长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金召开基金份额持有人大会第四次提示性公告

长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2012年3月9日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（http://www.szse.cn）和基金管理人网站（http://www.csfunds.com.cn）发布了《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》，于2012年3月12日在上述报纸和网站上发布了《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金召开基金份额持有人大会第一次提示性公告》；于2012年3月14日在《中国证券报》和上述网站上发布了《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金召开基金份额持有人大会第二次提示性公告》；于2012年3月19日在《上海证券报》和上述网站上发布了《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金召开基金份额持有人大会第三次提示性公告》。

为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第四次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“长盛同庆基金”）的基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以现场方式召开长盛同庆基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

（一）会议召开时间：2012年4月10日上午9时30分

（二）会议召开方式：现场方式

（三）会议召开地点：北京春晖园国际会议中心（北京市顺义区高丽营镇高泗路于庄段37号）

二、会议审议事项

关于长盛同庆基金转型有关事项的议案（见附件一）。

三、会议的议事程序和表决方式

（一）大会主持人宣布会议开始。

（二）大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人所持有基金份额的总数。

（三）大会主持人公布计票人、监票人、见证律师、公证机构和公证员。

（四）大会主持人宣读议案。

（五）大会主持人宣布会议议事程序及注意事项。

（六）与会人员对议案进行审议，并进行表决。

（七）计票人在基金份额持有人表决后立即进行清点，监票人对此进行监督，公证员对计票过程予以公证。

（八）大会主持人当场公布计票结果。

（九）大会见证律师就本次会议召开的程序以及持有人大会形成的决议的合法性、合规性发表法律意见。

四、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2012年4月5日，即在2012年4月5日深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）登记在册的长盛同庆基金（包括同庆A、同庆B）全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件

（一）个人基金份额持有人出席会议的，需要提交本人开立持有长盛同庆基金份额的证券账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

（二）个人基金份额持有人委托他人出席会议的，需要提交基金份额持有人签字的授权委托书（内容及格式参考本公告附件二）和基金份额持有人开立持有长盛同庆基金份额的证券账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），和代表单位出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

（三）机构基金份额持有人委托他人出席会议的，需要提交该机构开立持有长盛同庆基金份额的证券账户所使用的加盖单位公章的企业营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），和代表单位出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），和代表受托机构出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件及单位授权委托书。

六、会议出席对象

（一）2012年4月5日（权益登记日）深交所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的长盛同庆基金（包括同庆A、同庆B）的基金份额持有人或其代理人。

（二）基金管理人代表。

（三）基金托管人代表。

（四）基金管理人聘请的见证律师。

（五）基金管理人聘请的公证机关人员。

七、基金份额持有人大会预登记

（一）现场方式预登记：基金份额持有人采用现场方式进行预登记的，应当按照本公告第五条的规定提供相关资料。现场方式预登记地址：北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20层长盛基金管理有限公司直销中心；联系人：张雪、张晓丽。

（二）传真方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人可凭上述资料的传真件向基金管理人进行预登记，传真号为010-82274065（确认电话为010-82019859），传真号为010-82019966（确认电话为010-82019965）。

（三）预登记时间：2012年3月12日—2012年3月16日，2012年3月19日—2012年3月23日，2012年3月26日—2012年3月30日，每天上午9:00-下午4:00。基金管理人将为基金份额持有人办理现场方式预登记或传真方式预登记。

（四）关于预登记的说明：基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况，以便为持有人大会召开进行相应准备。持有人大会会议人场前仍需按照本公告第五条的规定提供相关资料办理现场会议登记，请各基金份额持有人予以积极配合。

八、会议召开的条件

对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。

到会的基金份额持有人身份证明、代理人身份证明、委托人授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规、会议通知的规定，并且与基金管理人持有的注册登记资料相符。

九、形成基金份额持有人大会决议的条件

（一）基金份额持有人大会的审议事项应分别由同庆A、同庆B基金份额持有人独立进行表决。同庆A、同庆B基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

（二）基金份额持有人在表决票上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。未填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持股份数的表决结果均计为“弃权”。

