关于修改长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同等法律文件的公告

长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2013】902号文准予募集，《长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年9月24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《长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”）和《长盛双月红1年期定期开放债券型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》和《托管协议》修订内容与本基金托管人中国农业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《<长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同>修订对照表》《<长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金托管协议>修订对照表》,《长盛双月红1年期定期开放债券型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，本基金对于在同一开放期内申购后又赎回且持有基金份额少于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。

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：《<长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同>修订对照表》

附件2：《<长盛双月红1年期定期开放债券型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：《长盛双月红1年期定期开放债券型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	《流动性风险管理规定》依据条款	说明
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 …… 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。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 …… 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》”）、***《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“《流动性风险管理规定》”）***和其他有关法律法规。		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。
第二部分 释义	……	…… 新增： ***13、《流动性风险管理规定》：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*** …… ***60、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***	第 40 条	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。

		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）、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 ***61、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 40 条	补充摆动定价机制定义。
第七部分基金份额的申购与赎回	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则 …… 新增： ***6、本基金暂不采用摆动定价机制。***	第 25 条	补充申购与赎回的原则。
第七部分基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ……	五、申购和赎回的数量限制 …… 新增： ***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，具体参见基金管理人相关公告。***	第 19 条	补充基金规模控制措施。
第七部分基金份额的申购与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 本基金将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额两种，A类基金份额收取申购费~~***，不收取赎回费用***~~；C类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费用~~***和赎回费用***~~。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 本基金将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额两种，A类基金份额收取申购费；C类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费用。		

	…… 5、本基金 A 类基金份额的申购费用最高不超过申购金额的 5%，本基金 C 类份额不收取申购费。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。	…… 5、本基金A类基金份额的申购费用最高不超过申购金额的5%，本基金C类份额不收取申购费。***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。***本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、***赎回费率***、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。	第 23 条	补充短期赎回费的规定。
第七部分基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 4、基金管理人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、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 4、基金管理人认为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***或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。*** 新增： ***6、接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额50%以上时。*** ***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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。*** …… 发生上述第 1、2、3、5、***7、8***项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资	第 19 条 第 19 条 第 24 条	补充拒绝或暂停申购的情形。

	告。如果投资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。	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。		
第七部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 新增： ***4、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。***	第 24 条	补充暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形。
第七部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 ~~*（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 20%的前提下，可对其余赎回申请延期办理，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占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继续赎回，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销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金*~~	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… ***（2）延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对当日全部赎回申请进行确认，并延缓支付赎回款项。即基金管理人在正常支付的赎回申请不低于上一工作日基金总份额 20%的前提下，对其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过 20 个工作日。对于当日正常支付的款项，按当日单个账户赎回申请占全部赎回申请的比例在单个账户间分配。***		

	~~*额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。*~~	新增： *（3）在开放期内，当基金出现巨额赎回且存在单个基金份额持有人净赎回申请超过前一工作日基金总份额 10%的情形下，基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或者因支付投资人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以在基金当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 20%的前提下，优先确认其他赎回申请人的赎回申请（即赎回申请不超过前一工作日基金总份额 10%的单个基金份额持有人的赎回申请），并在仍可接受赎回申请的范围内对该赎回申请人的赎回申请予以确认，未予确认的赎回申请延期办理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，无优先权并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销。如赎回申请延期办理期限超过赎回业务开放期的，则赎回业务开放期相应延长，延长的开放期内仅办理原开放期内赎回申请的延期赎回业务，不接受新的赎回申请。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。* ……	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。
第十三部分 基金的投资	二、投资范围 ……	二、投资范围 ……		

	在开放期，本基金持有的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%。在非开放期，本基金不受该比例的限制。 ……	在开放期，本基金持有的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***。在非开放期，本基金不受该比例的限制。 ……	第 18 条	明确现金类资产范围。
第十三部分 基金的投资	五、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… （2）在开放期，本基金持有的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%，在非开放期，本基金不受该比例的限制； …… …… 因证券市场波动、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	五、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… （2）在开放期，本基金持有的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***。*在非开放期，本基金不受该比例的限制；* …… 新增： ***（10）开放期内，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、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；*** ***（11）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；*** …… ***除上述第（2）、（8）、（10）、（11）项外，***因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之	第 18 条 第 16、40 条 第 17 条	明确现金类资产范围。 补充投资交易比例限制。

	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。法律法规另有规定的，从其规定。	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。法律法规另有规定的，从其规定。		
第十五部分 基金资产估值	七、暂停估值的情形 ……	七、暂停估值的情形 …… 新增： ***4、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；***	第 24 条	补充暂停估值的情形。
第十九部分 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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。	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》、***《流动性风险管理规定》***、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。		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。
第十九部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 …… （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 ……	五、公开披露的基金信息 …… （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 …… 新增： ***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。*** ***报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信***	第 26 条 第 27 条	补充定期报告的内容。

		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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。		
第十九部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 （七）临时报告 ……	五、公开披露的基金信息 （七）临时报告 …… 新增： ***27、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；***	第 26 条	补充临时报告的内容。

附件 2：《<长盛双月红 1 年期定期开放债券型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	《流动性风险管理规定》依据条款	其他说明
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、***《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》***、基金合同及其他有关规定制订。		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	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 在开放期，本基金持有的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%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 在开放期，本基金持有的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***。在非开放期，本基金不受该比例的限制。	第 18 条	明确现金类资产范围。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……		

	2、在开放期，本基金持有的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%。在非开放期，本基金不受该比例的限制； …… …… 因证券市场波动、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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。	2、在开放期，本基金持有的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。***在非开放期，本基金不受该比例的限制； …… 新增： ***10、开放期内，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、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；*** ***11、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；*** …… ***除上述第 2、8、10、11 项外，***因证券市场波动、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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。	第 18 条 第 16、40 条 第 17 条	明确现金类资产范围。 补充投资交易比例限制。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… 新增： ***（4）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***	第 24 条	补充暂停估值与公告基金份额净值的情

		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；		形。