

长信基金管理有限责任公司

关于长信利息收益开放式证券投资基金修改基金合 同的公告

根据《货币市场基金监督管理办法》（以下简称“《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》（以下简称“《规定》”）的有关要求，长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）经与长信利息收益开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）托管人中国农业银行股份有限公司协商一致并报监管备案，已完成对《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》和《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》的修改，现将具体事宜公告如下：

一、《基金合同》的修改内容

本基金修改个别事项对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，不涉及法律法规规定或《基金合同》约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项。《基金合同》的具体修改内容如下：

| 章节 | 原文条款 | 修改后条款 |
|------|----------------------------------|--|
| | 内容 | 内容 |
| 释义 | 基金7日年收益率：指以基金资产最近7日收益所折算的年资产收益率； | 基金7日年 <u>化</u> 收益率：指以基金资产最近7日收益所折算的年资产收益率； |
| | 无 | <u>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；</u> <u>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”。</u> |
| 一、前言 | 2、订立本《基金合同》的法律依据是 | 2、订立本《基金合同》的法律依据是《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、 <u>《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施</u> |

| | | |
|-----------------|--|--|
| | 《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关规定。 | <货币市场基金监督管理办法>有关问题的规定》及其它有关规定。 |
| 三、 《基金合同》当事人 | (一) 基金管理人 名称: 长信基金管理有限责任公司 注册地址: 上海市浦东新区世纪大道1600号浦项商务广场16楼 法定代表人: 田丹 成立时间: 2003年4月28日 批准设立机关: 中国证监会 批准设立文号: 证监基字[2003]63号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1亿元人民币 存续期间: 持续经营 | (一) 基金管理人 名称: 长信基金管理有限责任公司 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号9楼 法定代表人: 成善栋 成立时间: 2003年5月9日 批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2003]63号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.65 亿元人民币 存续期间: 持续经营 联系电话: 021-61009999 |
| | (二) 基金托管人 名称: 中国农业银行股份有限公司 注册地址: 北京市海淀区复兴路甲23号 法定代表人: 杨明生 成立时间: 1979年2月(恢复) 批准设立机关及批准设立文号: 国务院国发(1979)056号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1338.65 亿元人民币 存续期间: 持续经营 | (二) 基金托管人 名称: 中国农业银行股份有限公司 住所: 北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人: 周慕冰 成立时间: 2009年1月15日 批准设立机关和批准设立文号: 中国银监会银监复[2009]13号 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]23号 组织形式: 股份有限公司 注册 资金: 32,479,411.7 万元人民币 存续期间: 持续经营 |

| | 营 | |
|------------------------|--|--|
| <p>九、基金份额的申购、赎回与分级</p> | <p>(五) 申购和赎回的数额限制 本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在《招募说明书》中规定。</p> | <p>(五) 申购和赎回的数额限制 1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在《招募说明书》中规定。 2、为了保护基金份额持有人的合法权益，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。</p> |
| | <p>(六) 基金的申购费和赎回费 本基金不收取申购费和赎回费。 (七) 基金申购份额与赎回金额的计算 2、基金赎回金额的计算 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入。 赎回金额 = 基金份额净值 × 赎回份额</p> | <p>(六) 基金的申购费和赎回费 本基金在<u>一般情况下</u>不收取申购费和赎回费，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，<u>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。</u> (七) 基金申购份额与赎回金额的计算 2、基金赎回金额的计算 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的赎回费用，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入。 赎回金额 = 基金份额净值 × 赎回份额 - 赎回费用</p> |
| | <p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 1、巨额赎回的认定 若一个工作日内的基金净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数的余额）超过前一日该基金总份数的10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> | <p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 1、巨额赎回的认定 若一个工作日内的基金净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数的余额）超过前一日该基金总份数的10%，即认为是发生了巨额赎回。 为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，如本基金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，基金管理人可对其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。</p> |
| | <p>(十) 拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理 1、除出现如下情形</p> | <p>(十) 拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理 1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请： ……</p> |

| | | |
|----------------------|---|---|
| | <p>形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> | <p><u>当本基金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，并根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。</u></p> |
| | <p>(十) 拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理 2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：</p> | <p>(十) 拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理 2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请： <u>(4) 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的 1%时。</u></p> |
| | <p>(十) 拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理 无</p> | <p>(十) 拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理 <u>3、发生本基金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%的情形时，基金管理人有权选择暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算。基金管理人应当在实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告，但无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p> |
| <p>十五、 基金的投资</p> | <p>(三) 投资范围 本基金的投资对象主要包括： 1、现金； 2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单； 3、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券； 4、期限在一年以内（含一年）的债券回购； 5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据； 6、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。</p> | <p>(三) 投资范围 本基金的投资对象主要包括： 1、现金； 2、<u>期限在 1 年以内（含 1 年）</u>的银行存款、债券回购、<u>中央银行票据、同业存单</u>； <u>3、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</u>； 4、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。</p> |
| | <p>(八) 投资限制 本基金的投资组合</p> | <p>(八) 投资限制 本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> |