（三）关于长盛同庆基金转型有关事项的议案应当同时经参加大会的同庆A和同庆B各自的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

十、重要提示

（一）本次会议将于2012年4月10日上午9:30召开，届时基金管理人、基金托管人和基金管理人聘请的见证律师和基金管理人聘请的公证机关人员将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件于上午8:00之前到达会议地点，以便验证入场。会议登记截止时间为当日上午9:20。登记截止后，不再对未登记的基金份额持有人进行登记，未登记的持有人不得入场参加会议。

（二）基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人（或代理人）、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场，对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

（三）特别提醒各位基金份额持有人在进行预登记及会议现场登记时，需要提供的是开立持有长盛同庆基金份额的证券账户所使用的身份证件及（或）其复印件，如若开立有多个账户且使用的是不同的身份证件，需要分别提供各账户对应的身份证件及（或）其复印件。

（四）如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

（五）基金管理人将向深交所申请同庆A、同庆B自2012年4月6日开始停牌。基金管理人将于基金份额持有人大会决议公告后向深交所申请复牌。

（六）基金管理人将在基金份额持有人大会召开前发布提示性公告和通知，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

（七）本公告的有关内容由长盛基金管理有限公司解释。

十一、持有人大会咨询方式

联系机构：长盛基金管理有限公司客服中心

联系电话：400-888-2666

Email：tqfund@csfunds.com.cn

长盛基金管理有限公司
二〇一二年三月二十六日

附件一：《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《授权委托书》

附件三：《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型方案说明书》

附件一：

关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人：

鉴于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“长盛同庆基金”）封闭期将于2012年5月11日到期，为维护基金持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》有关规定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对长盛同庆基金实施转型。转型方案说明见附件三《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型方案说明书》。

同时，为实施长盛同庆基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次长盛同庆基金转型的有关具体事宜，并可在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》进行其它必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：长盛基金管理有限公司
二〇一二年三月九日

附件二：

授权委托书

兹委托_____先生/女士/机构代表本人/本机构出席于2012年4月10日召开的长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。本委托可以转委托、再转委托。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码：

证券账户卡号：

受托人：

受托人证件号码：

受托单位（签章）：

委托日期：年 月 日

附注：（1）本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人在开立持有长盛同庆基金所有份额的证券账户时所使用的证件号码。（2）“证券账户卡号”，仅指持有长盛同庆基金份额的证券账户卡号，同一基金份额持有人拥有多个此类证券账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写证券账户卡号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的长盛同庆基金所有份额。（3）此授权委托书剪报、复印或按以上格式或内容自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件三：

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型方案说明书

一、重要提示

（一）鉴于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（简称“长盛同庆基金”）封闭期将于2012年5月11日到期，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）等有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论关于长盛同庆基金转型有关事项的议案。

（二）本次长盛同庆基金转型方案应当同时经参加大会的同庆A和同庆B各自的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，故本转型方案存在无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

（三）特有人大会表决通过的事项需报告中国证监会，自中国证监会核准之日起生效。中国证监会对本次长盛同庆基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或者投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、长盛同庆基金转型方案要点

（一）更名

基金名称由“长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金”更名为“长盛同庆中证800指数分级证券投资基金”。

（二）转换基金运作方式

长盛同庆基金由封闭式分级基金转型为开放式分级证券投资基金。新增如下内容：

1.长盛同庆基金封闭期到期后基金份额的转换

长盛同庆基金封闭期到期后，同庆A份额和同庆B份额将按照长盛同庆基金基金合同所约定的资产收益分配规定分别计算封闭期末净值，并采用份额比例折算的方式以各自份额的净值转换成长盛同庆份额。转换后，同庆A份额和同庆B份额基金份额持有人持有的基金份额数按照转换规则相应增加或减少。

转换完成后，基金管理人将向深圳证券交易所申请终止同庆A份额与同庆B份额的上市交易。

2.赎回限定期

同庆A份额和同庆B份额完成封闭期到期转换后，本基金将对转换得到的长盛同庆份额设定5个工作日的赎回期间，该期间即为赎回限定期。在赎回限定期内可申购、赎回长盛同庆份额。

