

## 关于修改长城货币市场证券投资基金基金合同和托管协议的公告

为更好地保护投资者利益，长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第120号）、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》的规定和《长城货币市场证券投资基金基金合同》的有关约定，经与基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定修改本公司旗下长城货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同和托管协议，修改后的本基金基金合同和托管协议自本公告发布之日起生效，修改的具体内容详见本公告附件“长城货币市场证券投资基金基金合同修改前后文对照表”与“长城货币市场证券投资基金托管协议修改前后文对照表”。

重要提示：

- 1、本基金本次修改基金合同，系遵照法律法规和中国证监会的相关规定进行修改，根据本基金基金合同的规定，因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改的，可不经基金份额持有人大会表决。
- 2、本公司将于本公告发布日在本公司网站上同时披露修改后的本基金基金合同和托管协议。
- 3、本基金的招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

本公司客户服务电话：400-8868-666

本公司网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)

特此公告

长城基金管理有限公司

2016年10月14日

附件：

- 1、长城货币市场证券投资基金基金合同修改前后文对照表
- 2、长城货币市场证券投资基金托管协议修改前后文对照表

附件1：长城货币市场证券投资基金基金合同修改前后文对照表

修改章节 原内容 修改后内容 修改理由

第一部分

前言和释义

前言

为保护基金投资者合法权益，明确《长城货币市场基金基金合同》（以下简称“本合同”、或《基金合同》）当事人的权利与义务，规范长城货币市场基金运作，依照《中华人民

《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》）、《货币市场基金管理暂行规定》（以下简称《货币基金暂行规定》）及其他有关规定，在自愿、公平、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《基金合同》。

#### 前言

为保护基金投资者合法权益，明确《长城货币市场基金基金合同》（以下简称“本合同”、或《基金合同》）当事人的权利与义务，规范长城货币市场基金运作，依照《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》）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》及其他有关规定，在自愿、公平、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《基金合同》。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》添加。

#### 第一部分 前言和释义 增加：

##### 前言

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金管理人保证恪尽职守，并按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》添加。

#### 第一部分 前言和释义 释义

《运作办法》：指《证券投资基金运作管理办法》 释义

《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》 根据 2014 年 8 月 8 日实施《公开募集证券投资基金运作管理办法》修改。

#### 第一部分 前言和释义 释义

《货币基金暂行规定》：指《货币市场基金管理暂行规定》 释义

《管理办法》：指《货币市场基金监督管理办法》 根据最新的《货币市场基金监督管理办法》补充释义修改。

#### 第一部分 前言和释义 释义

摊余成本法：指计价对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。 释义

摊余成本法：指计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

第一部分 前言和释义 增加：

释义

影子定价：为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”根据《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》明确影子定价具体释义

第二部分 长城货币市场基金基本情况

四、基金的投资范围

本基金的投资标的物包括但不限于以下金融工具：剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、金融债和 AAA 企业债等债券，期限在一年以内（含一年）的债券回购、中央银行票据和银行存款（含现金、银行定期存款、大额存单等）以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

四、基金的投资范围

本基金的投资标的物包括但不限于以下金融工具：现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

第三部分 《基金合同》当事人及权利义务 一、 基金管理人

（一）基金管理人简况

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

邮政编码：518031

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字 [2001] 55 号

组织形式：有限责任公司

实收资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营 一、 基金管理人

（二）基金管理人简况

名称：长城基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

邮政编码：518026

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字〔2001〕55 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营 根据管理人信息变更而更新。

第三部分 《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：华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

成立时间：1992 年 10 月 14 日

批准设立机关和设立文号：中国人民银行〔银复（1992）391 号〕

注册资本：8,904,643,509 元人民币

存续期间：持续经营 二、基金托管人

（一）基金托管人简况

名称：华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

成立时间：1992 年 10 月 14 日

批准设立机关和设立文号：中国人民银行〔银复（1992）391 号〕

注册资本：10,685,572,211 元人民币

存续期间：持续经营 根据托管人信息变更而更新。

第三部分 《基金合同》当事人及权利义务 三、基金份额持有人

1. 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（3）依法申请赎回其持有的基金份额； 三、基金份额持有人

1. 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额； 根据《基金法》第 46 条的表述进行修改。

第四部分 基金份额持有人大会 增加：

本基金份额持有人大会不设日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。 根据《基金法》的要求添加

第四部分 基金份额持有人大会 一、召开事由

（一）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

8、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外； 一、召开事由

（一）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

8、调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外； 调整表述，强化基金份额持有人利益保护

第四部分 基金份额持有人大会 一、召开事由

（二）以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费、基金托管费；
- 2、在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 4、对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的意外的其他情形。

