关于长盛上证50指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告

长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开长盛上证50指数分级证券投资基金（长盛上证50份额场内简称：上50分级，代码：502040；长盛上证50A份额场内简称：上50A，代码：502041，长盛上证50B份额场内简称：上50B，代码：502042）的基金份额持有人大会，会议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。为保护投资者利益，现基金管理人提示如下：

一、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，将长盛上证50A份额与长盛上证50B份额按照基金份额参考净值折算为长盛上证50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。

二、长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额将于基金份额持有人大会计票日（2020年10月29日）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。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

三、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，请拨打基金管理人客户服务电话400-888-2666（免长途话费）或登录基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）获取相关信息。

长盛基金管理有限公司
2020年9月29日

长盛基金管理有限公司关于以通讯方式召开长盛上证50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《证券日报》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上证50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上证50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〕1128号文募集的长盛上证50指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同已于2015年8月13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“长盛上证50份额”（场内简称“上50分级”，基金代码“502040”）；分级份额包括“长盛上证50A份额”（场内简称“上50A”，基金代码“502041”）和“长盛上证50B份额”（场内简称“上50B”，基金代码“502042”）。

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《长盛上证50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：“长盛上证50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

《关于长盛上证50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《关于长盛上证50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（包括长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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、快递或邮寄挂号信的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：“长盛上证50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，基金份额持有人可拨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上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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。表决起讫时间以本公告为准。

（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上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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，《关于长盛上证50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上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额的基金份额持有人或其代理人各自所持长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B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《长盛上证50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上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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，将长盛上证50A份额与长盛上证50B份额按照基金份额参考净值折算为长盛上证50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上证50份额（基金代码：502040）、长盛上证50A份额（基金代码：502041）及长盛上证50B份额（基金代码：502042），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日起暂停长盛上证50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：《关于长盛上证50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》
附件二：《关于长盛上证50指数分级证券投资基金转型方案的说明》
附件三：《长盛上证50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：《长盛上证50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：

关于长盛上证50指数分级证券投资基金
转型有关事项的议案

长盛上证50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《长盛上证50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，提议审议长盛上证50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上证50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《关于长盛上证50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：

关于长盛上证50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《长盛上证50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《关于长盛上证50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。

（二）本次长盛上证50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“长盛上证50指数分级证券投资基金”变更注册为“长盛上证50指数证券投资基金（LOF）”，不代表其对本次转型方案或长盛上证50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上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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“长盛上证50指数分级证券投资基金”变更为“长盛上证50指数证券投资基金（LOF）”。

（二）取消分级运作机制、调整运作方式

长盛上证50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，长盛上证50份额的交易、赎回、转出业务，长盛上证50A份额与长盛上证50B份额的交易、合并业务照常办理，不受影响。长盛上证50份额的申购、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，可选择卖出长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额或赎回、转出长盛上证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份额与长盛上证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。在选择期期间，由于长盛上证50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，并在该日将长盛上证50指数分级证券投资基金的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可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上证50A份额、长盛上证50B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）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、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

长盛上证50A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，长盛上证50A份额持有人原持有的较低风险收益特征的长盛上证50A份额将变为较高风险收益特征的长盛上证50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。由于长盛上证50指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪上证50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，原长盛上证50A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

长盛上证50B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，长盛上证50B份额持有人原持有的长盛上证50B份额将变为较高风险收益特征的长盛上证50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。由于长盛上证50指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪上证50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，原长盛上证50B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）在场内按市价卖出基金份额；2）按照长盛上证50份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。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（即长盛上证50A份额持有人买入等量的长盛上证50B份额，或者长盛上证50B份额持有人买入等量的长盛上证50A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或转托管至场外后申请赎回。

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。

3、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指数证券投资基金（LOF）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）等方式进行查询。

4、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，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。

6、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。

（七）《长盛上证50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上证50指数分级证券投资基金的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。

自本基金份额转换完成后，《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，“长盛上证50指数分级证券投资基金”正式转型为“长盛上证50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：长盛上证50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%，实现对上证50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）。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的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%，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：上证50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：上证50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《关于长盛上证50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上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B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

