

关于长安货币市场证券投资基金根据《公开募集开放式 证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、 托管协议及招募说明书的公告

一、本次修改基金合同、托管协议及招募说明书的情况

长安货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）成立于 2013 年 1 月 25 日。

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“《流动性风险管理规定》”）的要求，已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内，修改基金合同并公告。

为使本基金符合《流动性风险管理规定》的要求，经与基金托管人广发银行股份有限公司协商一致，并报监管机构备案，本公司决定修改本基金的基金合同、托管协议及招募说明书，具体修改内容请见附件 1：长安货币市场证券投资基金基金合同修改对照，附件 2：长安货币市场证券投资基金托管协议修改对照和附件 3：长安货币市场证券投资基金招募说明书修改对照。

二、重要提示

（一）本次对《基金合同》、《托管协议》及《招募说明书》的修订属于按照法律法规和监管机构的规定执行，符合《基金合同》的约定，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合法律法规和监管机构的规定及基金合同的约定。

（二）本公司将于公告当日，将修改后的本基金《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并将在届时更新本基金招募说明书时一并更新相关内容。本基金《基金合同》、《托管协议》及《招募说明书》的修订自 2018 年 3 月 30 日起生效。

（三）投资者可通过本公司客户服务中心或网站咨询有关详情。本公司客户服务电话：400-820-9688，本公司网站：www.changanfunds.com。

三、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。投资者投资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。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

附件：

- 1.长安货币市场证券投资基金基金合同修改对照
- 2.长安货币市场证券投资基金托管协议修改对照
- 3.长安货币市场证券投资基金招募说明书修改对照

长安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十八日

附件 1:

长安货币市场证券投资基金基金合同修改对照

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
1	第一部分 前言	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	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》、《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“《流动性风险管理规定》”）、《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

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
		6号《基金合同的内容与格式》和其他有关法律法规。	
3	第二部分 释义		增加如下内容： 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
6-7	第二部分 释义		增加如下内容： 59、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
15	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		增加如下内容： 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、基金规模上限、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。
15-16	第六部分 基金份额的申购与赎回六、申购和赎回的价格、费用及其用途	2、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%且偏离度为负的情形时，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	2、当发生下列情形之一： （1）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； （2）前10名基金份额持有人持有的基金份额合计超过基金总份额的50%，且当投资组合中现金、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；

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
		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。	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。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回七、拒绝或暂停申购的情形	4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。	4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回七、拒绝或暂停申购的情形		增加如下内容: 7、本基金每日累计申购金额/净申购金额达到基金管理人所设定的上限。 8、单一账户每日累计申购金额/净申购金额达到基金管理人所设定的上限。 9、单笔申购金额达到基金管理人所设定的上限。 10、本基金总规模达到基金管理人设定的上限。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回七、拒绝或暂停申购的情形		增加如下内容: 11、接受某笔或某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额数达到或超过基金总份额的 50%,或者可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。
17	第六部分 基金份额的申购与赎回七、拒绝或暂停		增加如下内容: 12、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。

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
	申购的情形		
17	第六部分 基金份额的申购与赎回七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形时,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。	发生上述第 1、2、3、5、6、12、13 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 全部或部分被拒绝的 ,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。
17	第六部分 基金份额的申购与赎回八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		增加如下内容: 5、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 。
17	第六部分 基金份额的申购与赎回八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形,按基	发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且 基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请 时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
		金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。	
18	第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		增加如下内容： (4)当基金出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 30%的，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过 30%的赎回申请实施延期赎回。对该单个基金份额持有人不超过 30%的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）、（2）方式处理。对于未能赎回部分，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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，以此类推；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。
25	第七部分 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 批准设立机关和批准设立文号： 广东省工商行政管理局 440000000046541	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复[1988]292 号
43	第十二部分 基金的投资 四、投资限制	(1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期限不得超过 240 天；	(1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期限不得超过 240 天；当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 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

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
	1、组合限制		限不得超过 120 天；当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期限不得超过 180 天；
44	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制		增加如下内容： （5）本基金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； （6）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%；
44	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制		增加如下内容： （8）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%。其中金融工具包括债券、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；
45	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(10) 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，其投资组合应当符合下列规定： 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%； ②现金、国债、中央银行票据、	(13) 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，其投资组合应当符合下列规定： 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%； ②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%。当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 50%时，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

