

关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金修改基金合同的公告

经国务院同意，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》明确规定，公募产品不得进行份额分级。为落实上述规定要求，并根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）对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”，长盛中证申万一带一路份额（基础份额）场内简称：一带一路，基金代码：502013；长盛中证申万一带一路 A 份额场内简称：一带一 A，基金代码：502014；长盛中证申万一带一路 B 份额场内简称：一带一 B，基金代码：502015）的基金合同进行了修改，并已报监管部门备案。本次法律文件的修改系根据相关法律法规及监管要求而进行，符合相关法律法规的规定以及基金合同的约定。本次基金合同修改涉及根据监管规定取消分级机制，并据此就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 份额的终止运作，包括终止上市与份额折算等后续具体操作做了安排，具体修改内容详见附件。

重要提示：

- 1、本次基金合同修改自 2020 年 11 月 19 日起生效。
- 2、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 份额的终止运作的时间安排，将由基金管理人提前至少 20 个交易日另行公告。
- 3、本公司将在公司网站（www.csfund.com.cn）公布修改后的基金合同，招募说明书届时将在最新一期的版本中予以更新。

风险提示：

- 1、本基金修改基金合同后，各类份额持有人的影响列示如下表：

公告前 1 公告后、折算前 折算后

持有份

额类别

折溢

价

净值

杠杆

有 无 上

市交易

持有份

额类别 折溢价 净值

杠杆

有 无 上

市交易

持有份 额

类别

折溢

价

净值

杠杆

有 无 上

市交易

A类份额 DA 无 有 不变 2 DA 可能收

窄 不变 2 不变 2 场内基础

份额 DC 无 有

B类份额 DB LB 有 不变 2 DB 可能收

窄

LB 正

常 变

化

不变 2 场内基础

份额 DC 无 有

场内基

础份额 DC 无 有 不变 2 DC 可能收

窄 不变 2 不变 2 场内基础

份额 DC 无 有

场外基

础份额 无 无 无 不变 2 不变 2 不变 2 不变 2 场外基础

份额 无 无 无

备注 1：“公告前”指的是本次公告之前。

备注 2：“不变”指的是与本次公告之前相比没有变化。

备注 3：DA=A类份额价格/A类份额参考净值-1；DB=B类份额价格/B类份额参考净值-1；DC=基础份额价格/基础份额净值-1；

LB=基础份额净值/（B类份额参考净值×B类份额数/（A类份额数+B类份额数））；

LB随基础份额净值的变化而变化，而基础份额净值根据标的指数的涨跌而涨跌。

（1）由于场内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，本次基金合同修改后，其折溢价率可能发生较大变化，如果投资者以溢价买入，折算后可能遭受较大损失（具体折算方式及示例详见风险提示第 4 条及修改后的基金合同条款）。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。

（2）长盛中证申万一带一路 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征，但在份额折算后，长盛中证申万一带一路 A 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的长盛中证申万一带一路份额，由于长盛中证申万一带一路份额为跟踪中证申万一带一路主题指数的基础份额，其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，具有高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，长盛中证申万一带一路 B 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的长盛中证申万一带一路份额，由于长盛中证申万一带一路份额为跟踪中证申万一带一路主题指数的基础份额，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，不会形成杠杆性收益或损失，但原长盛中证申万一带一路 B 份额持有人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 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额折算为长盛中证申万一带一路份额前，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）根据上海证券交易所业务规则，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。

3、本次基金合同修改后，由于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 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回等方式退出，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。

4、以份额折算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、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（而不是二级市场价格）折算成场内长盛中证申万一带一路份额。长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内长盛中证申万一带一路份额取整计算（最小单位为 1 份）。

折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。

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折算后发生变化，示例如下：

假设份额折算基准日日终长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额的基金份额（参考）净值的分别为：0.9000 元、1.0100 元、0.7900 元，投资者甲、乙、丙分别持有场内长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额各 100,000 份，其所持基金份额的变化如下表所示：

