

## 长信基金管理有限责任公司

### 关于以通讯方式召开长信量化多策略股票型证券投资基金 基金份额持有人大会的第二次提示性公告

长信基金管理有限责任公司已于 2021 年 3 月 18 日、2021 年 3 月 19 日在规  
定网站及《中国证券报》披露了《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召  
开长信量化多策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《长信基  
金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信量化多策略股票型证券投资基金基  
金份额持有人大会的第一次提示性公告》，为了使本基金份额持有人大会顺利召  
开，根据基金合同的相关规定，现发布《长信基金管理有限责任公司关于以通讯  
方式召开长信量化多策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提  
示性公告》。

#### 一、会议基本情况

长信基金管理有限责任公司（以下简称“我公司”）管理的长信量化多策略  
股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会证监许  
可 [2015] 742 号文注册募集，并于 2015 年 7 月 14 日成立。

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》等法律法规及《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》（以下简  
称“《基金合同》”）的规定，基金管理人经与本基金的基金托管人中国工商银行  
股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审  
议《关于变更长信量化多策略股票型证券投资基金有关事项的议案》。

会议的具体安排如下：

（一）会议的召开方式：通讯方式。

（二）会议投票表决起止时间：自 2021 年 3 月 24 日 0:00 起至 2021 年 4  
月 19 日 17:00 止（投票表决时间以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时  
间或以基金管理人系统记录时间为准）。

（三）会议通讯表决票将在公证机关的监督下统计。

## 二、会议审议事项

本次基金份额持有人大会审议的事项为《关于变更长信量化多策略股票型证券投资基金有关事项的议案》（以下简称“议案”，详见附件一）。

## 三、权益登记日

本次基金份额持有人大会的权益登记日为2021年3月23日，即在2021年3月23日在本基金登记机构登记在册的本基金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并表决。

## 四、投票方式

### （一）纸质投票（仅适用于机构投资者）

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载（<http://www.cxfund.com.cn/>）等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或相关经授权的业务专用章（以下合称“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）；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、护照或其他身份证明文件的复印件，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，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证券账户卡复印件，以及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纸面方式授

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（详见附件二）以及本公告“五、授权（三）授权方式”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等相关文件复印件。

4、以上各项中的公章、批文、开户证明、登记证书等，以基金管理人的认可为准。

5、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于会议投票表决起止时间内（自2021年3月24日0:00起至2021年4月19日17:00止，以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：周思萌

地址：上海市浦东新区银城中路68号9楼

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

邮政编码：200120

请在表决票或相关文件表面注明：“长信量化多策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## （二）网络投票（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人（个人投资者）参与大会投票，自2021年3月24日0:00起至2021年4月19日17:00止（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人在官方网站设立投票专区，通过投票专区进行投票的基金份额持有人，应使用开户证件号码及登录密码进行登录，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人的权益。

## 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大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意见，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代为行使表决权。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自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。基金份额持有人委托他人投票，需向基金管理人提供授权委托书（授权委托书的格式见附件二）。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动生效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）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全部基金份额数计算，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基金份额的数额，以登记机构的登记为准。

## （二）受托人（代理人）

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人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的表决权。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使，建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加受托人名单。

## （三）授权方式

**本基金份额持有人大会仅接受机构投资者以纸面授权的方式授权受托人代为行使表决权。**

授权委托书的样本请见本公告附件二。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.cxfund.com.cn/>）下载等方式获取授权委托书样本。

1、机构投资者委托他人投票的，应由委托人在填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式见附件二）上加盖该机构公章，并提供该机构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）。

以上各项中的公章、批文、开户证明、登记证书等，以基金管理人的认可为

准。

## 2、授权效力确定规则

(1)如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，且能够区分授权次序的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，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纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均为表示具体表决意见的，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；

(2)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；

(3)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，授权视为无效。

## 3、对基金管理人授权开始时间及截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2021 年 3 月 24 日 0:00 至 2021 年 4 月 19 日 17:00 止。将填妥的纸面授权委托书通过专人送交、邮寄或传真送达至基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。具体联系方式如下：

收件人：周思萌

地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

邮政编码：200120

## 六、计票

(一)本次表决票的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国工商银行股份有限公司)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。基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(二)基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每份基金份额

享有平等的表决权。

(三) 表决票效力的认定如下:

纸质表决票通过专人送交、邮寄或传真送达本公告规定的收件人的, 表决时间以收到时间为准; 通过网络表决的, 表决时间以系统记录时间为准。

#### 1、纸面表决票的效力认定

(1) 纸面表决票填写完整清晰, 所提供文件符合本会议通知规定, 且在表决截止时间之前送达本公告规定的收件人的, 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) 如纸面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或互相矛盾, 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) 纸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受托人经有效授权的证明文件的, 或未能在投票截止时间之前送达本公告规定的收件人的, 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纸面表决票的, 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:

①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;

②送达时间为同一天的, 视为在同一表决票上做出了不同表决意见, 视为弃权表决, 计入有效表决票;

