

# 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十八次风险提示公告

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 8 月 5 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](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。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 6 日