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
		<p>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%；</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>产净值的比例合计不得低于30%；当前10名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的20%时，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%；</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>
45	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>		<p>增加如下内容：</p> <p>（15）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上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（16）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的投资范围保持一致；</p>
46	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>	<p>除上述前述条款对手调整期限另有约定外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资不符合上述约定的比例不在限制之内，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</p>	<p>除（1）、（12）、（13）中①、（15）、（16）项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资不符合上述约定的比例，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。</p>

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
		殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。	
54	第十四部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		增加如下内容： 3、当前一估值日占基金资产净值 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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
64	第十八部分 基金的信息披露 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		增加如下内容： 在本基金持续运作过程中，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，并至少披露报告期末前 10 名基金份额持有人的类别、持有基金份额及占基金总份额的比例等信息。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，基金管理人应当在基金季度报告、半年度报告、年度报告等基金定期报告“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、报告期末持有基金份额及占比、报告期内持有基金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。
65	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告	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负偏离度绝对值达到 0.25%或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达到 0.5%的情形；	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%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达到 0.5%的情形；

页码	章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
65	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告		增加如下内容： 27、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；
65	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告		增加如下内容： 28、本基金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；

附件 2:

长安货币市场证券投资基金托管协议修改对照

页码	章节	原《托管协议》条款	修改后的《托管协议》条款
2	一、基金托管协议当事人 (一) 基金管理人	注册资本：1亿元人民币	注册资本：2.7 亿元人民币
3	二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国合同法证券投资基金法》(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《信息披露管理办法》)、《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内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《长安货币市场证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>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》)、《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《流动性风险管理规定》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露管理办法》)、《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内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《长安货币市场证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定制订。</p>

页码	章节	原《托管协议》条款	修改后的《托管协议》条款
		及其他有关规定制订。	
4	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:	(1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天, 平均剩余存续期限不得超过 240 天;	(1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天, 平均剩余存续期限不得超过 240 天; 当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 50% 时, 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天, 平均剩余存续期限不得超过 120 天; 当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 20% 时, 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天, 平均剩余存续期限不得超过 180 天;
5	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:		增加如下内容: (5) 本基金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; (6) 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%;
			增加如下内容: (8) 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

页码	章节	原《托管协议》条款	修改后的《托管协议》条款
			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%。其中金融工具包括债券、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；
6	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：	(10) 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，其投资组合应当符合下列规定： 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%； ② 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%； 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%；	(13) 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，其投资组合应当符合下列规定： 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%； ② 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%。 当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 50%时，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%；当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 20%时，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%； 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%；
6	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （二）基金托管人根		增加如下内容： （15）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上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的

页码	章节	原《托管协议》条款	修改后的《托管协议》条款
	据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：		投资； （16）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的投资范围保持一致；
7	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：	除上述前述条款对手调整期限另有约定外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资不符合上述约定的比例不在限制之内，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。	除（1）、（12）、（13）中①、（15）、（16）项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资不符合上述约定的比例，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。
25	八、基金资产净值计算和会计核算 （四）暂停估值的情形		增加如下内容： 3. 当前一估值日占基金资产净值 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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

附件 3:

长安货币市场证券投资基金招募说明书修改对照

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
1	第一部分 绪言	<p>本招募说明书依据《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“《暂行规定》”）、《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 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》和其他有关法律法规的规定，以及《长安货币市场证券投资基金合同》（以下简称“基金合</p>	<p>本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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“《流动性风险管理规定》”）、《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“《暂行规定》”）、《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 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》和其他有关法律法规的规定，以及《长安货币市场证券投资基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。</p>

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
		同”)编写。	
2	第二部分 释义		增加如下内容： 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
5	第二部分 释义		增加如下内容： 59、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
32	第九部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制	3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告。	增加如下内容： 3、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、基金规模上限、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。
32	第九部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	2、本基金不收取申购费用和赎回费用。	2、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。
32	第九部分 基金份额的申购与赎回	3、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	3、当发生下列情形之一： (1) 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 个交易日内到期的其他金融工

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	<p>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；</p> <p>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。</p>	<p>具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时；</p> <p>(2) 前 10 名基金份额持有人持有的基金份额合计超过基金总份额的 50%，且当投资组合中现金、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；</p> <p>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。</p>
33-35	<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、申购份额与赎回金额的计算</p>		<p>2、赎回金额的计算</p> <p>(1) 不征收强制赎回费用时</p> <p>.....</p> <p>(2) 征收强制赎回费用时</p> <p>1) 部分赎回</p> <p>投资者部分赎回基金份额时，如其账户中的累计未付收益为正或该笔赎回完成后剩余的基金份额按照每份 1.00 元为基准计算的价值足以弥补其累计至该日的未付收益负值时，赎回金额按如下公式计算：</p> <p>赎回费用 = (赎回份额 - T 日本基金总份额 × 1%) × 1.00 × 1%</p> <p>赎回金额 = 赎回份额 × 1.00 - 赎回费用</p> <p>赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基</p>

