

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

办理定期份额折算业务的公告

根据《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及深圳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，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在 2019 年 11 月 29 日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、基金份额折算基准日

每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）11 月份最后一个交易日。本次定期折算的折算基准日为 2019 年 11 月 29 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中证金融地产份额（即基础份额，包括场外份额和场内份额，场内简称“金融地产”，基金代码：160814）、长盛中证金融地产 A 份额（以下简称“A 类份额”，场内简称“金融地 A”，基金代码：150281）。

三、基金份额折算方式

在折算基准日，本基金将按照以下规则进行基金的折算：基础份额和 A 类份额基金合同规定的份额参考净值计算规则进行计算；对于 A 类份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内基础份额。每两份基础份额将按一份 A 类份额获得新增基础份额的分配，场内基础份额持有人折算后获得新增场内基础份额，场外基础份额持有人折算后获得新增场外基础份额。

折算后 A 类份额和长盛中证金融地产 B 份额（以下简称“B 类份额”，场内简称“金融地 B”，基金代码：150282）的比例仍为 1:1，A 类份额参考净值调整为 1.000 元。

1) A 类份额

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

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

$$A \text{ 类份额折算后新增的基础份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后 A 类份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前 A 类份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前 A 类份额的参考净值；

$NAV^{\text{后}}$ 为折算后基础份额的份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ 为折算前基础份额的份额净值。

2) 定期份额折算不改变 B 类份额的基金份额参考净值及其份额数。

3) 基础份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

$$\text{原基础份额持有人定期折算后持有的基础份额的份额数为} = \frac{NUM^{\text{前}} \times NAV^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

其中，

$NAV^{\text{后}}$ 为折算后基础份额的份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ 为折算前基础份额的份额净值；

$NUM^{\text{前}}$ 为折算前基础份额的份额数。

场内的基础份额、A 类份额折算成的新增基础份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2019 年 11 月 29 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（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）及配对转换业务；A 类份额和 B 类份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值并进行份额折算。

2、份额折算基准日后的第一个工作日（即 2019 年 12 月 2 日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，A 类份额暂停交易，B 类份额正常交易。当日，本基金注册登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2019 年 12 月 3 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理赎回、转换、转托管（除场外转场内）、配对转换、场外申购业务，A 类份额恢复交易，B 类份额正常交易。（为保障持有人利益，本公司于 2019 年 3 月 9 日发布公告，自 2019 年 3 月 11 日起，暂停本基金场内大额申购，单日单个基金账户累计申购（含转换转入和定期定额投资）本基金的金额不应超过 1000 元，并暂停本基金份额的跨系统转托管（场外转场内）业务；于 2019 年 6 月 12 日发布公告，自 2019 年 6 月 14 日起暂停本基金场内申购业务，具体详见相关公告。）

上述安排如有调整，基金管理人将另行发布公告，具体详见基金管理人届时发布的相关公告。

五、重要提示

1、根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019 年 12 月 3 日 A 类份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2019 年 12 月 2 日 A 类份额的参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于 A 类份额份额折算前可能存在折溢价交易情形，且折算前（2019 年 11 月 29 日）的收盘价扣除约定应得收益后与 2019 年 12 月 3 日的前收盘价可能有较大差异，12 月 3 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

2、根据深圳证券交易所的相关业务规则，由于折算后新增场内基础份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产，折算前持有较少 A 类份额或基础份额数的持有人存在无法获得新增基础份额的可能。因此，上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者赎回或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

3、由于 A 类份额定期折算基准日约定应得收益将折算为场内基础份额分配给 A 类份额的持有人，而基础份额为跟踪中证金融地产指数的基金份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此 A 类份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

4、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销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买 A 类份额，在定期份额折

算后，则折算新增的基础份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将 A 类份额卖出，或者在折算后将新增的基础份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

5、投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.csfunds.com.cn 或者拨打本公司客服电话：400—888—2666。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长盛基金管理有限公司

2019年11月26日