

长盛基金管理有限公司

关于旗下指数基金根据《侧袋机制指引》及《指数基金指引》 修改基金合同部分条款的公告

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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》（以下简称“《侧袋机制指引》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）等法律法规的规定及各基金基金合同、招募说明书及其更新的约定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）对旗下9只指数基金（包括：长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、长盛全债指数增强型债券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）、长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）、长盛上证50指数证券投资基金（LOF）、长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF））的基金合同等法律文件进行修改，本次修改将自2021年3月30日起正式生效。现将相关事项公告如下：

一、基金合同修改的具体内容

1、“前言”章节

“前言”章节增加如下内容：

“本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券（股）停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。”

“当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，且不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。”

2、“释义”章节

“释义”章节增加如下内容：

“《指数基金指引》：指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订”

“侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。

侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产”

3、“基金份额的申购与赎回”章节

“基金份额的申购与赎回”章节增加如下内容：

“实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。”

4、“基金份额持有人大会”章节

“基金份额持有人大会”章节增加如下内容：

“实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含

二分之一)通过;

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。”

5、“基金的投资”章节

“基金的投资”章节增加如下内容:

“标的指数编制方法具体见招募说明书的规定。

未来若出现标的指数不符合要求(因成份券(股)价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。”

“侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。”

6、“基金资产估值”章节

(1)“暂停估值的情形”项下原文为:“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”修改为:“当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值”

(2)增加如下内容:

“实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值, 暂停披露侧袋账户份额净值。”

7、“基金费用与税收” 章节

“基金费用与税收” 章节增加如下内容:

“实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的, 与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支, 但应待侧袋账户资产变现后方可列支, 有关费用可酌情收取或减免, 但不得收取管理费, 详见招募说明书的规定。”

8、“基金的收益与分配” 章节

“基金的收益与分配” 章节增加如下内容:

“实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的, 侧袋账户不进行收益分配, 详见招募说明书的规定。”

9、“基金的信息披露” 章节

“基金的信息披露” 章节增加如下内容:

“实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的, 相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露, 详见招募说明书的规定。”

10、“基金合同的变更、终止与基金财产的清算” 章节

“基金合同的变更、终止与基金财产的清算” 章节中 “三、《基金合同》的终止事由” 项下增加一款内容:

“出现标的指数不符合要求(因成份券(股)价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形, 基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决, 基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的”

二、其他事项

本次相关基金修改后的基金合同自 2021 年 3 月 30 日起生效, 基金管理人已履行了规定程序, 符合相关法律法规的规定及各基金基金合同的约定。根据修改的基金合同, 基金管理人将更新基金的托管协议、招募说明书及基金产品资料概要相关内容, 并揭示风险。本次修订后的基金合同、托管协议、招募说明书和产品资料概要将在本公司网站及中国证监会基金电子披露网站发布。

投资人可登录本公司网站（www.csfunds.com.cn）或拨打客户服务电话（400-888-2666）咨询相关事宜。

风险提示：本基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证投资于基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资人在投资基金前应当认真阅读基金合同、基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。本基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

特此公告。

长盛基金管理有限公司

2021年3月30日