一、召开事由

（二）以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 2、因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 3、对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 4、除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的意外的其他情形。

调整表述，强化基金份额持有人利益保护

第四部分 基金份额持有人大会 二、会议召集人及召集方式

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集；

4、代表基金份额 10%以上（含 10%，该比例以提出提议之日提请人所持有的基金份额与基金总份额之比例计算，下同）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定

之日起六十日内召开；

## 二、会议召集人及召集方式

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、代表基金份额10%以上（含10%，该比例以提出提议之日提请人所持有的基金份额与基金总份额的比例计算，下同）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%（含10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合； 根据《运作办法》第43条修改。

## 第四部分 基金份额持有人大会 四、会议的召开方式

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权利登记日基金总份额的50%（含50%）。 四、会议的召开方式

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的50%，召集人可以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基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。 根据《基金法》第86条的规定补充基金份额持有人大会二次召集的相关内容。

## 第四部分 基金份额持有人大会 四、会议的召开方式

2、通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(2) 本人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利登记日基金总份额的 50%（含 50%）； 四、会议的召开方式  
2、通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(2) 本人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基金总份额的 50%（含 50%）；若到会者在权益登记日持有的有效的基金份额小于本基金在权益登记日基金总份额的 50%，召集人可以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基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见； 根据《基金法》第 86 条的规定补充基金份额持有人大会二次召集的相关内容。

#### 第四部分 基金份额持有人大会 六、表决

2. 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同以特别决议通过方为有效。

#### 六、表决

2. 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。 根据《基金法》第 86 条的规定，基金合并也应以特别决议通过。

#### 第四部分 基金份额持有人大会 八、生效与公告

基金份额持有人大会决议应当由会议召集人自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。 八、生效与公告

基金份额持有人大会决议应当由会议召集人自通过之日起五日内报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效。 根据《基金法》87 条，基金份额持有人大会决定的事项，已由报证监会“核准或者备案”修改为报证监会“备案”即可。

#### 第五部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 一、基金管理人和基金托管人的更换程序

##### （一）基金管理人的更换程序

4、核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准。

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后 2 日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。新任基金管理人与原基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人中国证监会批准后 2 日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告；基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收； 一、基金管

理人和基金托管人的更换程序

(一) 基金管理人的更换程序

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案。

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。新任基金管理人与原基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告；基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收；根据《基金法》第87条的规定，基金份额持有人大会决议报证监会备案即可，且根据《运作办法》第48条修改，基金份额持有人大会决议自表决通过即生效。

第五部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 一、基金管理人和基金托管人的更换程序

(二) 基金托管人的更换程序

4、核准：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须经中国证监会核准。

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和银行监管机构核准后2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金经理人和新任的基金托管人在中国证监会和银行监管机构批准后2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告； 一、基金管理人和基金托管人的更换程序

(二) 基金托管人的更换程序

4、备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须经中国证监会备案。

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金经理人和新任的基金托管人在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告；根据《基金法》第87条的规定，基金份额持有人大会决议报证监会备案即可，且根据《运作办法》第48条修改，基金份额持有人大会决议自表决通过即生效。

第七部分 基金合同的备案 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金合同生效后的存续期内，有效基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金合同生效后的存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或



者低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定的，从其规定。根据《运作办法》第 41 条修改。

#### 第八部分 基金的申购与赎回 五、申购与赎回的数额限制

增加：

4、基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定，在特定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购，具体以基金管理人的公告为准。

根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》添加。

#### 第八部分 基金的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用

1、本基金不收取申购费用；

2、本基金不收取赎回费用；

#### 六、申购费用和赎回费用

1、本基金不收取申购费用；

2、本基金一般情况下不收取赎回费用，但当基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%以上的赎回申请（超过基金总份额 1%以上的部分）征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

#### 第八部分 基金的申购与赎回 七、申购份额与赎回金额的计算

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。

本基金的基金份额净值保持为人民币 1.00 元。

#### 1、 申购份额的计算

申购份额=申购金额/基金份额净值

#### 2、 赎回金额的计算

赎回金额=赎回份额×基金份额净值

3、本基金每个工作日公告前一工作日基金日收益及前一个工作日（含节假日）基金七日收益率。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。七、申购份额与赎回金额的计算

