

# 长盛中证全指证券公司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《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）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，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在 2020 年 11 月 30 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

根据本基金基金合同的规定，本基金基金份额定期折算基准日为每个会计年度（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 2020 年 11 月 30 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的长盛中证证券公司份额（即基础份额，包括场外份额和场内份额，场内简称“券商分级”，场内代码：502053）、长盛中证证券公司 A 份额（即 A 类份额，场内简称“券商 A”，场内代码：502054）。

### 三、基金份额折算方式

在折算基准日，A 类份额和基础份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算。

折算后 A 类份额和长盛中证证券公司 B 份额（即 B 类份额，场内简称“券商 B”，场内代码：502055）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

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

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

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。

定期折算后基础份额的份额数=原基础份额持有人定期折算后持有的基础份额数+A 类份额折算后新增的基础份额数

基础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；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），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

1、定期份额折算基准日（即 2020 年 11 月 30 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）及配对转换业务；场内基础份额、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础份额净值、A 类份额和 B 类份额的基金份额参考净值并进行基金份额折算。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 12 月 1 日），本基金

暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，场内基础份额和 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 2020 年 12 月 2 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。一般情况下，场内基础份额和 A 类份额将于该日开市起复牌，B 类份额正常交易。自该日起，本基金恢复办理赎回、转换转出、两类子份额合并业务。

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、基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于 2020 年底完成本基金的整改,取消分级运作机制,将长盛中证证券公司 A 份额与长盛中证证券公司 B 份额按照基金份额参考净值折算为长盛中证证券公司份额，并终止长盛中证证券公司 A 份额与长盛中证证券公司 B 份额的上市。敬请投资者关注相关风险以及基金管理人发布的相关公告，合理安排投资计划。**

2、根据上海证券交易所相关规定，2020 年 12 月 2 日 A 类份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2020 年 12 月 1 日 A 类份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于 A 类份额折算前可能存在折溢价交易情形，A 类份额折算前（2020 年 11 月 30 日）的收盘价扣除约定收益后与 2020 年 12 月 2 日的前收盘价可能有较大差异。A 类份额 2020 年 12 月 2 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。

3、根据上海证券交易所相关规定，2020 年 12 月 2 日场内基础份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2020 年 12 月 1 日场内基础份额的基金份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于场内基础份额折算前可能存在折溢价交易情形，且场内基础份额折算前（2020 年 11 月 30 日）的收盘价与 2020 年 12 月 2 日的前收盘价可能有较大差异。场内基础份额 2020 年 12 月 2 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。

4、根据上海证券交易所的相关业务规则，场内基础份额、A 类份额折算成的新增场内基础份额数取整计算（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。因此，折算前持有较少场内基础份额或 A 类份额的持有人存在无法获得新增场内基础份额的可能性。

5、本基金 A 类份额的约定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全指证券公司指数的基金份额，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。

6、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基础份额或 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基础份额或 A 类份额卖出，或者在折算后将新增的基础份额卖出。

7、根据相关公告，本基金本次折算前已暂停申购（含定期定额投资）、转换转入、转托管、场内分拆业务。

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

2020 年 11 月 25 日