

长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金可能发 生不定期份额折算的第十六次风险提示公告

根据《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之同瑞 B 份额(代码:150065)的基金份额参考净值跌至 0.250 元以下(含 0.250 元)时,本基金将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2015 年 7 月 31 日,本基金之同瑞 B 份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值 0.250 元,在此提请投资者密切关注同瑞 B 份额近期基金份额参考净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:

一、同瑞 A 份额、同瑞 B 份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。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。

二、本基金之同瑞 A 份额(代码:150064)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同瑞 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同瑞 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的同瑞 A 份额与较高风险收益特征的长盛同瑞 B 份额的情况,因此,同瑞 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

三、本基金之同瑞 B 份额(代码:150065)表现为预期风险高、预期收益高的特征,不定期份额折算后同瑞 B 份额将恢复到初始 1.667 倍杠杆水平。

四、根据合同规定,折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日同瑞 B 份额的基金份额参考净值可能与触发折算的阈值 0.250 元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为 1 份),场内的同瑞基金份额、同瑞 A 份额、同瑞 B 份额折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份),余额计入基金财产。持有极小数量同瑞基金份额、同瑞 A 份额、同瑞 B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

二、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

人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停同瑞 A 份额与同瑞 B 份额的上市交易和长盛同瑞份额的申购及赎回等相关业务。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。

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《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金招募说明书》或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 010-62350088)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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则, 在做出投资决策后, 基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险, 由投资者自行承担。投资有风险, 选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

长盛基金管理有限公司

2015 年 8 月 1 日