

# 金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金

## 修改基金合同及托管协议的公告

### 一、本次修改的基本情况

金鹰货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 11 月 2 日证监许可[2012]1444 号文核准募集，于 2012 年 12 月 7 日基金合同生效。2015 年 12 月 17 日中国证监会和中国人民银行联合颁布了《货币市场基金监督管理办法》（证监会令[第 120 号]，以下简称《管理办法》），同日中国证监会公布的《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》（证监会公告[2015]30 号）。为符合上述法律法规修改的要求，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，金鹰基金管理有限公司决定于 2016 年 9 月 22 日起修改金鹰货币市场证券投资基金的基金合同（以下简称《基金合同》）及托管协议，具体修改内容请详见附件 1《金鹰货币市场证券投资基金基金合同修改对照表》、附件 2《金鹰货币市场证券投资基金托管协议修改对照表》。

### 二、重要提示

1. 本次修订属于按照有效的法律法规和监管机构的规定执行，符合《基金合同》的约定。《基金合同》修改后，基金的投资目标、风险收益特征不发生改变，对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，无需召开基金份额持有人大会。

2、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。

3、本公告构成本基金招募说明书的补充，基金管理人将在届时更新招募说明书时一并更新以上内容。

4、投资者可通过本基金管理人的网站：[www.gefund.com.cn](http://www.gefund.com.cn) 或客户服务电话：400-6135-888 了解详情。

### 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。投资有风险，敬请投资人选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

附件1：《金鹰货币市场证券投资基金基金合同修改对照表》

附件2：《金鹰货币市场证券投资基金托管协议修改对照表》

金鹰基金管理有限公司

2016年9月22日

附件 1：金鹰货币市场证券投资基金《基金合同》修改对照表

页码	章节	旧版条款	新版条款	修改理由
1	一、前言	<p>(一) ……</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》”)、《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) ……</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》(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“《实施规定》”)和其他有关法律法规。</p>	修改和补充本基金适用的法律依据。
1	一、前言	<p>(三) ……</p> <p>基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。</p>	<p>(三) ……</p> <p>基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。</p> <p><b>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。</b></p>	根据《货币市场基金监督管理办法》(以下简称《管理办法》)第 18 条的

				规定补充。
2	一、前言		<p>增加如下内容：</p> <p>（五）本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。</p>	完善基金合同相关表述
3	二、释义	9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 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	9、《基金法》：指自 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	根据法律法规修订的实际情况调整。
3	二、释义	10、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	
3	二、释义	12、《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 日修改的《证券投资基金运作管理办法》	12、《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	

5	二、释义	41、《业务规则》：指《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守	41、《业务规则》：指《金鹰基金管理有限公司注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守	根据基金管理人业务规则修订的实际情况调整。
8	二、释义	55、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	55、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	根据《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》”）及相关法律法规修订的实际情况调整。
10	二、释义		<p>增加如下内容：</p> <p>66、《管理办法》：指中国证监会及中国人民银行于2015年12月17日颁布、于2016年2月1日起实施的《货币市场基金监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>67、偏离度：指采用影子定价法确定的基金资产净值与采用摊余成本法计算的基金资产净值之间的偏离程度，计算公式：偏离度 = (NAVS - NAVA) / NAVA，其中 NAVA 代表摊余成本法计算的基金资产净值，NAVS 为影子定价确定的基</p>	根据《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》”）及相关法律法规修订的实际情况调整。

			<p>金资产净值</p> <p>68、交易日：指中国银行间市场或上海、深圳证券交易所可以进行交易的日期</p>	
12	六、基金备案	<p>(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。</p>	<p>(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《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人民币 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中披露；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。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>	根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》调整相关内容
15	七、基金份额的申购与赎回	<p>(五) 申购和赎回的金额</p> <p>无</p>	<p>(五) 申购和赎回的金额</p> <p>5、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>	根据法律法规增加相关的表述
15	七、基金份额的申购与赎回	<p>(六) ……</p> <p>4、本基金的申购费</p>	<p>(六) ……</p> <p>4、除本基金合同或法律法规</p>	根据《管理办法》第 17 条

		<p>率和赎回费率均为 0%。</p> <p>本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。</p>	<p><u>另有规定外</u>，本基金的申购费率和赎回费率均为 0%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。</p>	<p>补充强制赎回费的规定，并完善相关表述。</p>
16	七、基金份额的申购与赎回	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>无</p>	<p>增加如下内容：</p> <p>5、在本基金持有的现金、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低于 5%，且采用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为负的情形时，对当日单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请收取 1% 的强制赎回费，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>	
16	七、基金份额的申购与赎回	<p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>无</p>	<p>增加如下内容：</p> <p>6、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 0.5%时，基金管理人应当暂停接受</p>	<p>根据《管理办法》第 12 条补充应当暂停申购的</p>

