

## 长盛基金管理有限公司

### 关于长盛上证 50 指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告

长盛上证 50 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于 2020 年 9 月 28 日至 2020 年 10 月 28 日以通讯方式召开，审议《关于长盛上证 50 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“议案”）。议案于 2020 年 10 月 29 日获得表决通过，基金份额持有人大会决议自该日起生效。本基金管理人已于 2020 年 10 月 30 日发布了《关于长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议公告》”）。根据《决议公告》，现将实施转型的相关事项提示如下：

#### 一、关于转型方案实施的安排

2020 年 10 月 30 日至 2020 年 11 月 26 日为本基金转型实施前的选择期，长盛上证 50 份额（场内简称“上 50 分级”，基金代码“502040”）的交易、赎回，长盛上证 50A 份额（场内简称“上 50A”，基金代码“502041”）及长盛上证 50B 份额（场内简称“上 50B”，基金代码“502042”）的交易、合并业务照常办理，不受影响；长盛上证 50 份额的申购（含转换转入、定期定额）及转托管业务（包含系统内转托管及跨系统转托管）将暂停，具体恢复时间详见基金管理人届时发布的相关公告，长盛上证 50 份额的分拆业务不再恢复办理。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择卖出长盛上证 50 份额、长盛上证 50A 份额、长盛上证 50B 份额或赎回长盛上证 50 份额，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的长盛上证 50 份额、长盛上证 50A 份额、长盛上证 50B 份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金份额。

同时，基金份额持有人大会决议同意，在选择期豁免《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）。本基金管理人可根据实际情况暂停申购、赎回或调整赎回方式。具体安排详见我司届时发布的相关公告。

## 二、关于本基金的终止上市交易和基金份额的转换

为实施转型，本基金管理人将按照《长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向上海证券交易所申请长盛上证 50A 份额、长盛上证 50B 份额的终止上市。

转型选择期届满后，基金管理人将以 2020 年 12 月 1 日作为份额转换基准日，并在该日将本基金各类基金份额转换成长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金份额。

本次基金份额的转换主要分成以下两个步骤进行：

1. 将长盛上证 50A 份额与长盛上证 50B 份额转换成长盛上证 50 份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以长盛上证 50 份额的基金份额净值为基准，长盛上证 50A 份额与长盛上证 50B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成长盛上证 50 份额的场内份额。长盛上证 50A 份额与长盛上证 50B 份额基金份额持有人持有的转换后长盛上证 50 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，直到所有零碎份额的合计份额分配完毕。如登记结算机构业务规则有变化，以其最新规定为准。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。份额转换计算公式如下：

长盛上证 50A 份额（或长盛上证 50B 份额）的转换比例 = 份额转换基准日长盛上证 50A 份额（或长盛上证 50B 份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日长盛上证 50 份额的基金份额净值

长盛上证 50A 份额（或长盛上证 50B 份额）基金份额持有人持有的转换后长盛上证 50 份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前长盛上证 50A 份额（或长盛上证 50B 份额）的份额数 × 长盛上证 50A 份额（或长盛上证 50B 份额）的转换比例

2. 将长盛上证 50 份额转换成长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金份额

在长盛上证 50A 份额与长盛上证 50B 份额转换为长盛上证 50 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，将长盛上证 50 份额的场内份额和场外份额统一转换为长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金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。

### **三、关于本基金转型后的风险收益特征提示**

本基金转型前为股票型指数分级基金，其预期风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金所分拆的两类基金份额来看，长盛上证 50A 份额的风险与预期收益较低；长盛上证 50B 份额采用了杠杆式的结构，风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

本基金转型后为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### **四、关于基金合同等法律文件的修订情况**

#### **1、关于《基金合同》等法律文件的修订情况**

根据相关法律法规以及议案的规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，我司已将《长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛上证 50 指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此编制了《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]1794 号（《关于准予长盛上证 50 指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。

#### **2、本基金转型后新基金合同的生效**

本基金基金份额转换完成后，长盛上证 50 指数分级证券投资基金将自 2020 年 12 月 4 日起正式变更为长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF），《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金合同》《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）托管协议》生效，原《长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛上证 50 指数分级证券投资基金托管协议》同日失效。

《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，基金管理人将根据相关规定办理长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）的申购赎回、上市交易等业务，具体情况详见基金管理人届时发布的相关公告。

### 3、基金转换的特别风险揭示

（1）长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额的流动性风险

长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额转换为长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）场内份额前，长盛上证 50 份额的场内份额持有人有两种方式退出：①在场内卖出基金份额；②按照长盛上证 50 份额的基金份额净值申请场内赎回。长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额的持有人有两种方式退出：①在场内卖出基金份额；②根据上海证券交易所业务规则，将长盛上证 50A 份额与长盛上证 50B 份额合并为长盛上证 50 份额，场内卖出长盛上证 50 份额或者按照长盛上证 50 份额的基金份额净值申请场内赎回。

由于长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 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。

（2）转换前存在溢价交易的长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 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，长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额仍可正常交易。期间，长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 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上证 50 份额的基金份额净值为基准，长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为长盛上证 50 份额的场内份额，长盛上证 50 份额的场内份额按其基金份额净值（而不是二级市场价格）自动转换为长盛上证 50 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上证 50 份额的基金份额净值、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 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](http://www.csfunds.com.cn)）等方式进行查询。

(3) 长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 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上证 50 份额在基金份额净值为基准，长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额均按各自的基金份额参考净值转换为长盛上证 50 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上证 50A 份额、长盛上证 50B 份额持有人，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，直到所有零碎份额的合计份额分配完毕。

(4) 长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额转换为长盛上证 50 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

长盛上证 50 份额的场内份额、长盛上证 50A 份额和长盛上证 50B 份额转换为长盛上证 50 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。

(5) 在长盛上证 50 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；在长盛上证 50 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。

## 五、关于基金转型后场内基金份额的后续安排

基金管理人将于基金份额转换完成后对基金份额转换结果进行公告。自《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，基金管理人将向上海证券交易所申请办理上市的相关事宜。

投资者如有任何疑问，可以致电本公司的客户服务电话（400-888-2666）、登录本公司网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）获取相关信息。

风险提示：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。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读各基金的基金合同和招募说明书。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。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10月30日