③送达时间按如下原则确定: 专人送达的以实际递交时间为准, 邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准, 传真的以本公告规定的收件人传直接收到的时间为准。

#### 2、网络表决票的效力认定

(1) 网络投票的截止时间为 2021 年 4 月 19 日 17:00 (以基金管理人系统记录时间为准)。

(2) 网络投票系统仅支持单次投票，基金份额持有人通过网络投票的结果无法修改，请持有人谨慎投票。

## 七、决议生效条件

(一) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

(二) 《关于变更长信量化多策略股票型证券投资基金有关事项的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过；

(三) 本次基金份额持有人大会决议通过的事项，将由本基金管理人自表决通过之日起五日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

## 八、重新召集基金份额持有人大会及重新授权

如本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%），根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》相关规定，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就本次大会审议的议案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，应当有代表权益登记日 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。重新召集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，详细说明见基金管理人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

(一) 召集人：长信基金管理有限责任公司

客服专线：4007005566

联系人：周思萌

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

网址：<http://www.cxfund.com.cn>

电子邮件：[service@cxfund.com.cn](mailto:service@cxfund.com.cn)

(二) 基金托管人：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮编：100032

联系人：白明婷

联系电话：010-66105749

(三) 公证机构：上海市普陀公证处

办公地址：上海市常德路 1211 号宝华大厦 11 层

邮编：200060

联系人：黄彦

联系电话：021-52562233-351

(四) 律师事务所：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

邮编：200120

联系人：姜亚萍

联系电话：021-51150298

## 十、重要提示

(一) 请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

(二) 根据《中华人民共和国证券投资基金法》及本基金《基金合同》的规定，本次大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份



额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）方可举行，经出席基金份额持有人大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上（含 50%）通过才能做出有效决议。

（三）上述基金份额持有人大会有关公告可通过长信基金管理有限责任公司网站（<http://www.cxfund.com.cn>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电 4007005566（免长话费）咨询。

（四）本公告的有关内容由长信基金管理有限责任公司解释。

附件一：《关于变更长信量化多策略股票型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：长信量化多策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

特此公告。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 3 月 22 日

**附件一：《关于变更长信量化多策略股票型证券投资基金有关事项的议案》**
**长信量化多策略股票型证券投资基金基金份额持有人：**

为更好地满足客户需求，保护基金份额持有人利益，我公司根据《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》的有关规定，提议召开基金份额持有人大会审议变更投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、补充摆动定价条款等相关事项，同时拟相应修改本基金法律文件的相关条款，本次修改已取得中国证监会的《关于准予长信量化多策略股票型证券投资基金变更注册的批复》。经基金托管人中国工商银行股份有限公司及基金管理人长信基金管理有限责任公司协商一致，现拟对本次修改事项说明如下：

**一、本基金修改的主要情况**

为了更好的实现本基金的投资理念，以长期优秀的投资业绩回报投资人，本公司拟变更本基金的投资范围，在控制投资风险的前提下增加可增厚组合收益的资产选项，同时修改投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、补充摆动定价条款等。基金修改前后要点对比如下：

基金要素	原表述	拟修改的表述
投资范围	<p>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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、<del>权证</del>、资产支持证券、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>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。</p>	<p>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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准<u>或注册</u>上市的股票）、存托凭证、<u>港股通标的股票</u>、<u>债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）</u>、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、<u>同业存单</u>、货币市场工具、<u>国债期货</u>、<u>股指期货</u>、<u>股票期权</u>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（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>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，<u>其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定</u>。</p>
投资策略	三、投资策略	三、投资策略

<p><del>(3)</del>股票投资组合的优化 .....</p> <p><del>3</del>、债券投资策略 .....</p> <p>4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。</p> <p><del>(1)</del>权证投资策略 本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险,有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。 本基金将通过对权证标的股票基本面的研究,并结合期权定价模型,评估权证的合理投资价值,在有效控制风险的前提下进行权证投资。 本基金将通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略、杠杆交易策略等,利用权证进行对冲和套利等。 .....</p>	<p><u>(2)</u>股票投资组合的优化 .....</p> <p><u>3</u>、债券投资策略 .....</p> <p><u>对于可转债的投资,因可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护,防范信用风险,另一方面,还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究,从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察,精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。</u></p> <p><u>4</u>、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与资产支持证券、股指期货、<u>国债期货</u>、<u>股票期权</u>等金融工具的投资。 .....</p> <p><u>(3)</u>国债期货的投资策略 <u>本基金通过对基本面和资金面的分析,对国债市场走势做出判断,以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长,通货膨胀压力浮现,央行政策趋于紧缩时,本基金建立国债期货空单进行套期保值,以规避利率风险,减少利率上升带来的亏损;反之,在经济增长趋于回落,通货膨胀率下降,甚至通货紧缩出现时,本基金通过建立国债期货多单,以获取更高的收益。</u></p> <p><u>(4)</u>股票期权投资策略 <u>本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股票期权定价模型,选择估值合理的期权合约。</u> <u>基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的</u></p>
--	---

