

# 关于修改长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同等法律文件的公告

长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2016）2767号文准予募集，《长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月20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《长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《长盛盛弘灵活配置混合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工商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》修改的具体内容详见附件《〈长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》《〈长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金托管协议〉修订对照表》，《长盛盛弘灵活配置混合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C类基金份额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C类基金份额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.csfund.com.cn](http://www.csfund.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：《〈长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》

附件2：《〈长盛盛弘灵活配置混合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：《〈长盛盛弘灵活配置混合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

.....

56、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

57、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

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。

补充摆

动定价机制

的定义。

第 六

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。

第六

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，具体请参见相关公告。

第

19'条

补充基

金规模控制

措施。

第六  
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

.....

5、赎回费用由赎回基金份额  
的基金份额持有人承担，在基金份  
额持有人赎回基金份额时收取。赎  
回费用应根据相关规定按照比例  
归入基金财产，未计入基金财产的  
部分用于支付登记费和其他必要  
的手续费。

.....

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

.....

5、赎回费用由赎回基金份额的基  
金份额持有人承担，在基金份额持  
有人赎回基金份额时收取。赎回费用应  
根据相关规定按照比例归入基金财  
产，未计入基金财产的部分用于支付  
登记费和其他必要的手续费。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。

.....

第

23'条

补充短  
期赎回费的  
规定。

第六  
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请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

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请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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

19-条

第

19 条

第

24 条

补充拒

绝或暂停申  
购的情形。

第六  
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

.....

发生上述第 1、2、3、5 项情形  
时，基金管理人应在当日报中国证  
监会备案，已确认的赎回申请，基  
金管理人应足额支付；如暂时不能  
足额支付，应将可支付部分按单个  
账户申请量占申请总量的比例分  
配给赎回申请人，未支付部分可延  
期支付。若出现上述第 4 项所述情  
形，按基金合同的相关条款处理。

基金份额持有人在申请赎回时可  
事先选择将当日可能未获受理部  
分予以撤销。在暂停赎回的情况消  
除时，基金管理人应及时恢复赎回  
业务的办理并公告。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的  
情形

.....

新增：

5、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。

.....

发生上述第 1、2、3、5、6 项情形  
时，基金管理人应在当日报中国证监  
会备案，已确认的赎回申请，基金管  
理人应足额支付；如暂时不能足额支付，  
应将可支付部分按单个账户申请量占  
申请总量的比例分配给赎回申请人，

未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

第

24-条

补充应

当暂停赎回

的情形。

第六

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

.....

九、巨额赎回的情形及处理方式

2、巨额赎回的处理方式

.....

新增

(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销。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作延期赎回处理。

.....

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

二部

分基

金的

投资

二、投资范围

.....

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

二、投资范围

.....

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

第

18-条

明确现  
金类资产范  
围。

## 第十 二部 分基 金的 投资

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下  
限制：

.....

(2) 每个交易日日终，在扣除  
股指期货和国债期货合约需缴纳  
的交易保证金后，现金或到期日在  
一年以内的政府债券的投资比例  
不低于基金资产净值的 5%；

.....

除上述第(12)项外，因证券  
期货市场波动、上市公司合并、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 个交易日内进行调整。法  
律法规或中国证监会另有规定时，  
从其规定。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限  
制：

.....

(2) 每个交易日日终，在扣除股  
指期货和国债期货合约需缴纳的交易  
保证金后，现金或到期日在一年以内  
的政府债券的投资比例不低于基金资  
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；

.....

新增：

(18) 本基金管理人管理的全部  
开放式基金持有一家上市公司发行的  
可流通股票，不得超过该上市公司可  
流通股票的 15%； 本基金管理人管理

的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(19) 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；

(20) 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)、(12)、(19)、(20) 项外，因证券期货市场波动、上市公司合并、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 个交易日内进行调整。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第

18 条

第

15 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。

第十

四部

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:

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；

第

24-条

补充应

当暂停估值

的情形。

第十

八部

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

八部

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

26-条

第

27-条

补充定

期报告的内

容。

第十

八部

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：

.....

28、 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: 《〈长盛盛弘灵活配置混合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

说明

二、基

金 托

管 协

议 的

依据、

目 的

和 原

则

订立本协议的依据是《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7-号〈托管协议的内容与格式〉》、《长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定。

订立本协议的依据是《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7-号〈托管协议的内容与格式〉》、《长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《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》作为订立托管协议的依据。

### 三、基金托管人对基金管理人业务的监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

2、基金托管人根据有关法律、法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

2、 基金托管人根据有关法律、法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

#### 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

(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

2、 基金托管人根据有关法律、法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

.....

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

b、每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不



低于基金资产净值的 5%;

.....

除上述第 1 项外，因证券期货市场波动、上市公司合并、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 个交易日内进行调整。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

2、基金托管人根据有关法律、法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:

.....

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制:

b、每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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;

.....

新增:

q、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

r、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;

s、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 b、l、r、s 项外，因证券期货市场波动、上市公司合并、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 个交易日内进行调整。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第 18 条

第 15 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

(六) 暂停估值的情形

(六) 暂停估值的情形

.....

新增：

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；

第 24 条

补充暂

停估值的情  
形。