在提议长盛上证50指数分级证券投资基金转型为长盛上证50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：

长盛上证50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	长盛上证50份额【 】长盛上证50A份额【 】长盛上证50B份额【 】		
审议事项	同意	反对	弃权
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			
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人或其受托人（代理人）就持有人持有的本基金全部份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）做出的表决意见。 2、本表决票中“基金账户号”指持有长盛上证50指数分级证券投资基金场外份额的基金账户号，“证券账户号”指持有长盛上证50指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的长盛上证50指数分级证券投资基金所有份额（包括长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额）。 3、未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或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”，但计入有效表决票。 4、签字或盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决票。			

（本表决票可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件四：

授权委托书

本人（或本机构）持有长盛上证50指数分级证券投资基金（以下简称本基金）的基金份额，就长盛基金管理有限公司官网（www.csfunds.com.cn）及2020年9月28日在《证券日报》公布的《关于以通讯方式召开长盛上证50指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

同意	反对	弃权

本人（或本机构）特此授权　　　　　　代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。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会议结束之日止。若本基金就相同议案重新审议表决或二次召集审议相同议案的持有人大会的，除本人（或本机构）重新作出授权外，则本授权继续有效。

委托人（签字／盖章）：
委托人证件号码或统一社会信用代码：
基金账户号／证券账户号：
受托人（代理人）签字／盖章：
受托人（代理人）证件号码或统一社会信用代码：
委托日期：　年　月　日

附注：

1．此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均为有效。

2．以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）向受托人（代理人）所做授权。

3．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表决意见行使表决权。

4．如本次基金份额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。

5．本授权委托书中“基金账户号”指持有长盛上证50指数分级证券投资基金场外份额的基金账户号，“证券账户号”指持有长盛上证50指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。

