内长盛中证证

券公司份额 3,346,142.00 1.593 1.571726 17,123,307.00

（注 2） 1.013

长盛中证证券公

司 B 份额 10,375,667.00 2.173

1.000000 10,375,667.00

(注 3)

1.013

1.143453 11,864,088.00

(注 4)

注 1: 场外长盛中证证券公司份额经折算后产生新增的长盛中证证券公司份额仍登记在场外;场内长盛中证证券公司份额经折算后产生新增的长盛中证证券公司份额仍登记在场内;长盛中证证券公司 B 份额经折算后产生新增的长盛中证证券公司份额登记在场内。折算后的场内长盛中证证券公司份额合计数量为注 2、注 4 合计数量。

注 2:为场内长盛中证证券公司份额经折算后的场内长盛中证证券公司份额

注 3: 为场内长盛中证证券公司 B 份额经折算后的场内长盛中证证券公司 B 份额

注 4: 为场内长盛中证证券公司 B 份额经折算后产生的场内长盛中证证券公司份额
投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自 2019 年 3 月 11 日起, 本基金恢复办理申购(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)、配对转换业务, 券商分级、券商 B 将于 2019 年 3 月 11 日上午开市起复牌。

2019 年 3 月 11 日复牌首日, 券商分级、券商 B 的即时行情显示的前收盘价将调整为 2019 年 3 月 8 日长盛中证证券公司份额的基金份额净值以及长盛中证证券公司 B 份额的基金份额参考净值(结果四舍五入至 0.001 元), 分别为 0.931 元、0.849 元。2019 年 3 月 11 日当日, 券商分级、券商 B 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。

三、重要提示

1、长盛中证证券公司 B 份额表现为高风险、高收益的特征, 不定期份额折算后将恢复到初始杠杆水平, 其杠杆倍数将比折算前高。当发生基金合同规定的不定期份额折算时, 长盛中证证券公司 B 份额的参考净值超过长盛中证证券公司 A 份额的参考净值的部分将会折算为长盛中证证券公司份额, 份额折算后, 长盛中证证券公司份额的基金份额净值、长盛中证证券公司 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日长盛中证证券公司 A 份额的基金份额参考净值三者相等。原长盛中证证券公司 B 份额的持有人在不定期折算后将持有长盛中证证券公司 B 份额和长盛中证证券公司份额。因此, 持有人的风险收益特征将发生一定的变化, 由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况

2、长盛中证证券公司 A 份额表现为预期风险低、预期收益相对稳定的特征。当发生基金合同规定的上述不定期份额折算时, 长盛中证证券公司 A 份额份额数和基金份额参考净值将不发生变化。

3、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。

4、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 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。

5、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 B 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 B 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。

6、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。

7、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）或客户服务电话（400-888-2666 或 010-86497888）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

2019年3月11日