

长信基金管理有限责任公司 关于旗下40只公募基金增加侧袋 机制并相应修改法律文件的公告

根据《中华人民共和国证券法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》及基金合同和托管协议的有关规定,经与基金托管人协商一致并报监管备案,长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)决定对旗下40只基金的基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要进行修订。现将相关事宜公告如下:

一、修订基金范围

本次修订所涉基金见下表:

序号	基金名称
1	长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金
2	长信乐信灵活配置混合型证券投资基金
3	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金
4	长信量化先锋混合型证券投资基金
5	长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金
6	长信多利灵活配置混合型证券投资基金
7	长信量化中小盘股票型证券投资基金
8	长信先锐混合型证券投资基金
9	长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
10	长信利广灵活配置混合型证券投资基金
11	长信睿进灵活配置混合型证券投资基金
12	长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)
13	长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
14	长信合利混合型证券投资基金
15	长信消费精选行业量化股票型证券投资基金
16	长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
17	长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金
18	长信创新驱动股票型证券投资基金
19	长信新利灵活配置混合型证券投资基金
20	长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金
21	长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金
22	长信中证500指数增强型证券投资基金
23	长信医疗大健康行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
24	长信恒利优势混合型证券投资基金
25	长信稳健精选混合型证券投资基金
26	长信先利半年定期开放混合型证券投资基金
27	长信沪深300指数增强型证券投资基金
28	长信利信灵活配置混合型证券投资基金
29	长信稳进资产配置混合型基金中基金(FOF)
30	长信量化价值驱动混合型证券投资基金

31	长信科融双活配置混合型证券投资基金
32	长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型证券投资基金(QDII)
33	长信易进混合型证券投资基金
34	长信创新驱动双活配置混合型证券投资基金
35	长信瑞利纯债债券型证券投资基金
36	长信价值优选混合型证券投资基金
37	长信稳健双活配置混合型证券投资基金
38	长信双利优选混合型证券投资基金
39	长信内需成长混合型证券投资基金
40	长信稳利纯债混合型证券投资基金

二、主要修订内容
本次基金合同的修订主要为增加侧袋机制相关表述,内容包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金合同当事人及权利义务、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配、基金的信息披露等条款,并同步修改托管协议、基金招募说明书(更新)、产品资料概要中相关涉及内容。上述对基金合同、基金招募说明书(更新)的修订对照详见附件。

修订的内容自2021年7月1日起实施。投资者可在基金管理人网站上查阅修订后各基金的基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要。

- 三、其他事项
1. 投资者可通过以下途径咨询有关详情
客户服务专线4007005566(免长话费)
网址:www.cxfund.com.cn
 2. 风险提示:基金管理人承诺以诚实信用、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。基金有风险,投资需谨慎。销售机构根据法律法规要求对投资者类别、风险承受能力及基金的风险等级进行划分,并提出适当的匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的情况和风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。

