

长盛上证50指数分级证券投资基金 不定期份额折算公告

根据《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）中关于基金份额不定期折算的相关规定，当长盛上证50指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之长盛上证50份额（场内简称：上50分级，基金代码：502040）的基金份额净值超过1.500元以上（含1.500元，下同）时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2020年7月6日，本基金长盛上证50份额的基金份额净值为1.553元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及上海证券交易所、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2020年7月7日为基金份额折算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

本次不定期份额折算的基准日为2020年7月7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上证50份额（场内简称：“上50分级”，基金代码：502040）、长盛上证50B份额（场内简称：“上50B”，基金代码：502042）

三、基金份额折算方式

当长盛上证50份额的基金份额净值大于或等于1.500元时，长盛上证50B份额和长盛上证50份额按照如下公式进行份额折算：

1) 长盛上证50A份额（场内简称：上50A，基金代码：502041）

此类不定期份额折算不改变长盛上证50A份额的基金份额参考净值及其份额数。

2) 长盛上证50B份额（场内简称：上50B，基金代码：502042）份额折算原则：

①份额折算后长盛上证50B份额与长盛上证50A份额的份额数保持1:1配比；

②将长盛上证50B份额的基金份额参考净值超过长盛上证50A份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的长盛上证50份额；

③份额折算后长盛上证50份额的基金份额净值、长盛上证50B份额的基金份额参

考净值与折算基准日长盛上证50A份额的基金份额参考净值三者相等；

④份额折算前长盛上证50B份额的持有人在份额折算后将持有长盛上证50B份额与新增场内长盛上证50份额。

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

$$NAV_B^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

长盛上证 50B 份额持有人新增的场内长盛上证 50 份额的份额数

$$= \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - NAV_B^{\text{后}})}{NAV^{\text{后}}},$$

其中， $NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后长盛上证 50B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前长盛上证 50B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{后}}$ 为折算后长盛上证 50B 份额的参考净值；

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前长盛上证 50B 份额的参考净值，即折算基准日长盛上证 50B 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛上证 50A 份额的参考净值，即折算基准日长盛上证 50A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{后}}$ 为折算后长盛上证 50A 份额的参考净值；

$NAV^{\text{后}}$ 为折算后长盛上证 50 份额的份额净值。

经折算后长盛上证50B份额持有人新增的场内长盛上证50份额的份额数取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为1份，直至完成全部折算。

3) 长盛上证50份额折算原则：

场外长盛上证50份额持有人份额折算后获得新增场外长盛上证50份额，场内长盛上证50份额持有人份额折算后获得新增场内长盛上证50份额。

$$NAV^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NUM^{\text{前}} \times NAV^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

不定期份额折算后长盛上证50份额的份额数

=不定期份额折算前的长盛上证50份额持有人不定期折算后持有的长盛上证50份额的份额数+长盛上证50B份额持有人不定期份额折算后持有的场内长盛上证50份额的份额数

其中， $NAV^{\text{后}}$ 为折算后长盛上证50份额的份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ 为折算前长盛上证50份额的份额净值；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛上证50A份额的参考净值；

$NUM^{\text{后}}$ 为折算后长盛上证50份额持有人持有的份额；

$NUM^{\text{前}}$ 为折算前长盛上证50份额持有人持有的份额。

长盛上证50份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后2位，由此误差产生的收益或损失计入基金财产；长盛上证50份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为1份，直至完成全部折算。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即2020年7月7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、配对转换业务。长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额正常交易。该日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。本公司已于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。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2020年7月8日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，长盛上证50份额、长盛上证50B份额将于该日停牌一个交易日，长盛上证50A份额在该日正常交易。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及份额折算。

(三) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2020年7月9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。当日,本基金恢复办理场外申购(含定期定额投资)、赎回、转换、转托管(除场外转场内)、配对转换业务,长盛上证50份额、长盛上证50B份额将于该日开市起复牌。

(四) 2020年7月9日长盛上证50份额即时行情显示的前收盘价为2020年7月8日的长盛上证50份额的份额净值,2020年7月9日长盛上证50B份额即时行情显示的前收盘价为2020年7月8日的长盛上证50B份额的份额参考净值(四舍五入至0.001元)。2020年7月9日当日长盛上证50份额、长盛上证50B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、本基金长盛上证50份额、长盛上证50B份额将于2020年7月8日停牌1个交易日,并于2020年7月9日开市起复牌。

2、2020年7月6日长盛上证50份额的基金份额净值已上涨至1.500元以上,而折算基准日为2020年7月7日,因此,折算基准日长盛上证50份额的基金份额净值与触发折算的阈值(1.500元)可能有一定差异。

3、长盛上证50A份额表现为预期风险低、预期收益相对稳定的特征。当发生基金合同规定的上述不定期份额折算时,长盛上证50A份额份额数和基金份额参考净值将不发生变化。

4、长盛上证50B份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后将恢复到初始杠杆水平,其杠杆倍数将比折算前高。当发生基金合同规定的不定期份额折算时,长盛上证50B份额的参考净值超过长盛上证50A份额的参考净值的部分将会折算为长盛上证50份额,份额折算后,长盛上证50份额的基金份额净值、长盛上证50B份额的基金份额参考净值与折算基准日长盛上证50A份额的基金份额参考净值三者相等。原长盛上证50B份额的持有人在不定期折算后将持有长盛上证50B份额和长盛上证50份额。因此,持有人的风险收益特征将发生一定的变化,由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

5、由于长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额折算前可能存在

折溢价交易情形，不定期份额折算后折溢价率可能发生较大变化，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。

6、根据上海证券交易所的相关业务规则，场内的长盛上证 50 份额、长盛上证 50B 份额折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。

7、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长盛上证 50B 份额，在不定期份额折算后，则折算新增的长盛上证 50 份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将长盛上证 50B 份额卖出，或者在折算后将新增的长盛上证 50 份额卖出或转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

8、为保护持有人利益，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。

9、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《长盛上证50指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

10、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招募说明书或者通过本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）或客户服务电话（400-888-2666）咨询。

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。

长盛基金管理有限公司

2020年7月7日