3.分级运作方式

（1）分级运作期

赎回限定期结束后，本基金设立分级运作期，进入开放式分级运作阶段。分级运作期设为三年，自赎回限定期到期后第一个工作日开始，至满三年的对应日结束，如该对应日为非工作日，则该分级运作期到期日顺延至下一个工作日。

（2）基金份额的分级

在分级运作期起始日，在基金资产净值不发生变化的基础上，本基金将长盛同庆份额净值折算为1.000元。相应地，长盛同庆份额的份额数按折算比例相应调整。在完成长盛同庆份额的折算后，场内长盛同庆份额将按照4:6的比例分拆成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳定收益类基金份额（即“同庆A份额”）和积极收益类基金份额（即“同庆B份额”），两类基金份额的资产合并运作。

在分级运作期内，同庆A份额和同庆B份额将向深圳证券交易所申请上市交易；场内与场外长盛同庆份额开放申购、赎回业务；场内的长盛同庆份额、同庆A份额和同庆B份额开放配对转换业务。

分级运作期内，本基金净资产优先确保同庆A份额的本金及同庆A份额的累计约定日应得收益，之后的剩余净资产计为同庆B份额的净资产。同庆A份额约定年收益率RA为：“一年期同期银行定期存款利率（税后）+3.5%”，一年期同期银行定期存款利率以分级运作期起始日或基金份额定期折算基准日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。约定年收益均以1.000元为基准进行计算。

（3）基金份额的折算

在目分级运作期起始日后满一年和满两年的对应日（若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日），本基金将对长盛同庆份额、同庆A份额、同庆B份额进行基金份额的定期折算：同庆A份额的约定应得收益，即定期折算基准日同庆A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A份额持有人；同庆B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B份额持有人（若同庆B份额参考净值小于等于1.000元，则不进行折算）；长盛同庆份额持有人持有的每10份长盛同庆份额将按持有4份同庆A份额和6份同庆B份额获得新增长盛同庆份额的分配，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。

在分级运作期内，当同庆B份额的参考净值跌至0.250元以下，本基金还将在以下情况进行不定期份额折算，份额折算后同庆A份额和同庆B份额的比例始终保持为4:6，长盛同庆份额的净值以及同庆A份额和同庆B份额的参考净值均调整为1.000元。

（4）分级运作期到期

分级运作期到期后，同庆A份额和同庆B份额在按照基金合同所约定的参考净值计算规则分别计算分级运作期期末参考净值后，按照各自的份额参考净值转换为上市型开放式基金（LOF）份额。

（三）调整基金的投资

1.投资目标

调整前为：

“本基金投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票，力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。”

调整后为：

“本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，以实现对中证800指数的有效跟踪。”

2.投资范围

调整前为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金类别资产配置比例为：封闭期内股票投资占基金资产的比例为60%-100%，债券投资占基金资产的0%-40%；封闭期后股票投资占基金资产的比例为60%-95%，债券投资占基金资产的5%-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，权证投资比例占基金资产净值的比例不高于3%。”

调整后为：

“本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（如须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%，其中投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。”

3.投资理念

调整前为：

“充分把握中国经济的高速发展时期，分享中国业绩优良型企业的发展成果，是本基金的核心投资理念“价值—收益”。在此理念驱动的基础上，通过对上市公司进行深入的投资价值分析，基于对上市公司的行业竞争优势、业绩预期表现、成长价值的权衡，精选中长期业绩持续增长且价值被低估的价值型股票作为主要投资对象。”

调整后为：

“中国经济持续稳定的增长为中国证券市场的发展奠定了坚实的基础。本基金以复制、跟踪中证800指数为原则，进行指数化长期投资，指数化的投资方式可以获取指数所代表市场的平均收益，并通过充分的分散化投资实现非系统风险的有效降低和流动性的提高，为投资者谋求利益最大化。”

