

# 关于修改长盛中小盘精选混合型证券投资基金 基金合同等法律文件的公告

长盛中小盘精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“长盛中小盘精选”）根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《长盛同鑫二号保本基金合同》”）的约定由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金（以下简称“长盛同鑫二号保本”）第一个保本周期届满后转型而来。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《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《长盛中小盘精选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》、《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、基金的历史沿革

长盛中小盘精选根据《长盛同鑫二号保本基金合同》的约定由长盛同鑫二号保本第一个保本周期届满后转型而来。

长盛同鑫二号保本经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2012〕679 号文核准募集，长盛同鑫二号保本基金合同于 2012 年 7 月 10 日生效。

2015年7月10日，长盛同鑫二号保本第一个保本周期届满。根据《长盛同鑫二号保本基金合同》的约定，在保本周期届满的次日，长盛同鑫二号保本转型为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”。

## 二、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《长盛中小

盘精选混合型证券投资基金基金合同>修订对照表》、《<长盛中小盘精选混合型证券投资基金托管协议>修订对照表》，《长盛中小盘精选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、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。

### 三、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：《<长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同>修订对照表》

附件2：《<长盛中小盘精选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 1:《〈长盛中小盘精选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 ..... <b>13、《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> ..... <b>53、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>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制 ..... 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>第六部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>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。赎回费用不低于 25% 的部分归入基金财产，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。 .....</p>	<p>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，<b>其中，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，对持续持有期长于 7 日（含）的投资者收取的赎回费，以不低于 25% 的比例归入基金财产，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。</b> .....</p>	<p>第 23 条</p>	<p>补充短期赎回费的规定。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>八、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。  ..... 发生上述第 1、2、3、5、6、7、<del>8</del>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</p>	<p>八、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<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>8、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>9、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、6、7、<b>9、10</b> 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</p>	<p>第 19 条  第 19 条  第 24 条</p>	<p>补充应当暂停申购的情形。</p>

	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。	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。		
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p><b>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></p> <p>.....</p> <p>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。</p>	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	<p>十、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p>新增</p>	<p>十、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p>新增</p> <p><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</b></p>	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

		<p>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。</p> <p>.....</p>		<p>期赎回的条件及具体措施。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%，其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%，其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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>本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。</p>	第 18 条	补充现金类资产范围。
第十二部分 基金的投资	<p>六、投资禁止行为与限制</p> <p>3、基金投资组合比例限制</p> <p>.....</p>	<p>六、投资禁止行为与限制</p> <p>3、基金投资组合比例限制</p> <p>.....</p>		





	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、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。法律法规另有规定时,从其规定。</p>	<p><b>(13) 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(5)、(6)、(12)、(13)项外,</b>因证券市场波动、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。法律法规另有规定时,从其规定。</p>	第 17 条	
第十四部分基金资产估值	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>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,基金管理人应当暂停估值;</b></p>	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	<p>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。</p>	<p>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。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。</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》作为信息披露的依据。
第十八部分基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(四)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</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(四)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</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</b></p>	第 27 条	补充定期报告的内

		<p>本基金总份额 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	容。
第十八部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (五) 临时报告	<p>五、公开披露的基金信息 (五) 临时报告 新增： ……</p> <p><b>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；</b></p>	第 26 条	补充临时报告的内容。

附件2：《长盛中小盘精选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《长盛中小盘精选混合型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《长盛中小盘精选混合型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>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>……</p> <p>（5）现金或者到期日不超过1年的政府债券合计不低于基金资产净值的5%；</p> <p>（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外；<i>本基金应投资于信用级别为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</i></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>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>……</p> <p>（5）现金或者到期日不超过1年的政府债券合计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></p> <p><i>（6）本基金应投资于信用级别为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</i></p> <p>（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得</p>	第18条	<p>明确现金类资产范围。</p> <p>完善表述。</p>

	<p><b>日起3个月内予以全部卖出</b>；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的<b>10%</b>；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的<b>10%</b>；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的<b>10%</b>；</p>	<p>超过基金资产净值的<b>20%</b>，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的<b>10%</b>；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的<b>10%</b>；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的<b>10%</b>；</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p><b>(11) 本基金管理人管理且由本托管人托管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%；本基金管理人管理且由本托管人托管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%；</b></p> <p><b>(12) 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></p> <p><b>(13) 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</b></p>	<p>第15条</p> <p>第16、40条</p> <p>第17条</p>	<p>补充投资交易比例限制。</p>
--	---	--	--	--------------------

	<p>因证券市场波动、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。法律法规另有规定时,从其规定。</p>	<p><i>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;</i></p> <p>.....</p> <p><i>除上述第(5)、(6)、(12)、(13)项外,</i>因证券市场波动、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。法律法规另有规定时,从其规定。</p>		
--	---	---	--	--