

关于长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

办理不定期份额折算业务的公告

根据《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）“二十二、分级运作期内基金份额的折算”的相关规定，当长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之同辉100B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2015年8月24日（R-1日），同辉100B份额的基金份额参考净值为0.242元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2015年8月25日（R日）为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

本次不定期折算的基准日为2015年8月25日（R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同辉份额（代码：160809）、同辉100A份额（代码：150108）和同辉100B份额（代码：150109）。

三、基金份额折算方式

当同辉100B份额的基金份额参考净值跌至0.250元以下时，本基金将分别对同辉基金份额、同辉100A份额和同辉100B份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保同辉100A份额和同辉100B份额的比例为1:1，份额折算后同辉基金份额的净值以及同辉100A份额和同辉100B份额的参考净值均调整为1.000元。

当同辉100B份额的参考净值跌至0.250元以下时，同辉基金份额、同辉100A份额和同辉100B份额将按照以下公式进行不定期折算。

1、同辉100B份额

份额折算原则：

份额折算前同辉100B份额的资产与份额折算后同辉100B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， $NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后同辉 100 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前同辉 100 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前同辉 100 B 份额的份额参考净值。

2、同辉 100A 份额

份额折算原则：

(1) 份额折算前后同辉 100A 份额与同辉 100B 份额始终保持 1:1 配比；

(2) 份额折算前同辉 100A 份额的持有人在份额折算后将持有同辉 100A 份额与新增场内同辉基金份额；

(3) 份额折算前同辉 100A 份额的资产等于份额折算后同辉 100A 份额的资产与其新增场内同辉基金份额的资产之和。

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

同辉100A份额持有人新增的场内同辉基金份额的份额数

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

其中， $NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后同辉 100A 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后同辉 100B 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前同辉 100A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前同辉 100A 份额的份额参考净值。

3、同辉基金份额

份额折算原则：

份额折算前同辉基金份额的资产与份额折算后同辉基金份额的资产（不含同辉 100A 份额折算后新增的同辉基金份额的资产）相等。

同辉基金份额持有人不定期折算后持有的同辉基金份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同辉}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中， $NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前同辉基金份额的份额数；

$NAV_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前同辉基金份额的净值。

不定期份额折算后同辉基金份额的份额数

=不定期份额折算前同辉基金份额持有人持有的不定期份额折算后同辉基金份额的份额数+ 同辉 100A 份额持有人新增的同辉基金份额的份额数

场内的同辉基金份额、同辉100A份额、同辉100B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。场外的同辉基金份额折算后的份额数四舍五入后保留到小数点后第2位，由此产生的误差计入基金财产。

四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，同辉基金份额的基金份额净值、同辉100A份额与同辉100B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，同辉基金份额的基金份额净值、同辉100A份额和同辉100B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元，则各持有同辉基金份额、同辉100A份额、同辉100B份额10,000份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
同辉基金份额	0.617元	10,000份	1.000元	6170份同辉基金份额
同辉100A份额	1.028元	10,000份	1.000元	2060同辉100A份额 +8220份同辉基金份额
同辉100B份额	0.206元	10,000份	1.000元	2060份同辉100B份额

五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即2015年8月25日）（R日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；同辉100A份额和同辉100B份额将于该日上午9:30-10:30停牌1小时，并于上午10:30之后复牌；该日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2015年8月26日）

（R+1日），本基金将暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务；同辉100A份额、同辉100B份额在该日停牌一天；本基金注册登记人及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2015年8月27日）

(R+2日)，基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；同辉100A份额和同辉100B份额于该日上午9:30-10:30停牌1小时，并于上午10:30之后复牌；自该日起，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015年8月27日（R+2日）同辉100A份额、同辉100B份额即时行情显示的前收盘价为2015年8月26日（R+1日）的其各自的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。2015年8月27日（R+2日）当日，同辉100A份额、同辉100B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、同辉100A份额、同辉100B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。

2、本基金之同辉100A份额（代码：150108）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辉100A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辉100A份额变为同时持有较低风险收益特征的同辉100A份额与较高风险收益特征的长盛同辉基金份额的情况，因此，同辉100A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

3、本基金之同辉100B份额（代码：150109）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辉100B份额将恢复到初始2倍杠杆水平，同辉100B份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日（2015年8月25日）当天买入，可能遭受重大损失，敬请投资者注意投资风险。

4、根据合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日同辉100B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。

5、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)，场内的同辉基金份额、同辉100A份额、同辉100B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。持有极小数量同辉基金份额、同辉100A份额、同辉100B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。

6、原同辉100A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内长盛同辉基金份额分拆为同辉100A份额和同辉100B份额，也可申请赎回此次折算获得的场内长盛同辉基金份额。

7、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辉100A份额与同辉100B份额的上市交易和长盛同辉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。

8、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《长盛同辉深证 100 等权重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。

9、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25日