

关于修改长盛量化红利策略混合型证券投资基金 基金合同等法律文件的公告

长盛量化红利策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“长盛量化红利混合”）由长盛量化红利策略股票型证券投资基金（以下简称“长盛量化红利股票”）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《长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《长盛量化红利策略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、基金的历史沿革

长盛量化红利混合由长盛量化红利股票转型而来。长盛量化红利股票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[2009]927号《关于核准长盛量化红利策略股票型证券投资基金募集的批复》核准募集。基金管理人于2009年11月25日获得中国证监会书面确认，长盛量化红利股票基金合同生效。

2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第104号，以下简称“《运作办法》”）第三十条第一项规定“百分之八十以上的基金资产投资于股票的，为股票基金”，《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》的第三项第二条规定：“《运作办法》第三十条第一项规定自实施之日起一年后开始执行”。基金管理人根据上述规定，本着基金份额持有人利益优先原则，经对相关风险进行审慎、充分评估，与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定不变更长盛量化红利股票的股票投资比例，并于2015年7月16日发布公告即日起将长盛

量化红利股票变更为混合型证券投资基金，其基金名称变更为“长盛量化红利策略混合型证券投资基金”，基金简称变更为“长盛量化红利混合”。长盛量化红利股票基金合同、托管协议、招募说明书等相关法律文件亦应做相应变更。

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《〈长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》、《〈长盛量化红利策略混合型证券投资基金托管协议〉修订对照表》，《长盛量化红利策略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。

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：《〈长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》

附件2：《〈长盛量化红利策略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:《长盛量化红利策略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 前言和释义	<p>前言</p> <p>为保护基金投资者合法权益,明确《基金合同》当事人的权利与义务,规范长盛量化红利策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《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》)、《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6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定,在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”)。</p>	<p>前言</p> <p>为保护基金投资者合法权益,明确《基金合同》当事人的权利与义务,规范长盛量化红利策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《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》)、《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》(以下简称《流动性风险管理规定》)</i>、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定,在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”)。</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>第一部分 前言和释 义</p>		<p>释义</p> <p>8、《流动性风险管理规定》：《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</p> <p>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。</p> <p>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</p>	<p>全文</p> <p>第 40 条</p> <p>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。</p> <p>补充流动性受限资产定义。</p> <p>补充摆动定价机制的定义。</p>
<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>新增： 5、本基金暂不采用摆动定价机制。</p>	<p>第 25 条</p>	<p>补充申购与赎回的原则。</p>

<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数额限制</p>	<p>五、申购和赎回的数额限制 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。</p>	<p>第 19 条</p>	<p>补充基金规模控制措施。</p>
<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>六、申购费用和赎回费用 2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。</p>	<p>六、申购费用和赎回费用 2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。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。</p>	<p>第 23 条</p>	<p>补充短期赎回费的规定。</p>
<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 (6)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 (5) 基金管理人认为会有损于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的某笔申购； 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；</p>	<p>第 19 条 第 19 条</p>	<p>补充拒绝或暂停申购的情形。</p>

	<p>.....</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>	<p>（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；</p> <p>.....</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）、（2）、（3）、（4）、（7）、（8）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>	第 24 条	
第五部分基金份额的申购与赎回	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>.....</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>（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；</p>	第 24 条	补充暂停赎回的情形。
第五部分基金份额的申购与赎回	<p>十一、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>十一、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>新增</p> <p>.....</p> <p>（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</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>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。</p>		<p>期赎回的条件及具体措施。</p>
第十一部分基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>……</p> <p>基金资产配置比例为：股票类资产占基金资产的比例为 60%—95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的 80%。债券类资产占基金资产的比例为 0%—40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>……</p> <p>基金资产配置比例为：股票类资产占基金资产的比例为 60%—95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的 80%。债券类资产占基金资产的比例为 0%—40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或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。</p>	第 18 条	<p>明确现金类资产范围。</p>
第十一部分基金的投资	<p>六、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>e、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基</p>	<p>六、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>e、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基</p>	第 18 条	<p>明确现金类资产范</p>

	<p>金资产净值 5%;</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>金资产净值 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</p> <p>.....</p> <p>新增:</p> <p>k、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%;</p> <p>1、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;</p> <p>m、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;</p> <p>.....</p> <p>除上述第 e、l、m 项外, 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>第 15 条</p> <p>第 16、40 条</p> <p>第 17 条</p>	<p>围。</p> <p>补充投资交易比例限制。</p>
第十三部分基金资	<p>八、暂停估值的情形</p> <p>.....</p>	<p>八、暂停估值的情形</p> <p>.....</p>		

产估值		<p>新增：</p> <p>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；</p>	第 24 条	补充暂停估值的情形。
第十七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》、 《流动性风险管理规定》 、《基金合同》及其他有关规定。	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。
第十七部分基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p> <p>新增： ……</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> <p>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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>	<p>第 26 条</p> <p>第 27 条</p>	补充定期报告的内容。
第十七部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>新增：</p>		

		<p>.....</p> <p>26、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；</p>	第 26 条	补充临时报告的内容。
--	--	--	--------	------------

附件2：《〈长盛量化红利策略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	<p>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〉》、《长盛量化红利策略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。</p>	<p>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〉》、《长盛量化红利策略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。</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）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>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：</p> <p>（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：</p> <p>股票类资产占基金资产的比例为60%—95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的80%。债券类资产占基金资产的比例为0%—40%，权证投资占基金资产净值的比例为0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>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：</p> <p>（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：</p> <p>股票类资产占基金资产的比例为60%—95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的80%。债券类资产占基金资产的比例为0%—40%，权证投资占基金资产净值的比例为0%—3%，现金或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。</p>	第18条	明确现金类资产范围。

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>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：</p> <p>(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： e、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 5%，</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>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：</p> <p>(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： e、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 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>新增： k、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%；</p> <p>1、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；</p> <p>m、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；</p>	<p>第 18 条</p> <p>第 15 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>.....</p> <p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>.....</p> <p>除上述第 e、l、m 项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>		
--	---	--	--	--