

关于修改长江乐享货币市场基金

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》、《货币市场基金监督管理办法》等法律法规，经与基金托管人交通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”）对旗下长江乐享货币市场基金（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《长江乐享货币市场基金基金合同》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。

上述基金合同、托管协议的修订等事宜将自 2018 年 3 月 31 日起生效。

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、《长江乐享货币市场基金基金合同修改前后文对照表》
- 2、《长江乐享货币市场基金托管协议修改前后文对照表》

长江乐享货币市场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 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》”）、《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〉》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》”）、《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〉》、<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 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>64、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）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、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；就本基金而言，指货币市场基金依法</u></p>

		<u>可投资的符合前述条件的资产，但中国证监会认可的特殊情形除外</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 无	五、申购和赎回的数量限制 <u>5、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>
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。 发生本基金持有的现金、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%且偏离度为负时的情形时，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。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。 发生本基金持有的现金、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%且偏离度为负时的情形时， <u>或者发生本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%且投资组合中现金、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10%且偏离度为负时</u> ，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。
	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请； <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>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p><u>8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外；</u>发生上述第 1、2、3、5、6、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。<u>发生上述第 8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。</u>如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</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，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；</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，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；<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>(4) 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开放日基金总份额 10%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：</u></p> <p><u>1) 对于该基金份额持有人当日赎回申请超过前一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人可以延</u></p>

		<p><u>期办理赎回申请。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，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。</u></p> <p><u>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部分延期赎回的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。</u></p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、投资组合限制……</p> <p>(5) 本基金应当保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，投资组合应当符合下列规定：</p> <p>1) 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%；</p> <p>3) 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%；—</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、投资组合限制……</p> <p>(5) 本基金应当保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，投资组合应当符合下列规定：</p> <p>1) 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%；<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>3) <u>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 10%；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>(10) 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><u>(11) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债</u></p>

	<p>因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会及《基金合同》规定的特殊情形除外。</p>	<p><u>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 30%；</u></p> <p><u>(12) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、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 20%；</u></p> <p><u>(13) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意；</u></p> <p><u>(14) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</u></p> <p><u>除上述第 (5) 项第 1)、3) 点和第 (7)、(10) 项另有约定外，</u>因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会及《基金合同》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、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</u></p>

		<u>协商一致的，基金管理人应当暂停估值；</u>
第十八部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>5、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</p> <p>无</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>5、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</p> <p><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></p> <p><u>基金管理人应当在基金年度报告和半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></p> <p><u>基金管理人应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u></p>
	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>6、临时报告……</p> <p>(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<u>负偏离度绝对值达到 0.25%—</u>正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%的情形；</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>6、临时报告……</p> <p>(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偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%的情形；</p> <p><u>(29) 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></p>

长江乐享货币市场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>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。</p> <p>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： ……</p> <p>（5）本基金应当保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，投资组合应符合下列规定：</p> <p>1) 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%；</p> <p>3) 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%；</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>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。</p> <p>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：……</p> <p>（5）本基金应当保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，投资组合应符合下列规定：</p> <p>1) 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%；<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>3) <u>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 10%；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>（10）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><u>（11）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的</u></p>

<p>因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会及《基金合同》规定的特殊情形除外。……</p> <p>如果法律法规及监管政策对本基</p>	<p><u>50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、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 30%；</u></p> <p><u>(12) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、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 20%；</u></p> <p><u>(13) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意；</u></p> <p><u>(14) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</u></p> <p><u>除上述第 (5) 项第 1)、3) 点和第 (7)、(10) 项另有约定外，因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会及《基金合同》规定的特殊情形除外。……</u></p>
---	--

<p>金合同约定投资组合比例限制进行变更的，在基金管理人履行适当程序后，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，在基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受上述限制。</p>	<p>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，在基金管理人履行适当程序后，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，在基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受上述限制。</p>
--	--