4.标的指数

新增标的指数：“本基金股票资产跟踪的标的指数为中证800指数。

中证800指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数。其成份股由中证500和沪深300成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

如果中证800指数被停止编制及发布，或中证800指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在中国证监会指定的媒体上公告。”

5.投资策略

调整前为：

“本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，将科学严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，通过优选业绩优良、成长性稳定、在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资，以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下，进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置，同时根据对上市公司充分的基本面分析，挖掘行业中的价值个股。

1.战略资产配置

本基金采用“自上而下”的战略资产配置体系，结合定性分析和定量分析，形成对不同市场的预测和判断，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

2.行业资产配置

本基金将通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，并据此对基金股票投资资产的行业分布进行动态调整。特别是对于国民经济增长中的重点支柱行业，受国家政策鼓励扶持的优势行业，以及受国内外宏观经济运行有利因素影响行业景气良好的行业，为本基金重点投资的行业。

3.股票选择

本基金的股票投资中将以价值收益型股票投资为主导，把企业的创造价值能力作为选择投资对象的最核心标准。利用数量化的投资分析方法和价值投资思路，对市场运行特征进行跟踪，确保基金投资决策的科学性。

价值收益型企业的主要选择标准是：

（1）行业竞争优势明显，企业属于国民经济增长中的重点支柱行业，或受国家政策鼓励扶持的优势行业，以及受国内外宏观经济运行有利因素影响行业景气良好的行业，具有较强的核心竞争优势。

（2）行业发展状况良好，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；企业成长性较好，市场竞争能力强，主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

（3）企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高，现金流创造能力强，资产盈利水平较高；企业财务状况良好，各项指标健康，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

第一步，定量指标筛选股票，构建基础股票池

（1）主营收入增长率

过去三年或未来两年的主营业务收入的增长率超过GDP增速

（2）主营利润增长率

过去三年或未来两年税后盈余复合增长率超过GDP增速

（3）资产回报率

过去三年或未来两年ROE持续增长或高于行业平均水平

（4）管理水平

存货周转率、应收账款周转率以及固定资产周转率任意两项过去三年和未来两年接近或超过行业平均水平。

满足上述四项指标中之三项，即认为符合条件，通过筛选构建基础股票池。

第二步，在基础股票池中进一步定量筛选，构建核心股票池

（1）主营利润增长率

过去三年或未来两年税后盈余复合增长率超过GDP增速1.5倍

（2）资产回报率

过去三年或未来两年ROE高于行业平均水平1.5倍

同时满足上述两项指标，即认为符合条件，通过筛选构建核心股票池。

第三步，定性指标精选个股

运用以下两个定性指标对核心股票池中的个股的管理能力和公司治理结构进行考核，从中精选经营管理效率高、公司治理结构完善的公司作为投资目标。

（1）管理能力

综合评定存货周转率、应收账款周转率以及固定资产周转率任意两项过去三年或未来两年至少要符合行业特征；

（2）公司治理结构

无不良过往记录，控股股东没有损害上市公司利益的行为；

外部董事在董事会的占比较高；

股东大会、董事会、监事会、管理层的责、权、利明晰。

4.债券选择

本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。运用数量化分析决策工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。

在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

（1）久期控制策略，是指根据基本价值、经济环境和市场风险评估，以及基金债券投资对风险收益的特定要求，确定债券组合的久期配置。

（2）收益率曲线策略，是指在评估均衡收益率水平和均衡收益率曲线合理形态的基础上，通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，评估不同剩余期限下的价值偏离程度，在满足既定的组合久期要求下，根据风险调整后的预期收益率大小进行配置。

（3）类别选择策略，是指在国债、金融债、企业债和次级债等债券类别间的配置。债券类别间估值比较基于类别债券市场基本因素的数量化分析（包括利差波动、信用转变概率、流动性等数量分析），在遵循价格内在价值原则下，根据类别资产间的利差合理性进行债券类别选择。

（4）个券选择策略，是指通过自下而上的债券分析流程，鉴别出价值被市场误估的债券，择机投资低估债券，抛出高估债券。

在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。

5.权证选择

本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。”

