

# 长盛同瑞中证 200 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《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》（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，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2020 年 1 月 2 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

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2020 年 1 月 2 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（基金代码为“160808”，基金简称为“长盛同瑞”）、同瑞 A 份额（基金代码为：“150064”，基金简称为“同瑞 A”）。其中，本公告所指的长盛同瑞份额即为基金合同约定的“同瑞基金份额”。

### 三、基金份额折算方式

同瑞 A 份额和同瑞 B 份额按照《基金合同》规定的净值计算规则进行净值计算，对同瑞 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每份长盛同瑞份额将按 0.4 份同瑞 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的份额配比保持 4:6 的比例。

对于同瑞 A 份额期末的约定应得收益，即同瑞 A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同瑞份额分配给同瑞 A 份额持有人。长盛同瑞份额持有人持有的每份长盛同瑞份额将按 0.4 份同瑞 A 份额获得新增长盛同瑞份额的分配。持有场外长盛同瑞份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同瑞份额的分配；持有场内长盛同瑞份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同瑞份额的分配。经过上述份额折算，同瑞 A 份额的参考净值和长盛同瑞份额的份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对同瑞 A 份额和长盛同瑞份额进行约定应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行同瑞 A 份额上一年度应得收益的定期份额折算时，计算公式如下：

(1) 同瑞 A 份额

定期份额折算后同瑞 A 份额的份额数=定期份额折算前同瑞 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{同瑞}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同瑞份额的资产净值} - (\text{每份同瑞A份额期末资产净值} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}}}$$

$$\text{同瑞A份额持有人新增的场内长盛同瑞份额的份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (\text{每份同瑞A份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{同瑞}}^{\text{后}}}$$

其中， $NAV_{\text{同瑞}}^{\text{后}}$  为折算后长盛同瑞份额的净值；

$NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}}$  为折算前长盛同瑞份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前同瑞 A 份额的份额数。

(2) 同瑞 B 份额

同瑞 B 份额的参考净值与份额数不进行定期折算。

(3) 长盛同瑞份额

$$NAV_{\text{同瑞}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同瑞份额的资产净值} - (\text{每份同瑞A份额期末资产净值} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}}}$$

$$\text{长盛同瑞份额持有人新增的长盛同瑞份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}} \times 0.4 \times (\text{每份同瑞A份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{同瑞}}^{\text{后}}}$$

其中， $NAV_{\text{同瑞}}^{\text{后}}$  为折算后长盛同瑞份额的净值；

$NUM_{\text{同瑞}}^{\text{前}}$  为折算前长盛同瑞份额的份额数。

定期份额折算后长盛同瑞份额的份额数

$$\begin{aligned} &= \text{定期份额折算前长盛同瑞份额的份额数} \\ &+ \text{同瑞 A 份额持有人新增的长盛同瑞份额的份额数} \\ &+ \text{长盛同瑞份额持有人新增的长盛同瑞份额的份额数} \end{aligned}$$

场内的长盛同瑞份额、同瑞 A 份额折算成的新增场内长盛同瑞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。场外的长盛同瑞份额折算成的新增场外长盛同瑞份额的份额数四舍五入后保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

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 2020 年 1 月 2 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；同瑞 A、同瑞 B 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 2020 年 1 月 3 日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，同瑞 A 暂停交易，同瑞 B 正常交易。当日，本基金注册登记人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 2020 年 1 月 6 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（含定期定额投资），同瑞 A 开市起恢复交易，同瑞 B 正常交易。

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《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》有关要求，2020 年 1 月 6 日同瑞 A 复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2020 年 1 月 3 日的同瑞 A 的份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于同瑞 A 折算前可能存在折溢价交易情形，且折算前的收盘价扣除约定收益后与 2020 年 1 月 6 日的前收盘价可能有较大差异，2020 年 1 月 6 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

2、由于场内的同瑞基金份额、同瑞 A 份额折算成的新增场内同瑞基金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，定期份额折算前持有较少同瑞 A 份额数或场内长盛同瑞份额数的份额持有人存在折算后无法获得新增场内长盛同瑞份额的可能性。

3、由于同瑞 A 份额定期折算基准日约定应得收益将折算为长盛同瑞份额分配给同瑞 A 份额的持有人，而长盛同瑞份额为跟踪中证 200 指数的基金份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此同瑞 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、为保障持有人利益，本公司于 2019 年 6 月 26 日发布公告，自 2019 年 6 月 26 日起，暂停本基金场内申购，并暂停本基金份额的跨系统转托管（场外转场内）业务，具体详见相关公告。

5、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同瑞 A，在定期份额折算后，则折算新增的长盛同瑞份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将同瑞 A 卖出，或者在折算后将新增的长盛同瑞份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

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](http://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 12 月 27 日