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
			<p>金财产。</p> <p>例 7：投资者 T 日持有本基金 B 类基金份额 1,000 万份，当日申请部分赎回 800 万份，假定该日本基金总份额为 50,000 万份，赎回基金份额对应的未付收益为 1,600 元，基金份额持有人可得到的赎回金额为： 赎回费用 = $(8,000,000 - 500,000,000 \times 1\%) \times 1.00 \times 1\% = 30,000.00$ 元 赎回金额 = $8,000,000 \times 1.00 - 30,000.00 = 7,970,000.00$ 元 即：投资者 T 日部分赎回其持有的 B 类基金份额 800 万份，赎回基金份额对应的未付收益为 1,600 元，赎回基金份额对应的未付收益不结清，在征收强制赎回费时，基金份额持有人可得到的赎回金额为 7,970,000.00 元。</p> <p>例 8：投资者 T 日持有本基金 B 类基金份额 1,000 万份，未付收益为 -2000 元，当日申请部分赎回 800 万份，假定该日本基金总份额为 50,000 万份，基金份额持有人可得到的赎回金额为： 赎回费用 = $(8,000,000 - 500,000,000 \times 1\%) \times 1.00 \times 1\% = 30,000.00$ 元 赎回金额 = $8,000,000 \times 1.00 - 30,000.00 = 7,970,000.00$ 元 即：投资者 T 日部分赎回其持有的 B 类基金份额 800 万份，未付收益为 -2,000 元，赎回后剩余的基金份额可以弥补当前的负收益，在征收强制赎回费时，基金份额持有人可得到的赎回金额为 7,970,000.00 元。</p> <p>投资者部分赎回基金份额时，如其该笔赎回完成后剩余的基金份额按照每份 1.00 元为基准计算的价值不足以弥补其账户中累计至该日的未付收益负值时，则将自动按部分赎回份额占投资者账户总份额的比例结转当前未付收益，赎回金额按如下公式计算： 赎回费用 = $(\text{赎回份额} - T \text{日本基金总份额} \times 1\%) \times 1.00 \times 1\%$ 赎回金额 = $\text{赎回份额} \times 1.00 + \text{赎回份额按} \text{比例} \text{结转的} \text{累计} \text{未付} \text{收益} - \text{赎回费用}$</p>

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
			<p>其中，赎回份额对应的累计收益=(申请赎回的基金份额/账户基金总份额)×账户当前累计收益</p> <p>赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>例 9: 投资者 T 日持有本基金 B 类基金份额 1,000 万份，未付收益为-20000 元，当日申请部分赎回 999 万份，假定该日本基金总份额为 50,000 万份，基金份额持有人可得到的赎回金额为：</p> <p>赎回费用=(8,000,000-500,000,000×1%)×1.00×1%=30,000.00 元 赎回金额=8,000,000×1.00+9,990,000/10,000,000×(-20,000) -30,000.00=7,950,020.00 元</p> <p>即：投资者 T 日部分赎回其持有的 B 类基金份额 800 万份，未付收益为 -2,0000 元，赎回后剩余的基金份额不能弥补当前的负收益，在征收强制赎回费时，基金份额持有人可得到的赎回金额为 7,950,020.00 元。</p> <p>2) 全部赎回</p> <p>投资者全部赎回本基金份额余额时，基金管理人自动将投资者账户中的累计未付收益一并结算并与赎回款一起支付给投资者，赎回金额按如下公式计算：</p> <p>赎回费用=(赎回份额-T 日本基金总份额×1%)×1.00×1% 赎回金额=赎回份额×1.00+该份额对应的累计未付收益-赎回费用</p> <p>赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>例 10: 某投资者 T 日申请全部赎回其持有的本基金 B 类基金份额 1,000 万</p>

