长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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（以下简称“基金管理人”）已分别于2015年6月16日、2015年6月17日在《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人官方网站（www.cxfund.com.cn）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中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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，现发布关于以通讯方式召开长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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“基金管理人”）依据中国证券监督管理委员会证监许可【2009】1361号文核准募集的长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”，场内简称：长信100；场内代码：163001）的基金合同已于2010年3月26日生效。

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《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设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，审议变更本基金的投资范围及其他相关事项，将本基金变更为长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

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2015年7月10日起至2015年7月16日17:00止(投票表决时间以表决票收件人收到表决票时间为准)。

（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

本次持有人大会审议的事项为《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其他相关事项的议案》（以下简称“《议案》”，详见附件一）。

三、权益登记日

本次持有人大会的权益登记日为2015年7月9日，即在2015年7月9日交易时间结束后，在本基金注册登记机构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，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（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，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、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2015年7月10日0:00起至2015年7月16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：孙红辉

地址：上海市浦东新区银城中路68号9楼

联系人：孙红辉

联系电话：021-61009911

传真：021-61009917

邮政编码：200120

请在表决票或相关文件表面注明：“长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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2015年7月10日0:00起至2015年7月16日17:00以前（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，以注册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，建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人或基金托管人为受托人。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企业法人营业执照复印件（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企业法人营业执照复印件（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、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、基金托管人授权开始时间及截止时间

基金管理人、基金托管人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为2015年7月10日至2015年7月16日16:30时。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、基金托管人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。具体联系方式如下：

（1）基金管理人

收件人：孙红辉

地址：上海市浦东新区银城中路68号9楼

联系电话：021-61009911

传真：021-61009917

邮政编码：200120

（2）基金托管人

收件人：帅海坤

地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

联系电话：010-67595094

传真：010-66275850-5094

邮政编码：100033

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(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后第2个工作日即2015年7月20日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（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真接收到的时间为准。

2、网络表决票的效力认定

（1）网络投票的截止时间为2015年7月16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）本人直接出具意见或授权他人代表出具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）《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其他相关事项的议案》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、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

如本人直接出具意见或授权他人代表出具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%），则本次基金份额持有人大会未能成功召开，根据《证券投资基金法》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二次召集基金份额持有人大会。

二次召集的基金份额持有人大会，应当有代表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。二次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二次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：孙红辉

联系电话：021-61009911

传真：021-61009917

网址：http://www.cxfund.com.cn

电子邮件：service@cxfund.com.cn

（二）基金托管人：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮编：100033

联系人：帅海坤

联系电话：010-67595094

（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3层、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：200060

联系人：刘佳

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《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意见或授权他人代表出具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）本基金于本公告发布之日（2015年6月16日）开市起停牌至当日10:30复牌。本基金自持有人大会计票之日（2015年7月20日）开市起开始停牌至基金持有人大会决议生效公告日10:30复牌。

（四）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。

（五）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：《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其他相关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

长信基金管理有限责任公司

2015年6月18日

附件一：《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其他相关事项的议案》

长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，提高基金资产的运作效率和基金产品的市场竞争力，长信基金管理有限责任公司依据《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》和《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》进行修改，并将修改后的基金合同变更为《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金合同》。具体内容详见后附《<长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同>修改说明》。

以上议案，请予审议。

附件：《<长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同>修改说明》

《<长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同>修改说明》

一、基金合同的修改要点

（一）变更基金名称

基金名称由“长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）”变更为“长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

（二）变更基金类别

基金类别由“股票型证券投资基金”变更为“混合型证券投资基金”。

（三）修改原基金合同“六、基金份额的上市交易”

1、删除“基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。”

2、将基金份额上市交易的时间由“本基金合同生效后三个月内开始在深圳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提前3个工作日在至少一种指定媒体报刊和网站上刊登公告。”

变更为“长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）已于2010年4月16日在深圳证券交易所上市。因召开基金份额持有人大会，基金管理人向深圳证券交易所申请长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）自201*年*月*日开始持续停牌。在基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将向深圳证券交易所申请本基金的复牌，具体复牌时间详见届时基金管理人发布的相关公告。”

（四）修改投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准等

1、投资目标

基金投资目标由“本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争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%，以实现对标的指数的有效跟踪。”

变更为“本基金通过积极灵活的资产配置，并精选医疗保健行业的优质企业进行投资，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。”

2、投资范围

投资范围由“本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括中证中央企业100指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

本基金投资于股票资产的比例占基金资产的90%-95%，其中，中证中央企业100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

此外，本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，待指数衍生金融产品推出以后，基金管理人可以履行适当程序使本基金运用衍生金融产品进行风险管理。”

变更为“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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、权证、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）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于医疗保健行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。”

3、投资策略

由于基金类别、投资目标、投资范围进行了变更，投资策略进行了相应修改，修改后的投资策略如下：

“1、资产配置策略

本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。

2、股票投资策略

（1）医疗保健行业的界定

本基金将沪深两市中从事医疗保健行业的上市公司定义为医疗保健行业上市公司，具体包括以下两类公司：

1）主营业务从事医疗保健行业（涵盖医药原料、化学原料药及制剂、医药中间体、中药材、中药饮片、中成药、抗生素、生物制品、生化药品、放射性药品、医疗器械、卫生材料、制药机械、药用包装材料、医药商业、医疗服务、中医医疗保健、健康养老、健康体检、健康咨询管理、体育健身、医疗保健旅游、健康保险以及相关服务、保健食品与器械、生命科学工具与服务、医疗信息服务等业务）的公司；