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如

网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。

本基金的基金份额净值保持为人民币 1.00 元。

申购份额、赎回金额的计算详见招募说明书。

本基金每个工作日公告前一工作日基金日收益及前一个工作日（含节假日）基金七日收益率。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

第八部分 基金的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式 九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

增加：

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

（4）当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值 0.5%时。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》添加。

第八部分 基金的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。 九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

发生上述（1）到（6）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。 因上文内容增加而增加

第八部分 基金的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

增加：

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：

（5）为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 10%的，基金管理人可以采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。

（6）当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人决定履行适当程序终止基金合同的。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》添加。

第八部分 基金的申购与赎回 增加：

十九、基金份额转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。根据《运作办法》第 29 条的规定的相应内容为

日后开放份额转让预留空间。

#### 第十一部分 基金注册登记业务 四、注册登记机构的义务

3、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上； 四、注册登记机构的义务

3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至国务院证券监督管理机构认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于二十年； 根据《基金法》的要求修改。

#### 第十二部分 基金的投资 二、投资范围

本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限的债券、央行票据、回购，以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括：现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

根据当前市场的实际情况

以及相关法律法规的规定，长城货币市场基金的组合配置比例范围为：央行票据：0—80%，回购 0—70%，短期债券 0—80%，同业存款/现金比例 0—70%。 二、投资范围

本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限的债券、央行票据、回购，以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括：现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

根据当前市场的实际情况以及相关法律法规的规定，长城货币市场基金的组合配置比例范围为：央行票据：0—80%，回购 0—70%，短期债券 0—80%，同业存款/现金比例 0—70%。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

#### 第十二部分 基金的投资 七、禁止行为

（一）本基金不得投资以下金融工具：

- 1、股票；
- 2、可转换债券；
- 3、剩余期限超过 397 天的债券；
- 4、信用等级在 AAA 级以下的企业债券；
- 5、以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；
- 6、中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

#### 七、禁止行为

（一）本基金不得投资以下金融工具：

- 1、股票；

- 2、可转换债券、可交换债券；
- 3、信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具；
- 4、以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；
- 5、中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级，如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的，应采用孰低原则确定其评级，并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

## 第十二部分 基金的投资 七、禁止行为

### （三）本基金投资组合遵循如下的投资限制

- 1、货币市场基金投资组合的平均剩余期限，在每个交易日均不得超过 180 天；
- 2、投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- 3、存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；
- 4、除发生巨额赎回的情形外，货币市场基金的投资组合中，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整；
- 5、货币市场基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；
- 6、买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；
- 7、中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

## 七、禁止行为

### （三）本基金投资组合遵循如下的投资限制

- （1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；
- （2）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- （3）同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；
- （4）除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30% 以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%；
- （5）本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；

(6) 本基金投资于固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，但如果基金投资有存款期限，但协议中约定可以提前支取的银行存款，不受该比例限制；

(7) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

(8) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；

(9) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%

(10) 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 10%；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%；本基金管理人管理的全部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 10%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金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；

(11) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

由于市场波动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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金已经持有的流动性资产比例不符合上述第(8)、(9)项规定的，应在新修订的《管理办法》施行之日起六个月内调整；本基金已经持有的金融工具及比例不符合新修订的《管理办法》规定的，应在新修订的《管理办法》施行之日起一年内调整；对于货币市场基金新投资的金融工具及比例，应自新修订的《管理办法》施行之日起即应符合要求。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》添加。

## 第十二部分 基金的投资 八、基金投资组合平均剩余期限的计算方法

本基金投资组合平均剩余期限的计算公式为：

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金）、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、期限在一年以内（含一年）的逆回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内（含一年）的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

## 八、基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法

本基金投资组合平均剩余期限的计算公式为：

本基金投资组合平均剩余存续期限的计算公式为：

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金）、一年以内（含一年）的银行存款、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、期限在一年以内（含一年）的逆回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内（含一年）的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

（1）银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至成交日的剩余交易日天数计算；

（2）回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

（3）银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

（4）中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

（5）组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

（6）对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限和剩余存续期限。

平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限和剩余存续期限计算方法另有规定的从其规定。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改和添加。

第十四部分 基金资产估值 三、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

5、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值计算的基金资产净值发生重大偏离，消除或减少因基金份额净值的背离导致基金份额持有人权益的稀释或其他不公平的结果，基金管理人于每一估值日计算货币市场基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。当基金资产净值与按其他可参考公允价值计算的基金资产净值的偏离达到或超过基金资产净值的0.50%时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

