

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

办理定期份额折算业务的提示性公告

根据《长盛同庆中证 800 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，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2014 年 5 月 21 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，本基金第二次基金份额定期折算基准日为分级运作期起始日满两年的对应日，若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

本基金分级运作期起始日为 2012 年 5 月 22 日（周二），其满两年的对应日为 2014 年 5 月 21 日（周三），故本基金第二次定期折算基准日为 2014 年 5 月 21 日（周三）。

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同庆份额（代码：160806），同庆 800A 份额（代码：150098）和同庆 800B 份额（代码：150099）。其中，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额即为基金合同中约定的同庆 A 份额和同庆 B 份额。

三、基金份额折算方式

1、同庆 800B 份额折算基准日的参考净值达到 1.000 元以上的情形

若在折算基准日，同庆 800B 份额的参考净值达到 1.000 元以上，本基金将按照以下规则进行基金的折算：同庆 800A 份额和同庆 800B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算；对于同庆 800A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日同庆 800A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 800A 份额持有人；定期折算基准日同庆 800B 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 800B 份额持有人；场外长盛同庆份额持有人折算后获得新增场外长盛同庆份额，场内长盛同庆份额持有人折算后获得新增场内长盛同庆份额。

折算后同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的比例仍为 4:6，份额折算后长盛同庆份额的净值以及同庆 800A 份额、同庆 800B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

(1) 同庆 800A 份额

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

$$\text{同庆800A份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后同庆 800A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前同庆 800A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前同庆 800A 份额的参考净值。

(2) 同庆 800B 份额

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

$$\text{同庆800B份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后同庆 800B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前同庆 800B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前同庆 800B 份额的参考净值。

(3) 长盛同庆份额

$$\text{长盛同庆份额持有人定期折算后持有的长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{1.000}$$

定期份额折算后长盛同庆份额的份额数

= 同庆 800A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

+ 同庆 800B 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

+ 长盛同庆份额持有人定期份额折算后持有的长盛同庆份额的份额数

其中，

$NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同庆份额的净值；

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

场内的长盛同庆份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额折算成的新增场内长盛同庆份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），场外的长盛同庆份额折算成的新增场外长盛同庆份额的份额数保留到小数点后两位，以循环进位方式分配因运算产生的剩余份额。

2、同庆 800B 份额折算基准日的参考净值处于 1.000 元及以下的情形

若在折算基准日，同庆 800B 份额的参考净值处于 1.000 元及以下，本基金将按照以下规则进行基金的折算：同庆 800A 份额和同庆 800B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算；对于同庆 800A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日同庆 800A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 800A 份额持有人；同庆 800B 份额的参考净值和份额数不进行折算；长盛同庆份额持有人持有的每份长盛同庆份额将按持有 0.4 份同庆 800A 份额获得新增长盛同庆份额的分配，场外长盛同庆份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同庆份额的分配，场内长盛同庆份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同庆份额的分配。

经过上述份额折算，同庆 800A 份额的参考净值和长盛同庆份额的净值将相应调整。

(1) 同庆 800A 份额

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

$$NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同庆份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}}$$

$$\text{同庆800A份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}}}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后同庆 800A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前同庆 800A 份额的份额数；

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

$NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}}$ 为折算后长盛同庆份额的净值；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前同庆 800A 份额的参考净值。

(2) 同庆 800B 份额

当同庆 800B 份额折算基准日的参考净值处于 1.000 元及以下时，定期份额折算不改变同庆 800B 份额的参考净值及其份额数。

(3) 长盛同庆份额

$$NAV_{同庆}^{后} = \frac{\text{折算前长盛同庆份额的资产净值} - (NAV_A^{前} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{同庆}^{前}}{NUM_{同庆}^{前}}$$

$$\text{长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_{同庆}^{前} \times 0.4 \times (NAV_A^{前} - 1.000)}{NAV_{同庆}^{后}}$$

定期份额折算后长盛同庆份额的份额数
= 定期份额折算前长盛同庆份额的份额数
+ 同庆 800A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数
+ 长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

其中，

$NAV_{同庆}^{后}$ 为折算后长盛同庆份额的净值；

$NAV_A^{前}$ 为折算前同庆 800A 份额的参考净值；

$NUM_{同庆}^{前}$ 为折算前长盛同庆份额的份额数。

场内的长盛同庆份额、同庆 800A 份额折算成的新增场内长盛同庆份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），场外的长盛同庆份额折算成的新增场外长盛同庆份额的份额数保留到小数点后两位，以循环进位方式分配因运算产生的剩余份额。

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 2014 年 5 月 21 日），本基金暂停办理长盛同庆份额的申购、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；同庆 800A 份额和同庆 800B 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 2014 年 5 月 22 日），本基金长盛同庆份额暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，同庆 800A 份

额暂停交易，同庆 800B 份额如需折算，则也暂停交易。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 2014 年 5 月 23 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，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，同庆 800A 份额恢复交易，同庆 800B 份额如果因折算已暂停交易，则也恢复交易。

4、根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2014 年 5 月 23 日同庆 800A 份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2014 年 5 月 22 日同庆 800A 份额的参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于同庆 800A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，且折算前（2014 年 5 月 21 日）的收盘价扣除分级运作期第 2 年约定应得收益后与 2014 年 5 月 23 日的前收盘价可能有较大差异，5 月 23 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

同庆 800B 份额如需折算，2014 年 5 月 23 日其复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2014 年 5 月 22 日同庆 800B 份额的参考净值（四舍五入至 0.001 元）；5 月 23 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。同庆 800B 份额如果不需要折算，其前收盘价不做调整。

五、重要提示

1、由于折算后新增场内长盛同庆份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），折算后新增场外长盛同庆份额的份额数保留到小数点后两位，这样，折算前持有较少同庆 800A、同庆 800B 或长盛同庆份额数的持有人存在无法获得新增长盛同庆份额的可能。

2、由于同庆 800A 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盛同庆份额，折算后其份额持有人的风险收益特征将发生一定变化：由持有单一的低风险、收益相对稳定的份额变为同时持有低风险、收益相对稳定的份额与较高风险、较高收益的份额，敬请同庆 800A 份额持有人注意。

3、同庆 800B 份额如需折算时，由于其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盛同庆份额，折算后其份额持有人的风险收益特征将发

生一定变化：由持有单一的高风险、积极收益类的份额变为同时持有高风险、积极收益类的份额与相对较高风险、较高收益的份额，敬请同庆 800B 份额持有人注意。

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

2014年5月14日