基金份额

折算前

份额折算比例

折算后

基金份额（参

考）净值（元）

基金份额

（份）

基金份额净值

（元） 基金份额

场内长盛中

证申万一带

一路份额

0.9000 100,000 （无变化） 0.9000

100,000 份场内长盛

中证申万一带一路

份额

长盛中证申

万一带一路

A 份额

1.0100 100,000

1.122222

（全部折算为长盛中证

申万一带一路份额）

0.9000

112,222 份场内长盛

中证申万一带一路

份额

长盛中证申

万一带一路 B
份额

0.7900 100,000

0.877778

(全部折算为长盛中证
申万一带一路份额)

0.9000

87,777 份场内长盛

中证申万一带一路
份额

注：具体折算结果以登记结算机构为准

5、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 份额折算为长盛中证申万一带一路份额后，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，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、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，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 份额合并或折算为长盛中证申万一带一路份额后，基金份额持有期自长盛中证申万一带一路份额确认之日起计算。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。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书的约定，本基金场内和场外的赎回费率如下：

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，具体如下：

持有时间 (T) 赎回费率

T < 7 日 1.50%

7 日 ≤ T < 1 年 0.50%

1 年 ≤ T < 2 年 0.25%

T ≥ 2 年 0.00%

(注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记结算机构的登记日开始计算。)

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于 7 日的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

投资者欲了解详情，请登录基金管理人网站：www.csfund.com.cn 或拨打本公司客服电话：400-888-

2666 进行咨询。

特此公告。

附件：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对照表

长盛基金管理有限公司

2020年11月18日

附件：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对照表

章节 修改前 修改后

第十一部分

基金份额持

有人大会

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规和中国证监会另有规定外，应当召开基金份额持有人大会：

.....

(8) 终止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 份额的运作；

.....

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，应当召开基金份额持有人大会：

.....

(8) 终止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 份额的运作，但根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定取消分级运作机制的除外；

.....

第十九部分

基金的收益

与分配

三、收益分配原则

.....

经基金份额持有人大会决议通过，如果终止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 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

三、收益分配原则

.....

经基金份额持有人大会决议通过（法律法规或基金合同另有规定的除外），如果终止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 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。

具体见基金管理人届时发布的相关公告。

第二十一部

分长盛中证

申万一带一

路A份额和

长盛中证申

万一带一路B

份额的终止

运作

一、经基金份额持有人大会决议通过，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份额可申请终止运作。

一、本基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止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份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。为此，基金管理人将向上海证券交易所申请基金份额终止上市，并办理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份额的份额折算。具体终止运作的时间安排见基金管理人届时发布的公告。基金管理人应将基金合同根据前述法律法规做相应修改并公告。

第二十一部

分长盛中证

申万一带一

路A份额和

长盛中证申

万一带一路B

份额的终止

运作

二、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份额终止运作后的份额折算

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份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，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份额将全部转换成场内长盛中证申万一带一路份额。

1.份额转换基准日

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份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

2. 份额转换方式

.....

3. 份额转换后的基金运作

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 额全 部转 换为 场内
长盛中证申万一带一路份额后， 本 基金接
受场外与场内申购和赎回。

4. 份额转换的公告

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 额进 行份 额转 换结
束后， 基金管理人应在至少一家指定媒介
和基金管理人网站公告， 并报中国证监会
备案。

二、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 份额终止运作后的份额折算
份额折算基准日长盛中证申 万 一 带 一 路
A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额将全部
转换成场内长盛中证申万一带一路份额。

1. 份额转换基准日

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 份 额 折 算 基 准 日 具 体
日期见基金管理人届时发布的公告。

2. 份额转换方式

.....

3. 份额转换后的基金运作

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 全 部 转 换 为 场 内 长 盛
中证申万一带一路份额后， 本 基金接 受场外
与场内申购和赎回，开始申购、赎回的 时间 及
具体操作以基金管理人的公告为准。

4. 份额转换的公告

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 份额进行份额折算结束后，
基金管理人应在指定媒介公告。

三、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本 基金 的平稳
运作， 基金管理人可暂停相关份 额 的 交 易 和
申购或赎回等相关业务， 具体见 基 金 管 理 人
届时发布的相关公告。