2）当前非主营业务提供的产品或服务隶属于医疗保健行业，且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。

（2）选股策略

本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略，精选医疗保健行业的上市公司股票。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。

① 品质评估分析

品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估，对企业价值进行的有效分析和判断。上市公司品质评估分析包括财务品质评估和经营品质评估。

② 风险因素分析

风险因素分析是对个股的风险暴露程度进行多因素分析，该分析主要从两个角度进行，一个是利用个股本身特有的信息进行分析，包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。

③ 估值分析

个股的估值是利用绝对估值和相对估值的方法，寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型、P/E模型、EV/EBIT模型、Franchise P/E模型等估值模型针对不同类型的产业和个股进行估值分析，另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响，排除通胀的影响因素。

3、债券投资策略

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

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、中小企业私募债等金融工具的投资。

（1）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。

（2）资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析，形成对资产证券的风险和收益进行综合评估，同时依据资产支持证券的定价模型，确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上，本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率，对资产支持证券进行跟踪和测评，从而形成有效的风险评估和控制。

（3）股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（4）中小企业私募债投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。”

4、投资组合比例限制

由于基金类别、投资目标、投资范围进行了变更，投资组合比例限制进行了相应修改，修改后的投资组合比例限制如下：

“（1）股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于医疗保健行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%；

（2）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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（10）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（15）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（16）基金投资流通受限证券时，遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141号）及相关规定执行；

（17）本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（18）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。”

5、业绩比较基准

业绩比较基准由“中证中央企业100指数收益率*95%+银行同行业存款收益率*5%”调整为“中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%”。

6、风险收益特征

风险收益特征由“本基金为股票型指数基金，属于具有较高预期收益和较高风险特征的证券投资基金产品。”

变更为“本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。”

（五）对基金管理费率、托管费率和申购、赎回费率进行了调整

1、基金管理人的管理费

由“在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日。”

变更为：

“本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。”

2、基金托管人的托管费

由“在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日。”

变更为：

“本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。”

3、申购费率

对基金申购费用调整如下：

申购金额(M,含申购费)	申购费率(调整前)	申购费率(调整后)
M<100万	1.2%	1.5%
100万≤M<500万	0.8%	1.0%
500万≤M	1000元每笔	1000元每笔

注：M为申购金额

4、赎回费率

（1）调整前场外赎回费率如下：

持有年限(Y)	赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.3%
2年≤Y	0

调整后场外赎回费率如下：

持有时间(Y)	赎回费率
Y<7天	1.5%
7天≤Y<30天	0.75%
30天≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0%

注：1年指365天，Y为持有期限

（2）调整前后，基金场内赎回费率不变，仍统一为0.5%。

（六）调整基金收益分配原则

基金收益分配原则由“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的30%；”

变更为“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%。”

（七）授权基金管理人修改基金合同等法律文件

首先，基金管理人需要根据变更后基金运作的特点相应修改《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》等法律文件，并根据监管机构意见适时调整本修改说明所载上述六点修改要点的文字表述，但该等调整不得实质性修改上述内容。

其次，自《基金合同》生效以来，《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》、《证券投资基金销售管理办法》等法律法规陆续修改和实施，基金管理人需要根据法律法规要求修改《基金合同》的相关内容。

因此，基金管理人提请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修改《基金合同》等法律文件。修改后的《基金合同》等法律文件将报中国证监会备案。

（八）长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同的生效

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。自基金持有人大会决议生效之日起，《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》同时失效，长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）正式变更为长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF），本基金当事人将按照《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》享有权利并承担义务。基金管理人应当自《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效之日起6个月内使长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的投资组合比例符合该基金合同的有关约定。

二、基金管理人对基金变更相关情况的说明

（一）长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基本情况

长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）于2009年12月11日获中国证监会证监许可【2009】1361号文批准募集。

长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金管理人于2010年3月26日获得中国证监会书面确认，长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同生效。

（二）基金变更法律可行性

本基金由被动型股票基金变更为混合型基金，变更了基金名称、基金类别、投资目标、投资范围、投资策略、基金投资组合比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费率、基金收益分配原则等，属于基金合同的变更。根据《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》“二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，“基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意”。对于变更基金类别、变更基金投资、基金费率等事项，应当召开基金份额持有人大会。因此，本基金管理人认为，本基金变更为混合型基金具有法律依据和合同依据。

（三）基金变更运作方面的可行性

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，基本做好了基金运作的相关准备。

（四）授权基金管理人修改基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会的决议以及法律法规的规定修改《基金合同》。修改后的《基金合同》将经基金管理人和基金托管人签字盖章，报中国证监会备案。

本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据本议案对《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》进行修改，并将修改后的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件报监管机关并公告。

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

2015年6月18日

附件二：授权委托书

本机构持有或申购了长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金份额，就长信基金管理有限责任公司官网（www.cxfund.com.cn）及2015年6月16日在《中国证券报》、《上海证券报》、深圳证券交易所网站（http://www.szse.cn/）公布的《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）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，本机构的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

审议事项	同意	反对	弃权
《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其他相关事项的议案》			

本机构特此授权_ _代表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。

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。若长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）重新召开审议相同议案的持有人大会的，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、基金托管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、如委托人未在授权委托书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