调整后为：

“本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证800指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

1.资产配置策略

本基金采用两层资产配置策略，首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例，再进一步以抽样复制基准指数的方法，确定抽样组合中各股票的配置比例。本基金股票资产原则上不低于基金资产净值的90%，在巨额申购赎回发生，成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

2.股票投资组合构建

本基金通过抽样复制指数的方法，在综合考虑个股的自由流通市值规模、个股流动性、行业代表性、波动性以及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上，采用“分层抽样+优化抽样”的方法，选择标的指数成份股票或被选成份股票构建基金的抽样股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股配置比例。

（1）股票筛选

本基金在抽样复制指数投资时，首先进行样本成份股初步筛选，通常初步筛选的股票样本为标的指数全部成份股和备选成份股，作为下一步分层抽样的基础。但在特殊情况下，如指数成份股调整、长期停牌或样本个股流动性极差时，则相应调整股票初选股票样本或剔除流动性极差的股票样本。

（2）分层抽样

在标的指数成份股中初选出样本股票的基础上，首先按照通用的行业分类方法进行类别划分，然后根据每个行业中个股的流通市值权重、所在行业中的权重比例、个股收益波动性和行业收益相关性进行抽样选取，原则上优先抽取收益波动与标的指数高度相关的个股。

在分层抽样中，首先控制约束抽样股票组合中的行业比例及收益风险特征代表性与标的指数一致，且控制抽样组合中的行业内样本个股与行业整体的收益风险特征高度相关。

（3）优化抽样

对于分层抽样后的股票样本组合，采用进一步优化方法并确定个股的权重，考虑标的指数总体收益和风险的特征情况，基于标的指数的跟踪误差限制为约束指标，通过投资组合优化模型构建基金的股票资产组合。

（4）最终组合

对于“分层抽样+优化抽样”方法得到的股票组合，将被用来构建本基金的最终股票组合。为了能够更好的跟踪标的指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。

3.股票组合调整

（1）组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

（2）组合调整方法

①跟踪调整

A.定期性调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合，将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。

B.不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，并根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

C.基于流动性及法律法规限制的调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制，使得基金管理人无法顺利购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性”原则，对于需要进行替代的股票，其替代股票将从标的指数样本或被选成份股中选取，具体将在考虑股票流动性等因素的前提下，在同行业范围内，选取相关性较大的股票进行替代。

D.在其他不影响指数复制的情况下，本基金管理人可以根据市场情况，在跟踪误差最小化的条件下，对基金资产组合进行适当的调整。

4.债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5.权证投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则对权证进行投资，即根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。”

6.业绩比较基准

调整前为：“本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%”

调整后为：“本基金业绩比较基准=95%×中证800指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）”。

（四）调整费率及费率结构

1.申购费率

调整前为：

金额M，单位：元）	费率（%）
M<50万	1.50%
50万≤M<200万	1.00%
200万≤M<500万	0.80%
M≥500万	按笔收取，1000元/笔

调整后为：

金额M，单位：元）	费率（%）
M<50万	1.20%
50万≤M<200万	0.80%
200万≤M<500万	0.40%
M≥500万	按笔收取，1000元/笔

2.赎回费率

调整前为：“场内和场外的赎回费率为0.5%”

调整后为：

	持有基金份额期限（P）	收费标准
场外赎回费率	P<1年	0.50%
	1年≤P<2年	0.25%
	P≥2年	0
场内赎回费率	场内赎回费率统一为0.50%	

3.基金管理人的管理费

调整前为：“在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。”

调整后为：“在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。”

4.基金托管人的托管费

调整前为：“在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。”

调整后为：“在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。”

（五）授权基金管理人修订基金合同

首先，由于长盛同庆基金拟转换运作方式，基金管理人需根据持有人大会决议以及转换后基金运作方式的特点相应修订《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的相关内容。

其次，自《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其实施准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据法律法规要求修订《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的相关内容。