附件五：

《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》修改前后条文对照表

章节或位置	长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同	长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同
第一部分 前言 第“三、”	三、长盛上证50指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。	修改后为： 三、长盛上证50指数证券投资基金（LOF）由长盛上证50指数分级证券投资基金转型而来，长盛上证50指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。 中国证监会对长盛上证50指数分级证券投资基金转型为长盛上证50指数证券投资基金（LOF）的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。
第二部分 释义 第“1、”	1、基金或本基金：指长盛上证50指数分级证券投资基金	修改后为： 1、基金或本基金：指长盛上证50指数证券投资基金（LOF）
第二部分 释义 第“4-9”	4、基金合同或本基金合同：指《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛上证50指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《长盛上证50指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《长盛上证50指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 8、基金份额发售公告：指《长盛上证50指数分级证券投资基金基金份额发售公告》 9、《上市交易公告书》：指《长盛上证50指数分级证券投资基金之长盛上证50份额、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额上市交易公告书》	修改后为： 4、基金合同或本基金合同：指《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新 8、《上市交易公告书》：指《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
第二部分 释义 第“11、”	11、《基金法》：指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订	修改后为： 10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并根据2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分 释义 第“17、”	17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会	修改后为： 16、银行保险监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
第二部分 释义 第“24-26”	24、长盛上证50份额：指长盛上证50指数分级证券投资基金之基础份额 25、长盛上证50A份额：指长盛上证50份额按基金合同约定规则所分离的稳健收益类份额 26、长盛上证50B份额：指长盛上证50份额按基金合同约定规则所分离的积极收益类份额	删除相关表述
第二部分 释义 第“27、”	27、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	修改后为： 23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
第二部分 释义 原第“28、”项后		新增以下内容： 25、场内：指通过上海证券交易所会员单位和上海证券交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回 26、场外：指不通过上海证券交易所交易系统而通过基金管理人自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额申购和赎回业务的基金销售机构和场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回 27、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额 28、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额 29、会员单位：指具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位
第二部分 释义 第“31-34、36”	31、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统 32、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统 33、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统 34、上海证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过上海证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统 36、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户	修改后为： 32、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统 33、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在本系统 34、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资者办理场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统 35、上海证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过上海证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统 37、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户
第二部分 释义 第“37、”	37、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期	修改后： 38、基金合同生效日：《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》同日失效
第二部分 释义 第“39、”	39、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过三个月	
第二部分 释义 第“41、”	41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日	修改后为： 41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的正常交易日
第二部分 释义 第“46、”	46、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金份额的行为	
第二部分 释义 第“49-52”	49、场外：指不通过上海证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回 50、场内：指通过上海证券交易所会员单位和上海证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回 51、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额 52、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额	
第二部分 释义 第“55、”	55、巨额赎回：指本基金若本基金单个开放日内，长盛上证50份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额（包括长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额）的10%时的情形	修改后为： 50、巨额赎回：指本基金若本基金单个开放日内，本基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时的情形
第二部分 释义 第“57、”	57、上市交易：基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额的行为	修改后为： 52、上市交易：指投资人通过上海证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
