长盛基金管理有限公司关于以通讯方式召开长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2020年9月28日在《证券时报》及长盛基金管理有限公司网站（http://www.csfunds.com.cn）发布了《关于以通讯方式召开长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布《关于以通讯方式召开长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。

一、召开会议基本情况

长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可〔2015〕758号文募集的长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同已于2015年5月29日生效。本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“长盛中证申万一带一路分级”（场内简称“一带一路”，基金代码“502013”）；分级份额包括“长盛中证申万一带一路指数分级A”（场内简称“一带一A”，基金代码“502014”）和“长盛中证申万一带一路指数分级B”（场内简称“一带一B”，基金代码“502015”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型有关事项的议案，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2020年9月28日起至2020年10月28日17:00止（投票表决时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）。

3、会议书面表决票的寄达地点及联系方式如下：

收件人：北京市方圆公证处

办公地址：北京市东城区东水井胡同5号A511办公室

公证员：王一雪　工作人员：王博

电话：（010）85197608、85197562

传真：（010）85197550

邮政编码：100010

请在信封表面注明：“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4. 投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-2666（免长途话费）咨询。

二、会议审议事项

《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（详见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型方案的说明》（详见附件二）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年9月28日，权益登记日下午上海证券交易所交易时间结束后，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额）均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、投票方式

1、本次会议表决票详见附件三。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务公章（以下统称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（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）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人书面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权（三）授权方式　1、书面方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在前述会议投票表决起止时间内（以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）通过专人送交、快递或邮寄挂号信方式送达至本基金管理人委托的公证机关的办公地址，并请在信封表面注明：“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次基金份额持有人大会，使基金份额持有人在本次基金份额持有人大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以登记机构的登记为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使，基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人或基金托管人为受托人。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过书面、电话等法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人通过书面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件四。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（http://www.csfunds.com.cn/）下载等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人无论通过书面方式授权还是通过非书面方式授权的，授权形式及程序均应符合本公告的规定。

1、书面方式授权

（1）基金份额持有人进行书面授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）对基金管理人、基金托管人或销售机构的书面授权文件的送达

基金份额持有人通过书面方式对基金管理人、基金托管人或销售机构进行授权的，可通过邮寄授权文件或在基金管理人或销售机构柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人。

基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人、基金托管人或销售机构的柜台办理授权，填写授权委托书，并提交基金份额持有人身份证明文件。投资者通过直销柜台及指定销售机构网点柜台办理基金交易业务时，直销柜台及指定销售机构网点柜台将为投资者提供书面方式授权的服务。为保护投资者利益，投资者在交易时，不论投资者是否授权或选择何种授权方式，均不影响交易的进行。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可按打并按提示转人工坐席，在人工坐席核实基金份额持有人身份后进行授权。

基金管理人也可主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据基金份额持有人意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话等其他授权的方式仅适用于个人基金份额持有人，对机构基金份额持有人暂不开通。

3、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在包括有效书面方式授权和其他非书面方式有效授权的，以有效的书面授权为准。多次以有效书面方式授权的，以最后一次书面授权为准。不能确定最后一次书面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的书面授权为准；最后时间收到的多次书面授权均表示了具体表决意见的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；若最后时间收到的多次书面授权均未表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

（2）如果同一基金份额在只存在有效书面方式授权时，委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

（3）如果同一基金份额无有效书面方式授权，但存在有效的其他非书面方式授权的，以有效的其他非书面方式的授权为准；

（4）如果同一基金份额以非书面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项，以表示具体表决意见的授权为准；最后时间收到的多次授权其授权表示一致的，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

（5）如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

（6）如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

4、授权开始时间及截止时间

接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为2020年9月28日至 2020 年10月26日16:00时。

（1）将书面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人、基金托管人或销售机构的指定地址的，授权时间以送达时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

（2）通过其他非书面方式授权的，授权时间以系统记录时间为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人大会的审议事项应分别由长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决时间

书面表决票通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达本公告规定的收件人的，表决时间以本公告规定的收到时间为准。表决起记时间以本公告为准。

（2）书面表决票的效力认定

①书面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议公告规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如书面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

③如书面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④基金份额持有人重复提交书面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i.送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ii.送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决，计入有效表决票；

iii.送达时间按如下原则确定：送达时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以公证机关签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

七、决议生效条件

1、直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额各自的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的50%（含50%），则本次基金份额持有人大会有效召开；

2、在此基础上，《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》应当由前述参加大会的长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额的基金份额持有人或其代理人各自所持长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项自表决通过之日起生效，本基金管理人将自决议生效之日起2日内在指定媒介上公告，并自通过之日起5日内报中国证监会备案。法律法规另有规定的，从其规定。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本次持有人大会需要本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额各自的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的50%（含50%）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，本基金管理人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的三分之一（含三分之一）方可召开。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

