

# 长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之长信一带一路份额上市交易公告书

基金管理人:长信基金管理有限责任公司  
基金托管人:广发证券股份有限公司  
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司  
上市地点:上海证券交易所  
上市时间:2016年2月1日  
公告时间:2016年1月27日

## 一、重要提示与说明

《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之长信一带一路份额上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”),《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人长信基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性个别承担责任。

本基金托管人广发证券股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2015年6月23日登载于《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)以及长信基金管理有限责任公司网站(<http://www.cxfund.com.cn>)的本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

## 二、基金概览

1、基金名称:长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

2、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:

基础份额简称:带路分级;基金代码:502016

3、基金类型:股票型

4、基金运作方式:契约型开放式

5、基金份额分级

本基金的基金份额包括长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额(即“长信一带一路份额”)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“长信一带一路A份额”)与长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“长信一带一路B份额”)。其中,长信一带一路A份额、长信一带一路B份额的比例始终保持1:1的比例不变。

6、长信一带一路份额的申购与赎回:投资者可以通过场外或场内两种方式对长信一带一路份额进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合上海证券交易所风险控制要求的上海证券交易所会员单位,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。

7、长信一带一路份额的跨系统转托管:基金份额持有人可以将持有的长信一带一路份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行跨系统转托管。

8、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的长信一带一路份额与长信一带一路A份额、长信一带一路B份额之间的配对转换,包括基金份额的分拆和合併两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每份长信一带一路份额的场内份额申请转换为1份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额的行为;合併指基金份额持有人将其持有的每份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额申请转换为2份长信一带一路份额的场内份额的行为。本基金的场内份额可以直接申请分拆与合併,场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合併。

9、定期份额折算

在本基金存续期内,每年12月15日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日,若距离上一次基金份额折算不满一个月则可不再进行折算),本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

定期份额折算后长信一带一路A份额的基金份额参考净值调整为1.00元,基金份额折算基准日折算前长信一带一路A份额的基金份额参考净值超出1.00元的部分将折算为长信一带一路份额的场内份额分配给长信一带一路A份额持有人。

长信一带一路份额持有人将其持有的每份长信一带一路份额的场内份额申请转换为1份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额的比例为99.84%。

(三)前十名基金份额持有人的情况

截至2016年1月25日,基础份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

12、基金合同生效日:2015年8月17日。

13、基金合同生效日的基金份额总额215,668,187.59份。

(二)一带一路基础份额上市交易的主要内容:

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2016]16号

2、上市交易日期:2016年2月1日

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金份额易。

4、本次上市的基金份额简称及交易代码:

基础份额简称:带路分级;

交易代码:502016

5、基金场内申购、赎回简称:带路分级

6、场内申购、赎回代码:502016

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更销售机构,并予以公告。

7、本次上市交易份额:基础份额为145,802.00份(截至2016年1月25日)

8、基金资产净值的披露:基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将长信一带一路A份额的基金份额净值、长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金份额参考净值、净值差额、长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金净值公布于基金净值公布后,由基金管理人对外公布。

9、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的场外份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管转至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持有人上海证券账户下后,即可在上海证券交易所上市交易。跨系统转托管及份额配对转换业务已于2015年8月24日开通。

10、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2016年1月25日,本基金基础份额持有人户数为1,185户(场外户数与拆分后的场内户数之和),平均每户持有的基金份额为14,012.54份。其中,场内基础份额持有人户数为331户,平均每户持有的基础基金份额为440.49份。

(二)持有人结构

截至2016年1月25日,机构投资者持有的本次上市交易的场内基础基金份额为234.00份,占本次基础份额上市交易基金份额比例为0.16%;

个人投资者持有的本次上市交易的场内基础基金份额为145,568.00份,占本次基础份额上市交易基金份额比例为99.84%。

(三)前十名基金份额持有人的情况

截至2016年1月25日,基础份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

11、内部组织结构及职能

股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会。我公司实行董事会领导下的总经理负责制,总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。根据我公司发展战略和组织管理原则,结合基金管理的业务特点,在经营管理层下设立内部控制委员会、投资决策委员会等非常设委员会,以及投资管理部、研究发展部、交易管理部、固定收益部、量化投资部、产品开发部、客户理财部、基金事业部、零售服务部、机构业务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、国际业务部、电子商务部、财务管理中心、客户服务部、客户理财部共18个部门,并设立了北京分公司、深圳分公司和武汉办事处。

投资管理部

负责A股非固定收益类基金资产的投资运作和管理业务。

研究发展部

负责投资组合的基础研究,主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息,研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情况,为投资组合的投资决策提供建议和依据。

