

# 长盛基金管理有限公司

## 关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 实施转型的公告

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2020 年 9 月 28 日起至 2020 年 10 月 28 日 17:00 止，会议审议了《关于长盛中证金融地产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，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。基金管理人于 2020 年 10 月 30 日发布了《关于长盛中证金融地产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《议案》及《决议公告》，现就本基金转型相关信息公告如下：

### 一、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据相关法律法规及《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，基金管理人已将《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）托管协议》并据此编制了《长盛中证金融地产指数证券投资基金（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]1795 号（《关于准予长盛中证金融地产指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。

### 二、关于转型方案实施的安排

本基金转型实施前的选择期为 2020 年 10 月 30 日至 2020 年 11 月 26 日。

选择期期间，基金份额持有人可选择卖出长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额或者赎回、转换转出长盛中证金融地产份额等方式退出。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的长盛中证金融地产份额、

长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额将于份额转换基准日，即 2020 年 11 月 27 日进行转换，最终转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金份额。在选择期内，基金管理人可根据实际情况对本基金申购、赎回等业务进行调整，具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回长盛中证金融地产份额的，仍适用长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人大会决议同意，在选择期豁免本基金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）。

### 三、本基金的终止上市

本基金目前上市交易的份额为长盛中证金融地产 A 份额以及长盛中证金融地产 B 份额，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则等申请长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额的终止上市等相关业务。具体安排详见基金管理人届时发布的本基金终止上市的相关公告。

### 四、本基金基金份额的转换

本基金的基金份额转换基准日为 2020 年 11 月 27 日。2020 年 11 月 27 日至 2020 年 11 月 30 日，本基金暂停办理长盛中证金融地产份额的申购（含定期定额投资）、赎回、转换及转托管（含系统内转托管及跨系统转托管）等业务。自 2020 年 11 月 27 日起，本基金终止办理基金份额的配对转换业务。基金转型完毕后，长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）将于 2020 年 12 月 1 日开始办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换及转托管（含系统内转托管及跨系统转托管）等业务。

本次基金份额的转换主要分成以下两个步骤进行：

（1）将长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额转换成长盛中证金融地产份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以长盛中证金融地产份额的基金份额净值为基准，长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成长盛中证金融地产份额的场内份额。长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额基金份额持有人持有的转换后长盛中证金融地产份额的场内

份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。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金融地产A份额、长盛中证金融地产B份额，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

份额转换计算公式如下：

长盛中证金融地产A份额（或长盛中证金融地产B份额）的转换比例=份额转换基准日长盛中证金融地产A份额（或长盛中证金融地产B份额）的基金份额参考净值/份额转换基准日长盛中证金融地产份额的基金份额净值

长盛中证金融地产A份额（或长盛中证金融地产B份额）基金份额持有人持有的转换后长盛中证金融地产份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前长盛中证金融地产A份额（或长盛中证金融地产B份额）的份额数×长盛中证金融地产A份额（或长盛中证金融地产B份额）的转换比例

（2）将长盛中证金融地产份额转换成长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金份额

长盛中证金融地产A份额与长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将长盛中证金融地产份额的场内份额和场外份额统一转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的场内份额和场外份额。

根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的相关业务规则，基金份额持有人持有的长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额后，基金份额持有期自长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额确认之日起计算。基金份额持有人持有的长盛中证金融地产份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）份额后，其原基金份额持有期计入长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）份额的持有期。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司另有规定的，从其规定。

## 五、关于基金份额转换的特别风险揭示

1、长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换后风险收益特征

发生较大变化的风险

长盛中证金融地产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，长盛中证金融地产A份额持有人原持有的较低风险收益特征的长盛中证金融地产A份额将变为较高风险收益特征的长盛中证金融地产指数证券投资基金（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。由于长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪中证金融地产指数的基金份额，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，原长盛中证金融地产A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

长盛中证金融地产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，长盛中证金融地产B份额持有人原持有的长盛中证金融地产B份额将变为较高风险收益特征的长盛中证金融地产指数证券投资基金（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。由于长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪中证金融地产指数的基金份额，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，原长盛中证金融地产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、长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额的流动性风险

长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额前，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产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）根据深圳证券交易所业务规则，将长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额合并为长盛中证金融地产份额，按照长盛中证金融地产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。

由于长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产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金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额仍可正常交易。期间，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产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金融地产份额的基金份额净值为基准，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产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）转换为长盛中证金融地产份额的场内份额，长盛中证金融地产份额的场内份额按其基金份额净值自动转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（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金融地产A份额和长盛中证金融地产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](http://www.csfunds.com.cn)）等方式进行查询。

4、长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产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金融地产份额的基金份额净值为基准，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额均按各自的基金份额参考净值转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（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金融地产A份额、长盛中证金融地产B份额，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

5、长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额后部分投资者可能无法直接办理场内赎回的风险

长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（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。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回。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、长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额后自确认之日起计算及收取赎回费的风险

根据有关业务规则，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额后，基金份额持有期自份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

7、在长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在符合相关法律法规和基金份额上市条件的前提下，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的场内份额上市交易。在长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）场内份额上市交易之前，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。

## 六、本基金转型后基金合同的生效

自2020年12月1日起，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金正式变更为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF），《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）托管协议》生效，原《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金托管协议》同日失效。

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.csfund.com.cn](http://www.csfund.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11月24日