### 三、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按照实际利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

5、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值计算的基金资产净值发生重大偏离，消除或减少因基金份额净值的背离导致基金份额持有人权益的稀释或其他不公平的结果，基金管理人于每一估值日计算货币市场基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值负偏离达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内，当正偏离绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者履行适当程序后采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

### 第十八部分 基金的信息披露 二、基金运作信息披露

9、（11）涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼； 二、基金运作信息披露

9、（11）涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；

增加：

（26）当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%或正负偏离度绝对值达到0.5%时的情形； 根据最新的《货币市场

基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改和添加。

附件 2：长城货币市场证券投资基金托管协议修改前后文对照表

修改章节 原内容 修改后内容 修改理由

一、托管协议当事人 （二）基金托管人

名称：华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：010-85238982

传真：010-85238680

联系人：徐昊光

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：8,904,643,509 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；保险兼业代理业务；租赁业务以及经中国银行业监督管理委员会(以下简称“中国银监会”)批准的其他业务。 （二）基金托管人

名称：华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：010-85238982

传真：010-85238680

联系人：徐昊光

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司



注册资本：10,685,572,211 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；保险兼业代理业务；租赁业务以及经中国银行业监督管理委员会(以下简称“中国银监会”)批准的其他业务。 根据托管人信息变更而更新

二、订立托管协议的依据、目的和原则 本协议依据《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》）、《货币市场基金管理暂行规定》（简称《暂行规定》）、《长城货币市场基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制订。

本协议的目的是明确长城货币市场基金基金托管人和基金管理人之间在基金份额持有人名册的登记与保管、基金资产的保管、基金资产的管理和运作、基金的申购、赎回及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，以确保基金资产的安全，保护基金持有人的合法权益。

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

本协议依据《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》）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《长城货币市场基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制订。

本协议的目的是明确长城货币市场基金基金托管人和基金管理人之间在基金份额持有人名册的登记与保管、基金资产的保管、基金资产的管理和运作、基金的申购、赎回及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，以确保基金资产的安全，保护基金持有人的合法权益。

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改。

七、资产净值计算和会计核算 （一）基金资产净值、基金日收益、基金七日收益率的计算和复核

本基金按以下方式进行估值：

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入

时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

5、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值计算的基金资产净值发生重大偏离，消除或减少因基金份额净值的背离导致基金份额持有人权益的稀释或其他不公平的结果，基金管理人于每一估值日计算货币市场基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。当基金资产净值与按其他可参考公允价值计算的基金资产净值的偏离达到或超过基金资产净值的 0.50%时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。（一）基金资产净值、基金日收益、基金七日收益率的计算和复核

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、本基金估值采用摊余成

本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

5、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值计算的基金资产净值发生重大偏离，消除或减少因基金份额净值的背离导致基金份额持有人权益的稀释或其他不公平的结果，基金管理人于每一估值日计算货币市场基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值负偏离达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内，当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者履行适当程序后采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。根据最新的《货币市场基金监督管理办法》及《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》修改和添加。

### 十三、基金托管人和基金管理人的更换（一）基金托管人的更换

#### 2、更换基金托管人的程序

（3）核准：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须经中国证监会核准。

（4）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和银行监管机构核准后 2 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。（一）基金托管人的更换

#### 2、更换基金托管人的程序

(3) 备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须经中国证监会备案。

(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。根据《基金法》第87条的规定，基金份额持有人大会决议报证监会备案即可，且根据《运作办法》第48条修改，基金份额持有人大会决议自表决通过即生效。

十三、基金托管人和基金管理人的更换 (二) 基金管理人的更换

2、更换基金管理人的程序

(3) 核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准。

(4) 公告：基金管理人换后，由基金托管人在中国证监会和银行监管机构核准后2个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。 (二) 基金管理人的更换

2、更换基金管理人的程序

(3) 备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案。

(4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。根据《基金法》第87条的规定，基金份额持有人大会决议报证监会备案即可，且根据《运作办法》第48条修改，基金份额持有人大会决议自表决通过即生效。

十五、 禁止行为 1、《基金法》第二十条禁止的任一行为。 1、《基金法》第二十一条禁止的任一行为。根据《基金法》最新修订情况调整。

十九、托管协议的修改和终止 1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的核准或备案手续后生效。 1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议向中国证监会办理备案手续。根据《基金法》修改。