长信基金管理有限责任公司
2021年6月29日

附件:修订对照表
1. 基金合同关于侧袋机制相关内容的修订对照表,以长信企业精选两年定期开放双活配置混合型证券投资基金为例

章节	原文条款	修改后条款
第一部分 前言	无	八、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,具体见基金合同和招募说明书相关规定。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,并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。
第二部分 释义	无	58. 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,目的在于有效降低并化解风险,确保持续投资者的公平对待,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。 59. 特定资产:包括:(1)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;(2)按摊余成本计量且计提减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产;(3)其他资产价值存在重大不确定性的资产。
第七部分 基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 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。 七、拒绝或暂停赎回的情形 …… 7. 当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上且与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 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。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 8. 当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上且与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。
第七部分 基金份额的申购与赎回	七、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 8. 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。	七、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 8. 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。
第八部分 基金合同当事人及权利义务	三、基金份额持有人 …… 每份基金份额具有同等的合法权益。	三、基金份额持有人 …… 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,每份基金份额具有同等的合法权益。
第九部分 基金份额持有人大会	九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特别约定 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持有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或侧袋份额持有人持有的基金份额或表决权不符合该等比例,则相关基金份额持有人和侧袋份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 九、基金份额持有人大会的特别约定 1. 基金份额持有人大会的召集事由涉及侧袋账户资产的事项,须经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过。 2. 基金份额持有人大会的召集事由涉及侧袋账户资产的事项,须经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过。 3. 基金份额持有人大会的召集事由涉及侧袋账户资产的事项,须经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过。 4. 当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有代表基金份额的二分之一以上基金份额持有人参加并有权投票。 5. 基金份额持有人大会的召集事由涉及侧袋账户资产的事项,须经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过。 6. 基金份额持有人大会的召集事由涉及侧袋账户资产的事项,须经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过。 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。 八、侧袋机制的适用范围 当本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,并经会计师事务所审计后,可以依据法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无侧袋账户的基金份额持有人持有基金份额享有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的,侧袋账户份额无表决权。 侧袋机制实施期间,关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准,本节没有规定的适用本部分的相关规定。	
第十三部分 基金的投资	无	八、侧袋机制的适用范围 当本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,并经会计师事务所审计后,可以依据法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无侧袋账户的基金份额持有人持有基金份额享有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的,侧袋账户份额无表决权。 侧袋机制实施期间,关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准,本节没有规定的适用本部分的相关规定。
第十五部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… 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基金估值。	六、暂停估值的情形 …… 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基金估值。
第十六部分 基金费用与税收	无	八、实施侧袋机制期间的基金费用 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,暂停披露侧袋账户的基金净值信息。
第十七部分 基金的收益与分配	无	五、实施侧袋机制期间的基金费用 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,暂停披露侧袋账户的基金净值信息。
第十九部分 基金的信息披露	七、公开披露的基金信息 …… 十八、中国证监会规定的其他信息	七、公开披露的基金信息 …… 十八、中国证监会规定的其他信息

2. 基金招募说明书(更新)关于侧袋机制相关内容的修订对照表,以长信企业精选两年定期开放双活配置混合型证券投资基金为例

章节	原文条款	修改后条款
重要提示	无	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,具体见基金合同和招募说明书相关规定。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,并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。
二、释义	无	58. 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,目的在于有效降低并化解风险,确保持续投资者的公平对待,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。 59. 特定资产:包括:(1)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;(2)按摊余成本计量且计提减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产;(3)其他资产价值存在重大不确定性的资产。