交易管理部

负责制定交易管理的基本制度,核查指令的合规性,准确及时地执行交易指令,进行市场分析、询价,维护有关交易数据,协调与交易相关的业务关系等。

固定收益部

负责分析和研究经济、货币政策和财政政策等有关信息,向投资决策委员会提供固定收益证券的投资策略和资产配置建议,负责公司固定收益类基金的投资运作和管理业务。

量化投资部

负责各类投资组合的风险与业绩评估、数量分析研究、量化投资研究等工作。

产品开发部

负责公司私募基金的产品设计开发工作和产品申报工作。

专户理财部

负责特定客户资产管理业务的运作和管理工作。

基金事业部

负责各类投资组合资产的清算、会计核算、注册登记、直销客户业务办理等业务。

零售服务部

负责新基金发行以及基金日常持续营销的营销策划,营销方案实施,销售支持,品牌宣传,渠道维护,后台管理等工作,为客户提供增值服务。

机构业务部

负责公司机构客户的开拓、维护、服务,为机构客户提供专业服务,根据客户需求提供各类产品和解决方案。

信息技术部

负责提供信息系统支持,保障公司日常经营正常运转。

监察稽核部

在公司内行使监察稽核职权,负责公司的法律事务、信息披露、各项业务的常规监察稽核和专项监察稽核等工作,在业务上接受督察长和内部控制委员会的指导和监督。

综合行政部

全面负责公司的行政后勤、人力资源的开发与管理等工作。

国际业务部

负责公司国际业务的开发和拓展工作。

电子商务部

负责公司电子商务平台建设,公司网站及网上直销系统功能策划,完善网站、微博及微信的营销、宣传、服务功能。

财务管理部

负责公司财务管理及自有资产管理等工作。

机构服务部

负责承接特定客户资产管理业务的支持性工作。

专户投资部

负责特定客户资产管理业务的投资运作等工作。

北京分公司

负责公司与中国证监会、托管银行等相关部门的沟通与联系,负责北方地区的各项业务的拓展工作。

(二)场内发售机构

直销机构:长信基金管理有限责任公司

代销机构:

具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位(名单详见上海证券交易所网站)

(2)场外发售机构

直销机构:长信基金管理有限责任公司

代销机构:

具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位(名单详见上海证券交易所网站)

12、基金合同持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由长信一带一路份额、长信一带一路A份额、长信一带一路B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的一每份基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

深圳分公司

主要负责公司在华南地区的各项业务的拓展工作,同时负责公司与深圳证监局、总部设在华南的银行等相关部门的沟通与联系。

武汉办事处

负责公司中华地区的各项联络性事务,不从事经营性活动。

12、人员情况:

截至2016年1月25日,公司现有正式员工142人,博士学历3人,占2%;硕士学历72人,占51%;本科学历60人,占42%;专科学历4人,占3%;其它3人,占2%。

13、信息披露负责人及咨询电话:

周永刚,(021)61009999

14、基金管理业务情况简介:

目前公司已具有发起设立公募基金、特定客户资产管理业务和合格境内机构投资者(DII)业务资格,受托管理保险资金业务资格。

截至2016年1月25日,我公司目前已39只开放式基金获批,其中已成立31只,1只已获批正在发行,1只发行结束尚未成立,6只已获批未发行。这39只已获批基金分别为:2只货币型基金(其中1只已获批未发行),14只债券型基金(其中1只已获批未发行,2只已获批未发行),16只混合型基金(其中2只已获批未发行,1只ODII基金)。专户理财业务方面,我公司管理14只“一对多”资产管理计划。

公司最近一年内没有因违法违规行为受到行政处罚或者刑事处罚,没有因违法违规行为正在被监管部门调查,或者处于整改期间,不存在对基金运作已造成或可能造成不良影响的重大变更事项,或者诉讼、仲裁等其他重大事项,不存在公司治理不健全、经营管理混乱、内部控制和风险管理机制无法得到有效执行、财务状况恶化等重大经营风险。

15、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金管理人提供服务的外部机构:

16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和交易过户的业务规则;

17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2)办理基金备案手续;

3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的方式管理基金财产和运作基金财产;

5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理、分别记账、进行证券投资;

6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及其第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7)依法接受基金托管人的监督;

8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值,确定长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金份额净值和申购赎回价格、长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金份额净值和申购赎回价格;

9)对于基金财产的损失承担赔偿责任,对基金财产和基金管理人、基金托管人、基金份额持有人造成损害的,应当承担赔偿责任;

10)对基金财产进行处分时,应当按照《基金合同》的规定,履行相关手续;

11)对基金财产进行投资时,应当按照《基金合同》的规定,履行相关手续;

12)依照法律法规对基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;