1、召集人（基金管理人）：长盛基金管理有限公司

联系人：王宁宁、赵鹏

联系电话：（010）86497925、86497662

客服电话：400-888-2666（免长途话费）

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

3、公证机关：北京市方圆公证处

4、律师事务所：上海市海华永泰律师事务所

十、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，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，将长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额按照基金份额参考净值折算为长盛中证申万一带一路份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、为了保护基金份额持有人的利益，加强交易风险警示，维护市场平稳，基金管理人决定长盛中证申万一带一路份额（基金代码：502013）、长盛中证申万一带一路A份额（基金代码：502014）及长盛中证申万一带一路B份额（基金代码：502015），已于2020年9月28日开市起停牌，并于2020年9月29日开市复牌。同时，自2020年9月28日起暂停长盛中证申万一带一路份额分拆业务。上述三类份额于基金份额持有人大会计票日（2020 年10月29日）自开市起停牌，并将于基金份额持有人大会决议生效公告日开市复牌。如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市恢复交易。如本次基金份额持有人大会议案未获通过的，则本基金三类份额的复牌安排请见基金管理人届时发布的相关公告。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

3、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

4、本次基金份额持有人大会有关公告可通过长盛基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-2666（免长途话费）咨询。

5、本通知的有关内容由长盛基金管理有限公司负责解释。

长盛基金管理有限公司

2020年9月29日

附件一：《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型方案的说明》

附件三：《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件四：《授权委托书》（样本）

附件五：《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》修改前后条文对照表

附件一：

关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人：

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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定和《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定召开长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，提议审议长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案，将本基金转型为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）。本基金转型的具体方案可参见附件二《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型方案的说明》。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金转型及基金合同修改的有关具体事宜，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

基金管理人：长盛基金管理有限公司

附件二：

关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型方案的说明

一、重要提示

（一）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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定和《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，本基金管理人（长盛基金管理有限公司）经与基金托管人（中国银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。

（二）本次长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）转型事宜属于对原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。中国证监会准予“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金”变更注册为“长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）”，不代表其对本次转型方案或长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的投资价值及市场前景做出实质性判断或保证。

（三）本次基金转型议案需经参加本次基金份额持有人大会的长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额的各自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，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

（四）基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，并自通过之日起五日内报中国证监会备案。

（五）本次基金份额持有人大会决议生效后且本基金正式转型前，将有至少预留二十个交易日的选择期供基金份额持有人做出选择，具体时间安排详见本基金管理人发布的相关公告。

二、基金转型方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金”变更为“长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）”。

（二）取消分级运作机制、调整运作方式

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型后将取消分级运作机制，将不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制，运作方式变更为上市契约型开放式（LOF）。

（三）调整投资范围及投资比例限制

投资范围中删除“权证”及“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占基金资产比例为5%－10%”；投资比例限制中，将投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例调整为不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。

（四）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，本基金将在转型正式实施前安排不少于20个交易日的选择期，以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转出或者卖出），具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。

转型选择期期间，长盛中证申万一带一路份额的交易、赎回、转出业务，长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额的交易、合并业务照常办理，不受影响。长盛中证申万一带一路份额的申购、定期定额投资及转托管业务（包含系统内转托管及跨系统转托管）将暂停。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择卖出长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额或赎回、转出长盛中证申万一带一路份额，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金份额。在选择期期间，由于长盛中证申万一带一路份额需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在转型选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款以及豁免进行基金份额的折算（包括定期折算及不定期折算）。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出、配对转换或调整赎回方式等。

（五）基金份额的转换

转型选择期届满后，基金管理人将确定份额转换基准日，并在该日将长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金份额。

本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：

1. 将长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额转换成长盛中证申万一带一路份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值为基准，长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额按照各自的基金份额参考净值转换成长盛中证申万一带一路份额的场内份额。长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额基金份额持有人持有的转换后长盛中证申万一带一路份额的场内份额取整计算（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，直至完成全部份额转换。由于基金份额数取整计算产生的误差，存在基金份额持有人的基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换计算公式如下：

长盛中证申万一带一路A份额（或长盛中证申万一带一路B份额）的转换比例＝份额转换基准日长盛中证申万一带一路A份额（或长盛中证申万一带一路B份额）的基金份额参考净值/份额转换基准日长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值

长盛中证申万一带一路A份额（或长盛中证申万一带一路B份额）基金份额持有人持有的转换后长盛中证申万一带一路份额的场内份额＝基金份额持有人持有的转换前长盛中证申万一带一路A份额（或长盛中证申万一带一路B份额）的份额数×长盛中证申万一带一路A份额（或长盛中证申万一带一路B份额）的转换比例