	八、拒绝或暂停申购的情形 …… 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。	八、拒绝或暂停申购的情形 …… 7. 当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上且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。
九、基金份额的申购与赎回	(六) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 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赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。	(六) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 5. 当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上且与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。
	无	十八 实施侧袋机制期间的基金份额的申购与赎回 本基金实施侧袋机制的, 本基金申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。
十、基金的投资	无	八、侧袋机制的实施和运作安排 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。无需召开基金份额持有人大会。 侧袋机制实施期间, 本基金约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险等级限制等约定适用于主袋账户。 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本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。
十二、基金资产估值	(六) 暂停估值的情形 …… 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基金估值。	(六) 暂停估值的情形 …… 3. 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。
	无	八、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, 暂停披露侧袋账户的基金净值信息。
十五、基金费用与税收	无	侧袋机制实施期间的基金费用 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, 其费用与侧袋机制无关, 且不收取管理费, 其他费用详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。
十六、基金的收益与分配	无	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, 详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。
十八、基金的信息披露	(五) 公开披露的基金信息 …… 18、中国证监会规定的其他信息	(五) 公开披露的基金信息 …… 18. 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, 详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。 19. 中国证监会规定的其他信息
十九、侧袋机制	无	十九、侧袋机制 (一) 侧袋机制的实施条件、实施程序 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。无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制后及时中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。 特定资产包括: (1) 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; (2) 停牌期间公允价值难以确定的资产; (3) 其他资产公允价值存在重大不确定性的资产。 (二) 侧袋机制实施期间的基金运作安排 1. 侧袋账户的申购与赎回 ① 申购 侧袋机制实施期间, 基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人不得申购, 赎回或转换侧袋账户基金份额, 该申购、赎回或转换申请将被拒绝。 ② 申购限制 基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利, 并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项, 具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。 ③ 申购限制 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基金估值, 并暂停接受基金申购和赎回申请或延缓支付赎回款项。 对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请, 基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请, 视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。 2. 侧袋账户的设立 侧袋机制实施期间, 基金管理人应对侧袋账户实行独立管理, 主袋账户运作期间, 侧袋账户不得使用独立基金代码, 侧袋账户的名称为“基金名称+侧袋标识”, 侧袋账户建立日期格式设定, 同时主袋账户的名称增加大写字符M标识作为后缀。基金所有侧袋账户注册后, 将取主袋账户的名称中的M标识。 启用侧袋机制当日, 基金管理人应终止侧袋账户以基金份额持有人的原有账户的资产, 确认侧袋账户持有人名册和份额。 侧袋账户资产完全清算后, 基金管理人将注销侧袋账户。 3. 基金的开放安排 侧袋机制实施期间, 本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。 基金管理人、相关服务机构在基金业绩展示时, 应当就前述情况进行充分的解释说明, 禁止引起投资者误解。 基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个工作日内完成对主袋账户投资组合的调整, 但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。 4. 基金的估值 侧袋机制启用当日, 基金管理人以完成当日估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割, 并将侧袋资产单独对应的主袋账户份额予以除息交收外的负债类科目余额一并转入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体, 不依据公允价值方法进行估值核算。 侧袋机制实施期间, 基金管理人应对侧袋账户单独设置账套, 实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户, 不同侧袋账户分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。 5. 基金的费用 侧袋机制实施期间, 侧袋账户资产不收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。 基金管理人可以计提侧袋账户资产变现后将与处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户中列支。 6. 基金的收益分配 侧袋机制实施期间, 在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下, 基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。 7. 基金的信息披露 ① 基金净值信息 侧袋机制实施期间, 基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。 ② 定期报告 侧袋机制实施期间, 基金定期报告中的基金会计报表仅针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露, 包括但不限于: 1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息; 2) 侧袋账户的期初资产、期初负债; 3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息; 4) 报告期的特定资产处置进展情况, 与处置特定资产相关的费用情况及其他可能对投资者利益存在重大影响的事项及风险提示。 5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间, 该净值或净值参考区间不代表对资产最终变现价格的承诺, 不作为基金管理人对于特定资产最终变现价格的承诺。 6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。 ③ 临时报告 基金管理人应当在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益存在重大影响的事项后及时发布临时公告。 启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、投资运作指标的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间, 若侧袋账户资产无法变现或处置变现, 基金管理人应当在每次处置变现后及时发布临时公告。 ④ 侧袋账户运作报告 基金管理人按照基金份额持有人利益最大化原则制定变现方案, 将侧袋资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现, 基金管理人应当及时向侧袋账户份额持有人提交变现报告并披露。 9. 侧袋机制的审计 基金管理人应当在启用侧袋机制时, 聘请会计师事务所, 及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见, 具体如下: 基金管理人应当在启用侧袋机制时, 就特定资产认定的相关事项与会计师事务所达成一致意见, 会计师事务所应出具专项审计意见。 基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内, 聘请会计师事务所对启用侧袋机制的会计处理事项进行专项审计并披露专项审计意见。会计师事务所出具的专项审计意见, 应包括侧袋账户的期初资产、份额、净值等信息。 会计师事务所应当对侧袋机制实施期间, 基金管理人是否按照基金合同约定披露侧袋机制运行相关的材料进行核查, 并出具专项审计报告。 当侧袋账户资产全部完成变现后, 基金管理人应当根据基金清算报告的相关要求, 聘请会计师事务所出具侧袋账户清算报告并披露。 (三) 本基金关于侧袋机制的相关规定, 凡是引用法律法规或基金合同的, 如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的, 基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后, 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 可对本部分内容进行修订和调整, 无需召开基金份额持有人大会审议。
二十、风险揭示	C: 投资组合的风险 …… 3. 流动性风险 …… ④ 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响	C: 投资组合的风险 …… 3. 流动性风险 …… ④ 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响 4 本基金侧袋机制 具体描述详见招募说明书“侧袋机制”章节的相关内容。当本基金启用侧袋机制时, 本基金侧袋机制期间, 侧袋账户的资产净值、基金份额净值、基金份额净值、赎回和转换, 因特定资产的变现时间和不确定性, 最终变现价格也具有不确定性且有可能低于启用侧袋机制前的特定资产的估值, 基金份额持有人可能因此面临损失。

注: 以上更新修订内容仅为示例, 不同基金的基金合同及招募说明书中相应条款表述及修订位置存在差异, 具体请以相关基金披露的修订后法律文件内容为准。