

# 关于修改长盛上证 50 指数分级证券投资基金 基金合同等法律文件的公告

长盛上证50指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕1128号文准予募集，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》于2015年8月13日正式生效。根据2017年10月1日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《规定》”），对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合该《规定》的，应当在《规定》施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。

本次《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》”）和《长盛上证50指数分级证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的修订内容，符合《规定》和相关法律法规的规定及《基金合同》的相关约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响。本基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）已就本次《基金合同》、《托管协议》修订内容与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并履行了规定的程序。

## 一、重要提示

1、本基金《基金合同》《托管协议》修改的具体内容详见附件《〈长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同〉修订对照表》《〈长盛上证50指数分级证券投资基金托管协议〉修订对照表》，《长盛上证50指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）涉及《基金合同》《托管协议》相关变动处一并修改。

2、《基金合同》《托管协议》和《招募说明书》的修改内容自2018年3月30日起生效。

3、自2018年3月30日起，本基金对于持续持有期少于7日的投资者赎回基金份额时收取1.5%的赎回费，并将前述赎回费全部计入基金财产。对于2018年3月29日15:00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则；对于2018年3月29日15:00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。

转换业务涉及的本基金赎回费相关规则按上述规则进行调整。

4、投资者可以登录本公司网站（www.csfunds.com.cn）查询或者致电本公司客户服务电话400-888-2666（免长途话费）、010-62350088咨询。

## 二、风险揭示

本公司承诺以诚实信用、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。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》。特此公告。

附件1：《〈长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同〉修订对照表》

附件2：《〈长盛上证50指数分级证券投资基金托管协议〉修订对照表》

长盛基金管理有限公司

2018年3月23日

附件 1:《〈长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金合同〉修订对照表》

(斜体字为新增或修改后的内容)

章节	《基金合同》修改前条款	《基金合同》修改后条款	《流动性规定》 依据条款	其他说明
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则 .....</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律、法规。 .....</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则 .....</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<i>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</i>(以下简称“<i>《流动性规定》</i>”)和其他有关法律、法规。 .....</p>	全文	新增《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为订立基金合同的依据。

<p>第二部分 释义</p>		<p>新增 .....</p> <p><b>14、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</b> .....</p> <p><b>73、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</b></p>	<p>全文  第 40 条</p>	<p>新增《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的释义。 补充流动性受限资产定义。</p>
<p>第八部分 长盛上证 50 份额的 申购与赎回</p>	<p>四、申购与赎回的数额限制</p>	<p>四、申购与赎回的数额限制 .....</p> <p>新增： <b>4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。</b></p>	<p>第 19 条</p>	<p>补充基金规模控制措施。</p>

<p>第八部分 长盛上证 50 份额的 申购与赎回</p>	<p>七、申购与赎回的价格、费用及其用途 ..... 2、本基金的申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p>	<p>七、申购与赎回的价格、费用及其用途 ..... 2、本基金的申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。<b>本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。</b></p>	<p>第 23 条</p>	<p>补充短期赎回费的规定。</p>
<p>第八部分 长盛上证 50 份额的 申购与赎回</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理 ..... 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。  ..... 发生上述第 1、2、3、5、<del>6</del>项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理 ..... 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益<b>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响</b>时。 新增： <b>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</b> <b>7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</b> ..... 发生上述第 1、2、3、5、<b>7、8</b>项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申</p>	<p>第 19 条  第 19 条  第 24 条</p>	<p>补充拒绝或暂停申购的情形。</p>

	人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。		
第八部分 长盛上证 50 份额的 申购与赎回	十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理 ……	十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理 …… 新增： <b>6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</b> ……	第 24 条	补充暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形。
第八部分 长盛上证 50 份额的 申购与赎回	十一、巨额赎回的情形及处理方式 2. 巨额赎回的处理方式	十一、巨额赎回的情形及处理方式 2. 巨额赎回的处理方式 新增 <b>(3) 若本基金发生巨额赎回的，且存在单个基金份额持有人单日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分进行自动延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日，并与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权且以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤</b>	第 21 条	明确对巨额赎回情形下赎回比例过高的单一份额持有人采取延期赎回的条件及具体措施。



	<p>.....</p> <p>因证券期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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 个工作日内进行调整但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p><b>(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;</b></p> <p>.....</p> <p><b>除上述第 (7)、(10)、(13)、(14) 项外,</b>因证券期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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 个工作日内进行调整但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	第 17 条	
第十七部分 基金资产估值	七、暂停估值的情形	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p>新增:</p> <p><b>3. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;</b></p>	第 24 条	补充应当暂停估值的情形。
第二十三部分 基金的信息披露	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、 <b>《流动性规定》</b> 、《基金合同》及其他有关规定。		新增《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为信息披露的依据。
第二十三部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 定期报告</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 定期报告</p> <p>新增:</p> <p>.....</p> <p><b>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管</b></p>	第 27 条	补充定期报告的内容。



		<p>理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p>	第 26 条	
第二十三部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七) 临时报告与公告</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七) 临时报告与公告</p> <p>新增： .....</p> <p><b>31、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</b></p>	第 26 条	补充临时报告的内容。

附件2：《长盛上证50指数分级证券投资基金托管协议》修订对照表

（斜体字为新增或修改后的内容）

章节	《托管协议》修改前条款	《托管协议》修改后条款	《流动性规定》依据条款	说明
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>（一）依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《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》”）订立。</p>	<p>（一）依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、<i>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</i>及其他有关法律法规与《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》”）订立。</p>	全文	新增《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为订立托管协议的依据。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>……</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的80%，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%，其中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%，权证投资不高于基金资产净值的3%。</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>……</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的80%，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%，其中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%，<i>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</i>，权证投资不高于</p>	第18条	明确现金类资产范围。

	<p>2、对基金投融资比例进行监督： .....</p> <p>(10) 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，本基金持有的现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人</p>	<p>基金资产净值的 3%。</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督： .....</p> <p>(10) 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，本基金持有的现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<b>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</b> .....</p> <p>新增： <b>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</b> <b>(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；本基金管理人承诺本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失。</b> .....</p> <p><b>除上述第 (7)、(10)、(13)、(14) 项外，</b>因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金</p>	<p>第 18 条</p> <p>第 16、40 条</p> <p>第 17 条</p>	<p>明确现金类资产范围。</p> <p>补充投资交易比例限制。</p>
--	---	--	--	--------------------------------------

	<p>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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。</p>	<p>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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。</p>		
--	--	--	--	--