第二部分 释义 第“61-63”	61、场内份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金场内的长盛上证50份额与长盛上证50A份额、长盛上证50B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆与合并 62、分拆：指根据基金合同约定，基金份额持有人将其所持有的每2份场内长盛上证50份额分拆成1份长盛上证50A份额与1份长盛上证50B份额的行为 63、合并：指根据基金合同约定，基金份额持有人将其所持有的每1份长盛上证50A份额与1份长盛上证50B份额进行配对，申请转换为2份场内长盛上证50份额的行为	
第二部分 释义 原第“68、”	68、基金份额参考净值：在T日基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，本基金按照基金合同约定的资产及收益的分配规则进行资产分配从而计算得到T日长盛上证50A份额、长盛上证50B份额的估算价值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值	
第二部分 释义 第“70、”	70、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额（参考）净值的过程	修改后为： 61、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
第二部分 释义 原第“71、”项后		增加以下内容： 66、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
第三部分 基金的基本情况 一、基金名称	长盛上证50指数分级证券投资基金	长盛上证50指数证券投资基金（LOF）
第三部分 基金的基本情况 三、基金的运作方式	契约型开放式	上市契约型开放式（LOF）
第三部分 基金的基本情况 “四、”后	五、基金份额初始面值 本基金的初始面值为人民币1.00元 六、基金最低募集份额总额和最低募集金额 本基金的募集份额总额应不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。	
第三部分 基金的基本情况 原“九、基金份额的上市交易”	九、基金份额的上市交易 本基金合同生效后，长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额将同时申请在上海证券交易所上市交易。	修改后为： 七、基金份额的上市交易 本基金合同生效后，本基金将申请在上海证券交易所上市交易。
第三部分 基金的基本情况 原“九、”后		新增以下内容： 八、未来条件许可情况下的基金模式转换 若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可以在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并提前公告。ETF联接基金是指其绝大部分基金资产投资于跟踪同一标的指数的ETF（目标ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。法律法规另有规定的从其规定。
第四部分 基金份额的分级与净值计算规则	第四部分 基金份额的分级与净值计算规则 一、基金份额结构 本基金的基金份额包括长盛上证50指数分级证券投资基金的基础份额（简称“长盛上证50份额”）、长盛上证50指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“长盛上证50A份额”）和长盛上证50指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“长盛上证50B份额”）。其中，长盛上证50A份额和长盛上证50B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。 二、基金的运作 1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额，将被确认为长盛上证50份额。投资者场内认购所得份额总额的20%，将被确认为长盛上证50份额；剩余80%份额将按1:1的基金份额配比自动分拆为长盛上证50A份额和长盛上证50B份额。基金合同生效后，投资者认购所得的长盛上证50份额的80%场内份额的分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。 2、基金合同生效后，长盛上证50份额设置单独的基金代码，可以进行场内与场外的申购和赎回。在符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下，长盛上证50份额、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额交易代码不同，可在上海证券交易所上市交易，但是长盛上证50A份额和长盛上证50B份额不接受申购或赎回。 3、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额与长盛上证50份额的资产合并投资运作。 4、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的长盛上证50份额与长盛上证50A份额、长盛上证50B份额之间的场内份额配对转换业务，即：基金份额持有人可将其场内的长盛上证50份额，按1:1的基金份额配比，申请分拆为长盛上证50A份额和长盛上证50B份额；或基金份额持有人可将其持有的长盛上证50A份额和长盛上证50B份额，按1:1的基金份额配比，申请合并为长盛上证50份额的场内份额。场外的长盛上证50份额不进行份额配对转换。场外的长盛上证50份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的长盛上证50份额配对转换规则进行操作。 5、无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见本基金合同“第二十部分 基金份额的折算”），其所产生的长盛上证50份额不进行自动分拆。投资人可选择将上述折算产生的场内长盛上证50份额按1:1的比例分拆为长盛上证50A份额和长盛上证50B份额。 三、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额的基金份额参考净值计算规则 本基金按基金合同约定的参考净值计算规则对长盛上证50A份额和长盛上证50B份额分别进行基金份额参考净值计算，具体计算原则如下： （1）本基金一份长盛上证50A份额的参考净值与一份长盛上证50B份额的参考净值之和等于两份长盛上证50份额的净值。 （2）长盛上证50A份额约定年收益率RA为：“一年期同期银行定期存款利率（税后）+3.5%”。RA每年确定一次，确定日分别为基金合同生效日和基金份额定期折算基准日。其中，“一年期同期银行定期存款利率”以RA确定日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。长盛上证50A份额的约定年收益均以1.000元为基准进行计算。 （3）每个工作日计算长盛上证50A份额和长盛上证50B份额参考净值。在进行长盛上证50A份额和长盛上证50B份额各自的份额参考净值计算时，本基金净资产优先确保长盛上证50A份额的本金及长盛上证50A份额的累计约定日应得收益，之后的剩余净资产计为长盛上证50B份额的净资产。长盛上证50A份额累计约定日应得收益按依据长盛上证50A份额约定年收益率计算的每日收益率和截至计算日长盛上证50A份额应计收益的天数确定。 （4）在长盛上证50A份额首次份额折算（包括定期折算和不定期折算，详见本合同“第二十部分 基金份额的折算”）之前，长盛上证50A份额在参考净值计算日应计收益的天数按基金合同生效日至计算日的实际天数计算；长盛上证50A份额首次份额折算之后，长盛上证50A份额在参考净值计算日应计收益的天数按最近一次长盛上证50A份额折算基准日的次日至计算日的实际天数计算。 基金管理人并不承诺或保证长盛上证50A份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在基金存续期内本基金资产出现极端损失情况下，长盛上证50A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。 四、T日长盛上证50份额净值的计算 T日长盛上证50份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日本基金基金份额的余额数量 其中，基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值；本基金基金份额的余额数量为长盛上证50份额、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额的余额数量之和。 长盛上证50份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。