

长盛基金管理有限公司

关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同等法律文件的公告

长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理、包商银行股份有限公司(以下简称“包商银行”)托管的长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年8月24日经中国证监会证监许可〔2015〕1989号文注册募集。《长盛盛世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》”)于2015年12月11日生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《北京市第一中级人民法院民事裁定书》(2020)京01破270号之一及中国证监会指定,为保证本基金的正常运作,自包商银行被依法宣告破产之日起,中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)担任本基金的临时基金托管人。

因此,本基金管理人对本基金《基金合同》进行相应修改,增加了临时基金托管人信息、侧袋机制等相关内容,具体修改见附件:《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改对照表》。

本基金修改后的《基金合同》《托管协议》自2021年2月19日起生效,修改后的《基金合同》《托管协议》全文在履行中国证监会相关程序后,于2021年2月19日在本公司网站(www.csfund.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)等规定网站披露。敬请投资者关注。

投资者欲了解本基金的详细情况,请认真阅读本基金《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要(更新)及相关公告,亦可登录本公司网站(www.csfund.com.cn)进行查询或拨打客服电话咨询:400-888-2666(免长途通话费用)。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件,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。本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对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2月19日

附件:《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改对照表》

页码	章节或位置	原《基金合同》条款	现《基金合同》条款	修改理由
1	第一部分 前言		增加: 一、中国建设银行股份有限公司为中国证监会指定的本基金临时基金托管人,后续有待基金份额持有人大会审议选聘新任基金托管人,如基金份额持有人大会未能在6个月内选聘出新任基金托管人,临时基金托管人将配合基金清算工作。	根据变更临时基金托管人修订
3	第二部分 释义	3、基金托管人:指包商银行股份有限公司	修改后为: 3、临时基金托管人:指中国建设银行股份有限公司。以下简称基金托管人或托管人。	根据变更临时基金托管人修订
7	第二部分 释义		增加: 59、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 60、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	增加侧袋机制相关释义。
20	第六部分 基金份额的申购与赎回		增加: 十八、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。	补充增加侧袋机制约定。
24	第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 (一)基金托管人简况 名称:包商银行股份有限公司 注册地址:包头市青山区钢铁大街6号 办公地址:深圳市福田区金田路3038号现代国际大厦2805 法定代表人:周学东 成立时间:1998年12月16日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2007]284号 组织形式:股份有限公司 注册资本:473084.9089万元人民币 存续期间:永续经营 基金托管资格批准文号:证监许可[2014]205号	修改后为: 二、基金托管人 (一)基金托管人简况 名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行) 住所:北京市西城区金融大街25号 办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 邮政编码:100033 法定代表人:田国立 成立日期:2004年09月17日 基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]12号 组织形式:股份有限公司 注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营	调整托管人信息。

35	第八部分 基金份额持有人大会 八、生效与公告后		<p>增加： 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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表决意见或授权他人代表出具表决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。 <p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</p>	增加 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定。
49	第十二部分 基金的投资		<p>增加： 八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	补充增加侧袋机制相关约定。
51	第十四部分 基金资产估值 二、估值对象	基金所拥有的股票、衍生工具、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	<p>修改后为： 基金所拥有的股票、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	根据本基金的 投资范围完善文字表述。
51	第十四部分 基金资产估值 三、估值原则	对于存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确定计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。	<p>修改后为： 基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。</p> <p>(一) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。</p> <p>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</p> <p>(二) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。</p> <p>(三) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。</p>	完善估值原则。

<p>52-54</p>	<p>第十四部分 基金资产估值 四、估值 方法</p>	<p>1、证券交易所上市交易的有价证券的估值 (1)交易所上市交易的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值; (2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种,采用估值技术确定公允价值; (3)交易所上市交易或挂牌转让的资产支持证券和中小企业私募债,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值; (4)交易所上市交易的可转换债券,按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: (1)送股、转增股、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值; (2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值; (3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值,非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。 5、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。 6、如有充足理由认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。 7、存在相关法律法规以及监管部门有相关规范且适用于本基金的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。 根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对外公布的基金净值的计算结果对外予以公布。</p>	<p>修改后为: 1、证券交易所上市交易的有价证券的估值 (1)交易所上市交易的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。 (2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。 (3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。 (4)交易所上市交易的可转换债券,选取每日收盘价作为估值全价; (5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值。 (6)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: (1)送股、转增股、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值; (2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值; (3)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。 4、本基金投资同业存单,按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值;选定的第三方估值机构未提供估值价格的,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。 6、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。 7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。 8、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。 9、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。 11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。 根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,以基金管理人对外公布的基金净值的计算结果为准。</p>	<p>补充 完善估值 方法。</p>
--------------	---	---	--	----------------------------

56	第十四部分基金资产估值七、暂停估值的情形第5、	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;	修改后为: 5、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;	根据侧袋指引的规定完善相关表述。
56	第十四部分基金资产估值九、特殊情况的处理	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。	修改后为: 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第10项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。	调整对应序号。
57	第十四部分基金资产估值		增加粗体内容: 十、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净值信息,暂停披露侧袋账户份额净值。	补充侧袋机制约定。
58-59	第十五部分基金费用与税收二、基金费用计提方法和支付方式的第“1”、“2”、“3”项	基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送管理费划款指令,由基金托管人在复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。 基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。 基金销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。	修改后为: 基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。 基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。 基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。	根据与基金托管人的约定,调整基金相关费用的计提、支付方式规定,与实际操作实践保持一致。
60	第十五部分基金费用与税收四、基金税收		增加: 四、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。	补充增加侧袋机制约定。
62	第十六部分基金的收益与分配		增加粗: 七、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。	补充增加侧袋机制约定。
69	第十八部分基金的信息披露		增加: (十四)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。	补充增加侧袋机制相关约定。