将遵循以下限制：

~~1、投资手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%；~~
~~2、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%；~~
~~3、在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；~~
~~4、投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的80%；~~
~~5、中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。~~
~~本基金投资组合的平均剩余期限，不超过180天。~~
~~本基金于成立之日起3个月内达到符合规定的比例限制。~~
~~由于证券市场波动或投资组合处于调整过程中，造成基金在某一时间无法达到上述比例限制，本基金管理人将在10个交易日内积极调整基金投资组合，以达到上述~~

1、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；
2、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%；
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该比例限制；
4、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%；
5、本基金投资于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；
6、本基金持有的现金、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%；
7、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%；
8、本基金持有的到期日在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%；
9、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，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%；
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%；
11、本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起3个月内对其予以全部卖出；
12、在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
13、投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的80%；
14、本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的140%；
15、中国证监会规定的其他比例限制。
因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除第1、6和11项外，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

| | |
|--|---|
| <p>比例限制。</p> <p>(九) 投资禁止</p> <p>1、本基金不得投资于以下金融工具：</p> <p>(1) 股票；</p> <p>(2) 可转换债券；</p> <p>(3) 剩余期限超过 397 天的债券；</p> <p>(4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；</p> <p>(5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> | <p>(九) 投资禁止</p> <p>1、本基金不得投资于以下金融工具：</p> <p>(1) 股票；</p> <p>(2) 可转换债券、<u>可交换债券</u>；</p> <p>(3) 剩余期限超过 397 天的债券；</p> <p>(4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券及<u>信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具</u>；</p> <p><u>(5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外</u>；</p> <p>(6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> |
| <p>无</p> | <p>(十) 投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期的计算</p> <p>1、计算公式</p> <p>本基金按下列公式计算平均剩余期限：</p> $\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$ <p>本基金投资组合平均剩余存续期的计算公式为：</p> $\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$ <p>其中：投资于金融工具产生的资产包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、期限在一年以内（含一年）的债券逆回购、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、买断式回购产生的待回购债券，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。</p> <p>投资于金融工具产生的负债包括期限在 1 年以内（含 1 年）的债券正回购、买断式回购产生的待返售债券等。</p> <p>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。</p> <p>2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期的确定</p> <p>(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；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。</p> <p>(2) 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</p> |

| | | |
|----------------------------|---|---|
| | | <p>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。</p> <p><u>(3) 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：</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(4) 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。</u></p> <p><u>(5) 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。</u></p> <p><u>(6) 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。</u></p> <p><u>(7) 买断式回购产生的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。</u></p> <p><u>(8) 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。</u></p> <p><u>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。</u></p> |
| <p>十七、 基金资产 估值</p> | <p>(三) 估值方法</p> <p>本基金估值采用摊余成本法，即<u>估值</u>对象以买入成本列示，按<u>实际利率</u>并考虑其买入时的溢价与折价，在其<u>剩余期限</u>内摊销，每日计提收益<u>或损失</u>。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。</p> | <p>(三) 估值方法</p> <p>本基金估值采用摊余成本法，即<u>计价</u>对象以买入成本列示，按<u>票面利率或协议利率</u>并考虑其买入时的溢价与折价，在其<u>剩余存续期</u>内按<u>实际利率法</u>摊销，每日计提收益。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。</p> |
| | <p>(三) 估值方法</p> <p>3、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指标计算的基金资产净值发生重大偏</p> | <p>(三) 估值方法</p> <p>3、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指标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，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。<u>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</u></p> |

| | | |
|-----------------|--|--|
| | <p>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，采用其他可参考公允价值指标，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偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。基金管理人定期测试所采用的其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。</p> | <p><u>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。</u></p> |
| 二十一、 基金的信息披露 | （二）信息披露的种类、披露时间和披露形式 3、基金临时信息披露 …… | （二）信息披露的种类、披露时间和披露形式 3、基金临时信息披露 …… <u>（26）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%时的情形；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；</u> <u>（27）本基金遇到极端风险情形，基金管理人及其股东使用固有资金从本基金购买相关金融工具；</u> |

注：基金合同内容摘要部分、托管协议涉及上述内容的一并修改。

二、重要提示

1、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的本基金基金合同及托管协议；招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改。

2、投资者可拨打本公司客户服务专线4007005566（免长话费）或登陆本公

司网站（www.cxfund.com.cn）咨询相关事宜。

风险提示：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。投资人投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资人留意投资风险。

特此公告。

长信基金管理有限责任公司

2018年3月22日