

关于修改长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

基金合同及托管协议的公告

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《规定》”）的要求，对已经成立或已获核准但未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合《规定》的，应当在《规定》实行之日起 6 个月内，修改基金合同并公告。

根据《规定》等法律法规，经与基金托管人宁波银行股份有限公司协商一致，长江证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“本公司”、“本基金管理人”）对旗下长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同相关条款进行修订。本次的修订内容包括的《长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的“前言”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的投资”、“基金资产估值”、“基金的信息披露”等章节。基于上述修订，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金托管协议涉及上述修订的相关内容一并进行修订，并将在本基金更新的招募说明书中对涉及上述修订的内容进行相应更新。基金合同及托管协议的具体修改内容见附件。本公司将在本公告发布当日，将修订后的基金合同、托管协议登载于本公司网站。

本次基金合同修订的内容和程序符合相关法律法规及基金合同的规定并已报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

同时，依据《规定》，基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。基于上述法规要求，本基金管理人将对本基金持续持有期少于7日（不含）对应的赎回费率调整为1.50%，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日的投资者，按照原定的赎回费率标准收取。

上述基金合同、托管协议的修订及赎回费率相关规则调整等事宜将自2018年3月31日起生效。对于2018年3月30日15:00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费率规则；对于2018年3月30日15:00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费率规则。投资者在销售机构办理本基金的投资事务，具体办理规则及程序请遵循销售机构的规定。

投资者可访问本公司网站(www.cjzcg1.com)或拨打客户服务电话(4001-166-866)获取相关情况。

特此公告。

长江证券（上海）资产管理有限公司

二〇一八年三月二十四日

附件：

- 1、《长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同修改前后文对照表》
- 2、《长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议修改前后文对照表》

长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>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》”）和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>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》”）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称“<u>《流动性风险管理规定》</u>”）和其他有关法律法规。</p>
第二部分 释义	无	<p><u>13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p><u>57、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</u></p>
第六部分 基金份额的申购	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p><u>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者</u></p>

与赎回		<p><u>申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</u></p>
	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见《招募说明书》，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见《招募说明书》，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。<u>其中，对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.50%的赎回费并全额计入基金财产。</u></p>
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。<u>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接受基金申购申请。</u></p>
	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。<u>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接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。</u></p>
	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 延期办理赎回申请：若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过前一工作日基金总份额20%以上的，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或认为因支付该基金份额持有人的全</u></p>

		<p>部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动，可以延期办理赎回申请：</p> <p>1) 对于该基金份额持有人当日赎回申请超过前一工作日基金总份额 20% 以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请，但延期办理期限不得超过 20 个工作日。如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，直到全部赎回为止，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 20% 以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>2) 对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前述全额赎回或延缓支付赎回款项的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；但在每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；但在每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，<u>现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</u></p>
	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 本基金持有现金或者到期日在</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 本基金持有现金或者到期日在一</p>

	<p>一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>除上述第（9）项以外，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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，<u>现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</u></p> <p><u>（12）开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；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不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>（13）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>除上述第（2）、（9）、（12）、（13）项以外，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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <u>3、开放期内，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一致的，基金管理人应当暂停估值；</u></p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息 （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 无</p>	<p>五、公开披露的基金信息 （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 <u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u> <u>基金管理人应当在基金年度报告和半</u></p>

		<u>年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u>
	五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告 无	五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告 <u>27、开放期内发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u>

长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 托管协议修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
二、基金托管协议的依据、目的和原则	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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》）、《基金合同》及其他有关规定订立。	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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》）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《基金合同》及其他有关规定订立。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；但在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；但在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，<u>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</u></p>

<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定： 基金的投资组合应遵循以下限制： (2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>除上述第（9）项以外，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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。…… 如果法律法规及监管政策等对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定： 基金的投资组合应遵循以下限制： (2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</u></p> <p><u>(12) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；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不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(13) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>除上述第 <u>(2)</u>、<u>(9)</u>、<u>(12)</u>、<u>(13)</u> 项以外，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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。…… 如果法律法规及监管政策等对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</p>
---	---