

# 关于修改长盛添利宝货币市场基金基金合同和托管协议的 公告

长盛添利宝货币市场基金（A类份额基金代码：000424，B类份额基金代码：000425，以下简称本基金）于2013年12月9日正式成立。根据2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）及2015年12月17日颁布、2016年2月1日起实施的《货币市场基金监督管理办法》（以下简称《管理办法》）和《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》等法律法规，长盛基金管理有限公司（以下简称基金管理人）本着基金份额持有人利益优先原则，拟按照《运作办法》、《管理办法》等相关法律法规的规定修改《长盛添利宝货币市场基金基金合同》相关内容。本次基金合同修订主要因相关法律法规发生变动而进行调整，其他修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，不需要召开基金份额持有人大会。基金管理人已就修订内容与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案。

现将《长盛添利宝货币市场基金基金合同》和《长盛添利宝货币市场基金托管协议》相关修改内容说明如下，《长盛添利宝货币市场基金招募说明书》将在招募说明书更新时一并修订相关内容并公告。

## 一、《长盛添利宝货币市场基金基金合同》修改内容

### （一）第一部分前言相关修改内容如下：

#### 1、一、订立本基金合同的目的、依据和原则第二段

原文为：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》）、《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》）、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（以下简称《通知》）、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》（以下简称《信息披露特别规定》）、《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〉》和其他有关法律法规。

修改为：

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》）、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》（以下简称《信息披露特别规定》）、《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〉》和其他有关法律法规。

2、补充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。

### （二）第二部分释义相关修改内容如下：

#### 1、9、《基金法》

原文为：《基金法》：指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布

机关对其不时做出的修订。

修改为：《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法等七部法律的决定〉修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。

## 2、12、《运作办法》

原文为：《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施并于 2012 年 6 月 19 日修订的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

修改为：《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

## 3、46、摊余成本法

原文为：摊余成本法：指估值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，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

修改为：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。

（三）第五部分基金备案相关修改内容如下：

### 1、三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

原文为：《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

修改为：《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 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。

（四）第六部分基金份额的申购与赎回相关修改内容如下：

1、五、申购和赎回的数量限制中补充 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。并调整后续序号。

### 2、六、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）原文为：1.本基金不收取申购费用和赎回费用。

修改为：1.除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。

（2）补充：

### 5、强制赎回费

在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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，基金管理人应当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 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。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。

### 3、七、拒绝或暂停申购的情形

（1）补充 6、当影子定价法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

离度绝对值达到 0.5%时。并相应调整后续序号。

(2) 原文为：发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，。

修改为：发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形时，。

#### 4、八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

(1) 原文为：5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

修改为：5、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

(2) 补充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。

(五) 第七部分基金合同当事人及权利义务相关修改内容如下：

#### 1、一、基金管理人中（一）基金管理人简况

原文为：

法定代表人：凤良志

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整。

修改为：

法定代表人：周兵

注册资本：人民币壹亿捌仟玖佰万元整。

(六) 第八部分基金份额持有人大会相关修改内容如下：

#### 1、八、生效与公告

原文为：基金份额持有人大会的决议自中国证监会完成备案手续之日起生效。

修改为：基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

(七) 第九部分基金管理人、基金托管人的更换条件和程序相关修改内容如下：

#### 1、二、基金管理人和基金托管人的更换程序中（一）基金管理人的更换程序

(1) 原文为：4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案后方可执行；

修改为：4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；

(2) 原文为：5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在完成备案手续后 2 个工作日内在指定媒体公告。

修改为：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 个工作日内在指定媒体公告。

#### 2、二、基金管理人和基金托管人的更换程序中（二）基金托管人的更换程序

(1) 原文为：4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案后方可执行。

修改为：4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；

(2) 原文为：5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在完成备案手续后 2 个工作日内在指定媒体公告。

修改为：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 个工作日内在指定媒体公告。

#### 3、二、基金管理人和基金托管人的更换程序中（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序

原文为：3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应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报中国证监会备案后 2 个工作日内在指定媒体上联合公告。

修改为：3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应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 个工作日内在指定媒体上联合公告。

(八) 第十一部分基金份额的登记相关修改内容如下:

#### 1、四、基金登记机构的义务

原文为: 3、保存基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上;

修改为: 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中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年;

(九) 第十二部分基金的投资相关修改内容如下:

#### 1、二、投资范围

原文为: 本基金投资于法律法规允许的金融工具包括: 现金; 通知存款; 短期融资券; 一年以内(含一年)的银行定期存款、银行协议存款和大额存单; 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券和中期票据; 期限在一年以内(含一年)的债券回购和中央银行票据; 以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他货币市场工具。

修改为: 本基金投资于法律法规允许的金融工具包括: 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(含银行间市场债券和交易所债券)、非金融企业债务融资工具、资产支持证券; 以及法律法规或中国证监会、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。

#### 2、五、投资限制中 1、组合限制

原文为:

本基金不得投资于以下金融工具:

- (1) 股票、权证及股指期货;
- (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, 但市场条件发生变化后另有规定的, 从其规定;
- (6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券;
- (7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制的, 本基金将不受上述限制。

修改为:

- (1) 股票、权证及股指期货;
- (2) 可转换债券、可交换债券;
- (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) 信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具;
- (7) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券;
- (8) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制的, 本基金将不受上述限制。