T日的长盛上证50份额净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 五、T日长盛上证50A份额和长盛上证50B份额参考净值的计算 $NAVA=1+(RA/N)\times t$； $NAVB=2\times NAV-NAVA$； 其中： NAV为T日长盛上证50份额净值； NAVA为T日长盛上证50A份额参考净值； NAVB为T日长盛上证50B份额参考净值； RA为长盛上证50A份额约定年收益率，在基金合同生效日或份额定期折算基准日确定； N为当年实际天数； t为长盛上证50A份额在参考净值计算日应计收益的天数，t=min{基金合同生效日至T日的实际天数，长盛上证50A份额最近一次折算基准日次日至T日的实际天数}。 长盛上证50A份额与长盛上证50B份额参考净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。长盛上证50A份额和长盛上证50B份额参考净值在当天收市后计算，并在下一日内与长盛上证50份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。	修改后为： 第四部分 基金的历史沿革 长盛上证50指数证券投资基金（LOF）由长盛上证50指数分级证券投资基金转型而来。 长盛上证50指数分级证券投资基金于2015年6月3日获中国证券会证监许可〔2015〕1128号文注册募集。长盛上证50指数分级证券投资基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。基金管理人于2015年8月13日获中国证监会书面确认，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》自该日起生效。 长盛上证50指数分级证券投资基金的变更已经中国证监会2020年8月12日证监许可【2020】1794号文准予变更注册。2020年★月★日至2020年★月★日，长盛上证50指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会以通讯方式召开，并于2020年★月★日大会审议通过了《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》，内容包括调整基金名称、运作方式等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。原长盛上证50指数分级证券投资基金基金份额持有人持有的长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额均转换成长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金份额，具体见基金管理人发布的相关公告。 自2020年★月★日起，长盛上证50指数分级证券投资基金转型为长盛上证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》生效，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。
第五部分 基金份额的发售	第五部分 基金份额的发售 一、发售时间 本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。 二、发售方式 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资者场外认购所得的全部份额将确认为长盛上证50份额；投资者场内认购所得份额总额的20%，将被确认为长盛上证50份额，剩余80%份额将按1:1的基金份额配比自动分拆为长盛上证50A份额和长盛上证50B份额。 场外将通过基金销售网点（包括基金管理人的直销柜台及代销机构的代销网点，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告）公开发售。场内将通过上海证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售。尚未取得基金代销业务资格，但属于上海证券交易所会员的其他机构，可在本基金长盛上证50份额、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额上市后，通过上海证券交易所交易系统办理本基金长盛上证50份额、长盛上证50A份额和长盛上证50B份额的上市交易。 除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。 三、募集对象 本基金的募集对象为个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（有关法律法规规定禁止购买者除外）以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 四、募集规模上限 本基金的募集规模上限具体见《招募说明书》或《发售公告》。 《基金合同》生效后，基金规模不受上述募集规模的限制。 五、认购费用 本基金认购费率由基金管理人确定，并在招募说明书中载明。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。 六、基金认购份额的计算 长盛上证50份额认购份额的计算详见招募说明书。 场外认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金资产承担，产生的收益归基金资产所有。投资者认购所得场内份额先按四舍五入原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的金额退还投资者。 七、募集期间认购资金利息的处理方式 认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。 八、基金认购的具体规定 投资者认购原则、认购限额、认购份额的计算公式、认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在招募说明书和基金份额发售公告中披露。 九、基金份额的认购和持有限额 基金管理人可以对每个基金账户的认购和持有基金份额进行限制，具体限制请参见《招募说明书》或相关公告。投资者可以在同一交易日内多次提交认购申请，当日提交的认购申请在当日接受申请的时段内可以撤销，但已受理的认购申请不得撤销。	
第六部分 基金备案	第六部分 基金备案 一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任： 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用； 2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。 3、如基金募集失败，基金管理人及销售机构不得请求报酬。基金管理人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	修改后为： 第五部分 基金份额的存续 一、基金份额的变更登记 《基金合同》生效后，本基金注册登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。
第七部分 基金份额的上市交易 “一、上市交易的基金份额”	第七部分 基金份额的上市交易 一、上市交易的基金份额 基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请本基金场内长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额上市交易。 二、上市交易的地点 本基金上市交易的地点为上海证券交易所。 长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额上市后，登记在证券登记结算系统中的长盛上证50份额、长盛上证50A份额与长盛上证50B份额可直接在上海证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的长盛上证50份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统后，方可上市交易。 三、上市交易的时间 本基金合同生效后三个月内开始在上海证券交易所上市交易。 在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种指定媒介和网站上刊登《上市交易公告书》。	修改后为： 第六部分 基金份额的上市交易 一、基金份额的上市 1、上市交易的地点 上海证券交易所。 2、上市交易的时间 在符合相关法律法规和基金份额上市条件的前提下，本基金管理人将在基金合同生效后申请本基金基金份额在上海证券交易所上市交易，具体详见基金管理人届时发布的相关业务公告。 基金份额上市交易后，登记在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统中的基金份额可直接在上海证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统中的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记系统后，方可上市交易。 3、上市交易公告 基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

（下转D10版）