再次，长盛同庆基金转型后，基金运作方式、投资范围、投资策略发生相应变更，基金管理人拟将基金名称变更为“长盛同庆中证800指数分级证券投资基金”。

综上所述，拟请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订基金合同的内容，并在经基金托管人审核同意后，报中国证监会核准。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）长盛同庆基金基本情况

长盛同庆基金遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于2009年03月06日获中国证监会证监行政许可[2009]209号文批准募集。

长盛同庆基金基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金管理人于2009年5月12日获得中国证监会书面确认，长盛同庆基金合同生效，基金规模达146.86亿份基金份额。长盛同庆基金基金合同生效后，封闭期为三年，自基金合同生效之日起至三年后对应日止，封闭期到期后将进行基金转型。

（二）长盛同庆基金运作方式转型的必要性

由于长盛同庆基金的产品设计及发行较早，设有固定的封闭期限。为延续分级基金模式，在封闭期到期日前平稳过渡并维护持有人利益，有必要召开持有人大会，将长盛同庆基金转型为开放式分级基金。长盛同庆基金转型的必要性主要有以下几点：

1.充分保护持有人的利益

长盛同庆基金三年封闭期将于2012年5月11日到期，在到期转型过程中我司将会充分考虑各种因素，把保护持有人利益作为首要前提，做到平稳过渡。特别是拟转型的开放式分级基金模式，也将会在收益分配机制、投资策略及跟踪标的等方面做出修改和完善，尽可能满足原持有人对投资收益及交易流动性的诉求，并为新的投资者提供便利的投资条件。

2.顺应新政策法规对分级基金产品的要求

证监会为规范分级基金产品的设计和发行，在广泛征求各方意见后，对分级基金的募集方式、申购赎回、份额杠杆率以及分拆折算规则等进行了统一规范，并提出了分级基金产品开发的主要审核框架。

为长盛同庆基金的后续运作符合证监会要求，满足市场投资者对分级基金的投资需求，结合目前市场上同类分级基金的设计及运作模式，我司提出了长盛同庆基金的封闭期到期转型方案。

3.满足市场及投资者对流动性和交易的需求

长盛同庆基金为三年期的封闭式基金，同庆A份额和同庆B份额保持4:6的配比，封闭期到期后同庆A份额和同庆B份额转换为上市开放式基金（LOF）。长盛同庆基金设计较早，采用封闭式运作，基金份额持有人不能够在封闭期内申赎赎回，只能采取二级市场交易来实现流动性需求。因此，为进一步满足份额持有人对流动性和交易的需求，有必要将长盛同庆基金转型为开放式分级基金模式。

（三）长盛同庆基金转换为开放式基金的可行性

1.长盛同庆基金转型方案不存在法律障碍

依照《基金法》第六十五条规定，“按照基金合同的约定或者基金份额持有人大会的决议，并经国务院证券监督管理机构核准，可以转换基金运作方式。”，这为转型的可行性提供了法律依据。同时，在《基金法》第七十二条到第七十五条对基金持有大会的召集人、召开形式以及通过决议所需比例都作了详细的规定。

2.长盛同庆基金转型方案不存在技术障碍

长盛同庆基金流程简洁，技术简单。经过与深圳证券交易所、中国证券登记结算公司、中国建设银行股份有限公司的沟通和协作，在转型的份额折算转换、申购赎回、配对转换等流程及技术方面，已经全面做好了准备工作。

3.绝密的制度安排是转型方案能够得到顺利实现的根本保证

长盛同庆基金转型方案是在与相关各方进行广泛沟通的基础上制定出的切实可行的方案。此次转型方案不仅仅包括基金运作方式的转换，更重要的是营销安排计划和吸引新投资人、保护原有投资人利益的制度安排。

（四）授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同需经基金管理人和基金托管人签字盖章，报中国证监会核准。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，在履行相关程序后对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可以在必要的情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果转型方案未获得持有人大会批准，基金管理人将不再召开持有人大会，基金将按原合同规定延续。

（二）基金转型后遭遇大规模赎回的风险

在封闭期内，部分长盛