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
			份, 假定该日本基金总份额为 50,000 万份, 赎回基金份额对应的未付收益为 2,000 元, 则其可得到的赎回金额为: 赎回费用 = (10,000,000 - 500,000,000 × 1%) × 1.00 × 1% = 50,000.00 元 赎回金额 = 10,000,000 × 1.00 + 2,000 - 50,000.00 = 9,952,000.00 元; 即: 投资者全部赎回其持有的 1,000 万份 B 类基金份额, 赎回基金份额对应的未付收益为 2,000 元, 赎回基金份额对应的未付收益全部结清, 在征收强制赎回费时, 其可得到的赎回金额为 9,952,000.00 元。
36	第九部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形	4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。	4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
36	第九部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形		增加如下内容: 7、本基金每日累计申购金额/净申购金额达到基金管理人所设定的上限。 8、单一账户每日累计申购金额/净申购金额达到基金管理人所设定的上限。 9、单笔申购金额达到基金管理人所设定的上限。 10、本基金总规模达到基金管理人设定的上限。
36	第九部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形		增加如下内容: 11、接受某笔或某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额数达到或超过基金总份额的 50%, 或者可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。
36	第九部分 基金份额的申购与赎回		增加如下内容: 12、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

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
	回 九、拒绝或暂停申购的情形		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。
36-37	第九部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形时，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。	发生上述第 1、2、3、5、6、12、13 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全部或部分被拒绝的，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。
37	第九部分 基金份额的申购与赎回 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		增加如下内容： 5、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。
37	第九部分 基金份额的申购与赎回 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的	发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
		<p>比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>	<p>请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>
38	<p>第九部分 基金份额的申购与赎回 十一、巨额赎回的情形及处理方式</p>		<p>增加如下内容： (4) 当基金出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 30% 的，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过 30% 的赎回申请实施延期赎回。对该单个基金份额持有人不超过 30% 的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）、（2）方式处理。对于未能赎回部分，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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，以此类推；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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>
43	<p>第十部分 基金的投资 四、投资限制</p>	<p>(1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期限不得超过 240 天；</p>	<p>(1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期限不得超过 240 天；当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 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</p>

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
	1、组合限制		限不得超过 120 天；当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期限不得超过 180 天；
43	第十部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制		增加如下内容： （5）本基金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； （6）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%；
44	第十部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制		增加如下内容： （8）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%。其中金融工具包括债券、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；
44	第十部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(10) 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，其投资组合应当符合下列规定： 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%； ②现金、国债、中央银行票据、	(13) 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，其投资组合应当符合下列规定： 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%； ②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%。当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 50%时，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

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
		<p>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%;</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>产净值的比例合计不得低于 30%; 当前 10 名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 20%时, 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%;</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>
44-45	<p>第十部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>		<p>增加如下内容:</p> <p>(15) 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上述比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(16) 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的投资范围保持一致;</p>
45	<p>第十部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>	<p>除上述前述条款对于调整期限另有约定外, 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资不符合上述约定的比例不在限制之内, 基金管理人应在 10 个工作日内进</p>	<p>除 (1)、(12)、(13) 中①、(15)、(16) 项外, 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资不符合上述约定的比例, 基金管理人应在 10 个工作日内进行调整, 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。</p>

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
		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。	
52	第十一部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		增加如下内容： 3、当前一估值日占基金资产净值 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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
60	第十六部分 基金的信息披露 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		增加如下内容： 在本基金持续运作过程中，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，并至少披露报告期末前 10 名基金份额持有人的类别、持有基金份额及占基金总份额的比例等信息。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，基金管理人应当在基金季度报告、半年度报告、年度报告等基金定期报告“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、报告期末持有基金份额及占比、报告期内持有基金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。
61	第十六部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告	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负偏离度绝对值达到 0.25%或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”	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%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达到 0.5%的情形；

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
		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达到 0.5%的情形；	
61	第十六部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告		增加如下内容： 27、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；
61	第十六部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告		增加如下内容： 28、本基金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；
64	第十七部分 风险揭示	4、流动性风险 流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。	4、流动性风险 流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。 (1) 基金申购、赎回安排 本基金申购、赎回安排的具体规则请参见本基金基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“第九部分 基金份额的申购与赎回”。 (2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的货币市场工具。本基金基于分散投资的原则在行业、个券和久期方面未有高集中度的特征，

页码	章节	原《招募说明书》条款	修改后的《招募说明书》条款
			<p>综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险较低。</p> <p>(3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施</p> <p>基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，当基金出现巨额赎回时，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一定比例以上的部分，基金管理人可以对其实施延期赎回。</p> <p>(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响</p> <p>在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取强制赎回费、暂停基金估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。</p> <p>对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。</p> <p>在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能导致投资人的赎回申请无法得到及时确认、赎回款项无法得到及时支付等情形，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。</p>