2. 将长盛中证申万一带一路份额转换成长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金份额

在长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额转换为长盛中证申万一带一路份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将长盛中证申万一带一路份额的场内份额和场外份额统一转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的场内份额和场外份额。

上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（六）基金转换的特别风险揭示

1、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

长盛中证申万一带一路A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，分级运作期内按基金合同约定获得相应年基准收益率，但在份额转换后，长盛中证申万一带一路A份额持有人原持有的较低风险收益特征的长盛中证申万一带一路A份额将变为较高风险收益特征的长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪中证申万一带一路主题指数的基金份额，无约定年基准收益率的相关安排，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原长盛中证申万一带一路A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

长盛中证申万一带一路B份额具有一定的杠杆属性，表现为高风险、预期收益相对较高的特征，但在份额转换后，长盛中证申万一带一路B份额持有人原持有的长盛中证申万一带一路B份额将变为较高风险收益特征的长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪中证申万一带一路主题指数的基金份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原长盛中证申万一带一路B份额持有人将无法继续享有杠杆安排且仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的流动性风险

长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额前，长盛中证申万一带一路份额的场内份额持有人有两种方式退出：1）在场内按市价卖出基金份额；2）按照长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的持有人有两种方式退出：1）在场内按市价卖出基金份额；2）在场内买入等量的对应份额（即长盛中证申万一带一路A份额持有人买入等量的长盛中证申万一带一路B份额，或者长盛中证申万一带一路B份额持有人买入等量的长盛中证申万一带一路A份额），合并为长盛中证申万一带一路份额，场内卖出长盛中证申万一带一路份额或者按照长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的持有人可能通过上述方式退出，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

3、转换前存在溢价交易的长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

转型选择期间，长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额仍可正常交易。期间，长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

以基金份额转换基准日日终长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值为基准，长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额，长盛中证申万一带一路份额的场内份额按其基金份额净值（而不是二级市场价格）自动转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额；如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。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。

投资者应密切关注长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（www.csfunds.com.cn）等方式进行查询。

4、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

以基金份额转换基准日日终长盛中证申万一带一路份额在基金份额净值为基准，长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额均按各自的基金份额参考净值转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额，并进行取整计算（最小单位为1份），对于持有份额数较少的长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

5、长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额后无法办理场内赎回的风险

长盛中证申万一带一路份额的场内份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额转换为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、在长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）场内份额恢复上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

（七）《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将确定转型选择期及份额转换基准日，并在份额转换基准日将长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金份额。

自本基金份额转换完成后，《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金”正式转型为“长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）”。

（八）转型后基金的基本情况

1、基金名称：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）

2、基金的类别：股票型

3、基金的运作方式：上市契约型开放式（LOF）

4、基金的投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制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不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证申万一带一路主题指数的有效跟踪。

5、基金的投资范围：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，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占基金资产比例为5%－10%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

6、投资策略：本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

7、业绩比较基准：中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

8、风险收益特征：本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

9、标的指数：中证申万一带一路主题指数。

（九）其他修改内容

为使《基金合同》适应新的法律法规要求和业务需要，在根据上述转型方案修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他条款一并进行了修改。

（十）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同等法律文件修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型方案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型选择期、转型实施前的申购赎回、份额折算安排等事项的转型实施安排规则并提公告。

三、基金转型的主要风险及预备措施

（一）基金份额持有人大会不能成功召集的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，基金份额持有人大会应当由权益登记日分别代表长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额二分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召集，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。如基金份额持有人大会未能成功召集，则基金管理人可准备二次召集基金份额持有人大会。

（二）议案未被基金份额持有人大会通过的风险

在提议长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型为长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）并设计具体方案之前，基金管理人已对基金份额持有人进行了走访，认真听取了相关意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人的意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案和程序进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以便为二次召集或推迟基金份额持有人大会的召开的做充分准备。

如果议案未获得基金份额持有人大会通过，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交审议本基金转型的议案。

（三）基金份额持有人集中赎回基金份额的流动性风险

为应对基金转型可能引发的大规模集中赎回，本基金会尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。基金管理人将根据赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制本基金的市场风险。

附件三：

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）	基金账户号/证券账户号		
持有份额类别选择	长盛中证申万一带一路份额【　】长盛中证申万一带一路A份额【　】长盛中证申万一带一路B份额【　】		
审议事项	同意	反对	弃权
关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型有关事项的议案			
基金份额持有人/代理人签名或盖章　年　月　日			

说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能选择一种表决意见。以上表决意见是基金份额持有