		<p><u>专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</u></p> <p><b>5、港股通投资策略</b></p> <p><u>本基金将仅通过港股通投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。</u></p> <p><u>本基金将通过港股通机制投资香港联合交易所上市 <u>的股票</u>，在上述行业配置和个股投资策略下，<u>比较港股与 A 股市场同类公司的质地及估值水平等要素，优选具备质地优良、行业景气的公司进行重点配置。</u></u></p>
投资限制	<p>基金的投资组合比例为：<b>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例为 5%-20%</b>。本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。</p>	<p>基金的投资组合比例为：<u>股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%</u>。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、<u>国债期货及股票期权</u> 合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。<u>股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</u></p> <p><u>如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。</u></p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率*<b>80%</b>+中证综合债券指数收益率*<b>20%</b></p>	<p>沪深 300 指数收益率*<b>70%</b>+中证综合债券指数收益率*<b>20%</b>+<u>恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%</u></p>
估值方法	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、存托凭证、<del>权证</del>、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、存托凭证、债券、<u>资产支持证券</u>、<del>权证</del>、股指期货、<u>国债期货</u>、<u>股票期权</u>和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>
	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的<b>有价</b>证券的估值</p> <p><u>(1) 交易所上市的<b>有价</b>证券（包括股票、<del>权证</del>等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券</u></p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的<b>权益类</b>证券的估值</p> <p>交易所上市的<b>权益类</b>证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化<u>以及</u>证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；……</p>

	<p>价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;……</p> <p><del>(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;</del></p> <p><del>(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易目债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;</del></p> <p><del>(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</del></p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市</p>	<p>2、处于未上市期间的<b>权益类</b>证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>(3) <u>发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)</u>,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p><b>3、交易所市场交易的固定收益品种的估值</b></p> <p><u>(1)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</u></p> <p><u>(2)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;</u></p> <p><u>(3)对在交易所市场上市交易的可转换债券,选取每日收盘价作为估值全价;</u></p> <p><u>(4)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券,鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值。如成本能够近似体现公允价值,按成本估值。基金管理人应持续评估上述做法的适当性,并在情况发生改变时做出适当调整;</u></p> <p><u>(5)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</u></p> <p><b>4、银行间市场交易的固定收益品种的估值</b></p> <p><u>(1)对银行间市场上不含权的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</u></p> <p><u>(2)银行间市场上含权的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日</u></p>
--	--	---

	<p>后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p><del>3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。</del></p> <p>4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p>	<p>的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；</p> <p><u>（3）银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</u></p> <p>5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</p> <p><u>7、国债期货合约以估值日的结算价估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。</u></p> <p><u>8、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</u></p> <p><u>9、股票期权合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。</u></p> <p><u>10、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p> <p><u>11、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。</u></p>
<p>摆动定价 相关条款</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 .....</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 .....</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>

	(七) 临时报告 .....	(七) 临时报告 ..... <b>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</b>
--	-------------------	---

本基金管理人就修改投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、补充摆动定价条款等，在基金法律文件中进行了修改及完善，并按照现行法律、法规的要求，对其他需要变更的部分也一并进行了修改。

**二、本基金招募说明书及托管协议等文件将根据上述修改同步进行相应调整。**

为实现基金变更的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究，做好了基金运作的相关准备。

本次大会审议通过的上述事项，将于本公司发布基金份额持有人大会决议生效公告之日起实施。变更后的《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》自同日起生效。

以上议案，请予审议。

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

2021年3月22日

附件二：授权委托书

本机构特此授权\_\_\_\_\_代表本机构参加投票截止日为2021年4月19日17:00的以通讯方式召开的长信量化多策略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。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会表决结束之日止。若长信量化多策略股票型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，除非授权文件另有载明或基金份额持有人重新作出有效授权，本授权继续有效。

**委托人信息：**

**机构名称(盖公章)：**

**法定代表人姓名：**

**机构证件类型：**

**机构证件号码（填写）：**

**基金账户号：**

**受托人（签字或盖章）：**

**受托人证件类型：**

**受托人证件号码（填写）：**

签署日期： 年 月 日



**授权委托书填写注意事项：**

1、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人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。

2、如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，且能够区分授权次序的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，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纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均为表示具体表决意见的，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。

3、以上授权是基金份额持有人就其在权益登记日持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4、本授权委托书（样本）中“机构证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

**附件三：长信量化多策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决票（纸质表决票，仅限机构投资者）**

基金份额持有人名称			
基金账号			
证件类型			
证件号码			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于变更长信量化多策略股票型证券投资基金有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人（代理人）签名或盖章			
年 月 日			
本次基金份额持有人大会投票相关工作联系人姓名			
联系电话			
<b>说明：</b> 1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。 2、持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。 3、表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。 4、表决意见未选、多选或模糊不清、相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”，计入有效表决票。 5、签名或盖章部分填写不完整、不清晰，或在截止时间之后送达本公告规定的收件人的表决票计为无效表决票。			