

长盛中证申万一带一路主题指数分级 证券投资基金可能发生不定期 份额折算的风险提示公告

根据《长盛中证申万一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”)中关于不定期份额折算的相关规定,当长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之基础份额——长盛中证申万一带一路份额(场内简称:一带一路,基金代码:502013)的基金份额净值大于或等于1.500元时,本基金将进行不定期份额折算。

截至2020年12月21日,长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值接近基金合同规定的
不定期份额折算阈值1.500元,因此本基金管理人敬请投资者密切关注长盛中证申万一带一路
份额近期的基金份额净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、长盛中证申万一带一路A份额(场内简称:一带一A,基金代码:502014)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,长盛中证申万一带一路A份额的份额数和基金份额参考净值将不发生变化。

二、长盛中证申万一带一路B份额(场内简称:一带一B,基金代码:502015)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,长盛中证申万一带一路B份额的参考净值超过长盛中证申万一带一路A份额的参考净值的部分将会折算为长盛中证申万一带一路份额,份额折算后,长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值、长盛中证申万一带一路B份额的基金份额参考净值与折算基准日长盛中证申万一带一路A份额的基金份额参考净值三者相等。原长盛中证申万一带一路B份额的持有人在不定期折算后将持有长盛中证申万一带一路B份额和长盛中证申万一带一路份额。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。

三、由于长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路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变化相关的风险。

四、根据基金合同规定,折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值可能与触发折算阈值的1.500元有一定差异。

五、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申万一带一路B份额,在不定期份额折算后,折算新增的长盛中证申万一带一路份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将长盛中证申万一带一路B份额卖出,或者在折算后将新增的长盛中证申万一带一路份额卖出。

本基金管理人的其他重要提示:

1、基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改,取消分级运作机制,将长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额按照基金份额参考净值折算为长盛中证申万一带一路份额,并终止长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额的上市。敬请投资者关注相关风险以及基金管理人发布的相关公告,合理安排投资计划。

2、根据上海证券交易所的相关业务规则,场外份额经折算后的份额数保留到小数点后2位,由此误差产生的收益或损失计入基金财产;场内份额折算后的份额数将取整计算(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。

3、若本基金发生上述不定期份额折算情形,为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停相关份额的上市交易和长盛中证申万一带一路份额的赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

4、根据相关公告,本基金已暂停申购(含转换转入、定期定额投资)、转托管及场内分拆业务。

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《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》或者通过本基金管理人网站(www.csfund.com.cn)或客户服务电话(400-888-2666)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
2020年12月22日