

关于长盛同瑞中证 200 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”）“二十一、基金份额的折算”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），同瑞 B 份额的基金份额参考净值为 0.193 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瑞份额（代码：160808）、同瑞 A 份额（代码：150064）和同瑞 B 份额（代码：150065）。

三、基金份额折算方式

当同瑞 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元以下时，本基金将分别对同瑞基金份额、同瑞 A 份额和同瑞 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的比例为 4:6，份额折算后同瑞基金份额的净值以及同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

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

1、同瑞 B 份额

份额折算原则：

份额折算前同瑞 B 份额的资产与份额折算后同瑞 B 份额的资产相等。

其中，为折算后同瑞 B 份额的份额数；

为折算前同瑞 B 份额的份额数；

为折算前同瑞 B 份额的参考净值。

2、同瑞 A 份额

份额折算原则：

（1）份额折算前后同瑞 A 份额与同瑞 B 份额始终保持 4:6 配比；

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

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

其中，为折算后同瑞 A 份额的份额数；

为折算后同瑞 B 份额的份额数；

为折算前同瑞 A 份额的份额数；

为折算前同瑞 A 份额的参考净值。

3、同瑞基金份额

份额折算原则：

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

其中，为折算后同瑞基金份额的份额数；

为折算前同瑞基金份额的份额数；

为折算前同瑞基金份额的净值。

不定期份额折算后同瑞基金份额的份额数

=不定期份额折算前同瑞基金份额持有人持有的不定期份额折算后的同瑞基金份额的份额数+同瑞 A 份额持有人新增的同瑞基金份额的份额数

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。场外的同瑞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，同瑞基金份额的基金份额净值、同瑞 A 份额与同瑞 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，同瑞基金份额的基金份额净值、同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有同瑞基金份额、同瑞 A 份额、同瑞 B 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

同瑞基金份额

0.618 元

10,000 份

1.000 元

6180 份同瑞基金份额

同瑞 A 份额

1.236 元

10,000 份

1.000 元

1373 份同瑞 A 份额+10987 份同瑞基金份额

同瑞 B 份额

0.206 元

10,000 份

1.000 元

2060 份同瑞 B 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；同瑞 A 份额和同瑞 B 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；同瑞 A 份额、同瑞 B 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；同瑞 A 份额和同瑞 B 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）同瑞A份额、同瑞B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，同瑞A份额、同瑞B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。
- 2、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。
- 3、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，同瑞B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。
- 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。
- 6、原同瑞A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瑞份额拆分为同瑞A份额和同瑞B份额，也可申请赎回此次折算获得的场内长盛同瑞份额。
- 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。
- 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。
- 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