

# 长信基金管理有限责任公司关于长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金定期份额折算后长信一带一路份额和长信一带一路 A 份额前收盘价调整的公告

根据长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称本基金）基金合同、招募说明书及上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称本公司）以 2017 年 12 月 15 日为份额折算基准日，对长信一带一路份额的场外份额、场内份额以及长信一带一路 A 份额实施定期份额折算，现将相关事项公告如下：

## 一、份额折算结果

2017 年 12 月 15 日，场内的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额折算成的新增场内长信一带一路份额的份额计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），差额部分由基金资产承担。场外的长信一带一路份额折算成的新增场外长信一带一路份额的份额数保留到小数点后两位，差额部分由基金资产承担。份额折算比例精确到小数点后第六位，如下表所示：

基金份额名称	折算前份额（份）	份额折算比例	折算后份额（份）	折算后基金份额净值（元）
--------	----------	--------	----------	--------------

场外长信一带一路份额	15,568,815.88			
------------	---------------	--	--	--

	1.021781	15,907,920.26		
--	----------	---------------	--	--

	1.033			
--	-------	--	--	--

场内长信一带一路份额	396,624.00			
------------	------------	--	--	--

	1.021781	452,182.00	1.033	
--	----------	------------	-------	--

长信一带一路 A 份额	1,077,059.00	0.043562	1,077,059.00	1.000
-------------	--------------	----------	--------------	-------

新增长信一带一路份额：

	46,919.00			
--	-----------	--	--	--

注：场外长信一带一路份额经折算后产生新增的份额为场外长信一带一路份额；场内长信一带一路份额经折算后产生新增的份额为场内长信一带一路份额；长信一带一路 A 份额经折算后产生新增的份额为场内长信一带一路份额。

以上数据已经本基金的托管人广发证券股份有限公司确认。投资者自公告之日起可查询经注册登记机构及本公司确认的折算后份额。

## 二、恢复交易

自 2017 年 12 月 19 日起，本基金长信一带一路份额恢复申购（含定期定额投资）、赎回、转托管及配对转换业务；2017 年 12 月 19 日开市起，长信一带一路份额和长信一带一路 A 份额在上海证券交易所复牌。

## 三、风险揭示

### 1、基金份额的折/溢价交易风险

根据上海证券交易所相关规定 2017 年 12 月 19 日长信一带一路 A 份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2017 年 12 月 18 日长信一带一路 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），即 1.000 元。由于长信一带一路 A 份额折算前（12 月 15 日）存在溢价交易情形，长信一带一路 A 份额 2017 年 12 月 15 日的收盘价为 1.091 元，扣除约定收益后为 1.046 元（四舍五入至 0.001 元），与实施定期折算后 2017 年 12 月 19 日的前收盘价存在较大差异，长信一带一路 A 份额 2017 年 12 月 19 日当日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。

根据上海证券交易所相关规定，2017 年 12 月 19 日长信一带一路份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2017 年 12 月 18 日长信一带一路份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），即 1.027 元。由于长信一带一路份额折算前（12 月 15 日）存在溢价交易情形，长信一带一路份额 2017 年 12 月 15 日的收盘价为 1.059 元，与实施定期折算后 2017 年 12 月 19 日的前收盘价存在较大差异，长信一带一路份额 2017 年 12 月 19 日当日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。

### 2、基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失的风险。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），差额部分由基金资产承担。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

### 3、份额折算后新增份额可能面临无法赎回的风险

由于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代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资人赎回基金份额。因此，如果投资人通过不具备基金代销资格的证券公司购买长信一带一路 A 份额或长信一带一路 B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的长信一带一路份额并不能被赎回。

### 4、基金份额风险收益特征变化风险

由于长信一带一路 A 份额定期折算基准日参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内长信一带一路份额，折算后其份额持有人的风险收益特征将发生一定变化：由持有单一的预期风险低、预期收益低的长信一带一路 A 份额变为同时持有预期风险低、预期收益低的长信一带一路 A 份额与预期风险较高、预期收益较高的长信一带一路份额，敬请长信一带一路 A 份额持有人注意。

## 四、投资者可通过以下途径咨询有关详情

长信基金管理有限责任公司

客户服务专线：4007005566（免长话费）

网站：[www.cxfund.com.cn](http://www.cxfund.com.cn)

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。

长信基金管理有限责任公司

2017年12月19日