#### 3、五、投资限制中 3、基金投资组合比例限制

原文为:

- (1) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- (2) 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 个工作日内进行调整;
- (3) 本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格

以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；

(4) 本基金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%；

(5) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

(6) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；

(7) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整；

(8) 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，不得超过基金资产净值的 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%；本基金持有的同一（指同一信用级）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或相当于 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；

(9) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

3) 本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持。

(10) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整或取消禁止行为和投资限制规定，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述（2）、（8）和（9）外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

修改为：

(1) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(2) 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；

(3) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

(4) 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%;

(5) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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%;

(6) 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%;

(7) 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;

(8) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期不得超过 240 天;

(9) 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%;本基金持有的同一(指同一信用级)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%;

(10) 本基金应投资于信用级别评级为或相当于 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。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整或取消禁止行为和投资限制规定,不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述(4)、(7)、(10)外,因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

4、六、投资组合平均剩余期限计算方法修改为六、投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限计算方法。

(1) 补充 2、平均剩余存续期限(天)的计算公式如下:

(2) 原文为: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、或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。

修改为:投资于金融工具产生的资产包括现金、期限在一年以内(含一年)的一年以内(含一年)的银行存款、同业存单、逆回购、中央银行票据、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、买断式回购产生的待回购债券、或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。

(3) 原文为:

## 2、各类资产和负债剩余期限的确定

(1) 银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为 0 天;证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算;

(2) 一年以内(含一年)银行定期存款、大额存单的剩余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以存款协议中约定的通知期计算；

(3) 组合中债券的剩余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；允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售日的实际剩余天数计算；

(4) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。

(5) 中央银行票据的剩余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；

(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限；

(7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

(8) 短期融资券的剩余期限以计算日至短期融资券到期日所剩余的天数计算。

(9) 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。平均剩余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计算方法另有规定的从其规定。

修改为：

### 3、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

(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交收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。

(十) 第十四部分基金资产估值相关修改内容如下：

#### 1、三、估值方法

(1) 原文为：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，在剩余存续期内平均摊销，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。在有关法律法規允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。修改为：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。在有关法律法規允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

（2）原文为：2、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。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偏离达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，同时基金管理人应编制并披露临时报告。

修改为：2、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。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。

（十一）第十八部分基金的信息披露相关修改内容如下：

#### 1、五、公开披露的基金信息中（六）临时报告

原文为：17、以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偏离度绝对值达到或超过 0.5%；

修改为：17、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负偏离度绝对值达到 0.5%的情形；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连续 2 个交易日出现负偏离度绝对值超过 0.5%的情形；

（十二）第二十四部分基金合同内容摘要

根据上述基金合同的修改内容进行相应更新。

#### 二、《长盛添利宝货币市场基金托管协议》修改内容

（一）一、托管协议当事人相关修改内容如下：

##### 1、（一）基金管理人（或简称管理人）

原文为：

法定代表人:凤良志

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整。

修改为：

法定代表人:周兵

注册资本：人民币壹亿捌仟玖佰万元整。

（二）二、托管协议的依据、目的、原则和解释相关修改内容如下：

##### 1、（一）依据



原文为：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》）、《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《长盛添利宝货币市场基金基金合同》（以下简称《基金合同》）订立。

修改为：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《长盛添利宝货币市场基金基金合同》（以下简称《基金合同》）订立。

（三）三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查相关修改内容如下：

1、（一）下 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督

原文为本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金；通知存款；短期融资券；一年以内（含一年）的银行定期存款、银行协议存款和大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券和中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购和中央银行票据；以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他货币市场工具。

修改为：本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：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（含银行间市场债券和交易所债券）、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及法律法规或中国证监会、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。

2、（一）下 2、对基金投融资比例进行监督

原文为：

（1）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（2）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 个工作日内进行调整；

（3）本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；

（4）本基金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%；

（5）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

（6）本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；

（7）本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内，但基金管理人应在 10 个工作日内进行调整；

（8）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，不得超过基金资产净值的 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%；本基金持有的同一（指同一信用级）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或相当于 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；

（9）本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评

级具备下列条件之一：

国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

3) 本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持。

(10) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整或取消禁止行为和投资限制规定，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。除上述（2）、（8）和（9）外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《基金合同》约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。

修改为：

(1) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(2) 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；

(3) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

(4) 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%；

(5) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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%；

(6) 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%；

(7) 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。

(8) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

(9) 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%；本基金持有的同一（指同一信用级）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或相当于 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；

(10) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止

行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整或取消禁止行为和投资限制规定，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。除上述（4）、（7）、（9）外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《基金合同》约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。

### 三、重要提示

1、上述修改已遵照法律法规和中国证监会相关规定及基金合同的约定履行相关程序，自公告之日起生效。

2、投资者欲了解本基金的详细情况，请登录本公司网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）查询本基金的基金合同、托管协议及招募说明书（更新）。

3、本公告的解释权归长盛基金管理有限公司。如有疑问，请登录本公司网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）或拨打本公司客户服务电话（400-888-2666）。

### 四、风险提示

本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。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。投资者投资前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》（更新）等法律文件，并选择适合自身风险承受能力的产品进行投资。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长盛基金管理有限公司

2017年8月18日