			申购。	情形。
16	七、基金份额的申购与赎回	<p>(七)……</p> <p>发生上述暂停申购情形时，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。</p>	<p>(七)……</p> <p>发生上述 <u>1、2、3、5、6、7</u> 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。</p>	完善基金合同相关表述
17	七、基金份额的申购与赎回	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>无</p>	<p>增加如下内容：</p> <p>5、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连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人有权决定暂停接受所有赎回申请并终止基金合同。</p>	根据《管理办法》第 12 条补充应当暂停申购的情形。
17	七、基金份额的申购与赎回	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；……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予以</p>	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；……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予以公告。</p> <p><b>为公平对待不同类别基金份</b></p>	根据《管理办法》第 17 条的规定补充。

		公告。	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。	
20	七、基金份额的申购与赎回		增加如下内容:  (十六) 其他业务  在不违反相关法律法规、对基金份额持有人的权利无实质性不利影响的前提下,基金管理人可以开展将基金份额在依法设立的交易所进行交易或按照法律法规及基金合同等有关规定进行协议转让、质押等业务,基金管理人可制定相应的业务规则,届时无需召开基金份额持有人大会审议但须报中国证监会核准或备案并提前公告。	完善基金关于其他业务的相关表述
21	八、基金合同当事人及权利义务 (一)基金管理人	名称:金鹰基金管理有限公司  注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元  邮政编码:510620  法定代表人:刘东	名称:金鹰基金管理有限公司  注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元  住所:广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 楼  邮政编码:510623  法定代表人:凌富华	根据实际情况更新
29	九、基金份额持有人大会	(二)召开事由  无。	增加如下内容:  3、当影子定价确定的基金资	根据《管理办法》第 12 条

			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%，且基金管理人决定暂停接受所有赎回申请并终止基金合同的，则基金合同将根据第二十部分的约定进行基金财产清算并终止，且无须召开基金份额持有人大会。	完善相关表述。
29	九、基金份额持有人大会	(三) 召集人和召集方式 无。	增加如下内容：  6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。	根据《基金法》完善相关表述
31	九、基金份额持有人大会	(五)基金份额持有人出席会议的方式 2、召开基金份额持有人大会的条件 (1)现场开会方式 在同时符合以下条件时，现场会议方可举行： 1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%，下同)； 2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会	(五)基金份额持有人出席会议的方式 2、召开基金份额持有人大会的条件 (1)现场开会方式 在同时符合以下条件时，现场会议方可举行： 1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%，下同)； 2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与	根据《基金法》补充二次召集制度

	<p>者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。</p> <p>(2) 通讯开会方式</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：</p> <p>1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；</p> <p>3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；</p> <p>4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；</p>	<p>基金管理人持有的注册登记资料相符。</p> <p><b>若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。</b></p> <p>(2) 通讯开会方式</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：</p> <p>1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；</p> <p>3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或</p>	
--	---	--	--

		<p>5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。</p>	<p>基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；</p> <p>4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；</p> <p>5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。</p> <p>若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。</p>	
35	九、基金份额持有人大会	(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告	(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的	根据《基金法》、《公开

		<p>时间、方式</p> <p>1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。</p>	<p>公告时间、方式</p> <p>1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。</p>	<p>募集证券投资基金运作管理办法》调整相关内容</p>
35	九、基金份额持有人大会	<p>(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。</p>	<p>(十) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>完善基金合同相关表述</p>
40	十三、基金的投资	<p>(二) 投资范围</p> <p>本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体范围如下：</p> <p>1、现金；</p> <p>2、通知存款；</p> <p>3、短期融资券；</p> <p>4、一年以内（含一</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体范围如下：</p> <p>1、现金；</p> <p>2、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；</p> <p>3、剩余期限在 397 天以内（含</p>	<p>根据《管理办法》第 4 条调整本基金的投资范围。</p>

		<p>年)的银行定期存款、大额存单;</p> <p>5、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;</p> <p>6、期限在一年以内(含一年)的债券回购;</p> <p>7、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;</p> <p>8、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>如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。</p>	<p>397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;</p> <p>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>如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。</p>	
42	十三、基金的投资	<p>(六)投资限制</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、资产支持证券和中期票据;</p> <p>(4)信用等级在 AAA 级以下的企业债券;</p>	<p>(六)投资限制</p> <p>1、本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>(1)股票、权证、股指期货;</p> <p>(2)可转换债券、可交换债券;</p> <p>(3)以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,已进入最后一个利率调整期的除外;</p>	<p>根据《管理办法》相关规定调整本基金的投资组合限制,并完善相关表述。</p>

		<p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p>	<p>(4) 信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；</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>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p>	
47	十三、基金的投资	<p>(六)投资限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(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；</p> <p>(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超</p>	<p>(六)投资限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(1) 本基金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>(2) 本基金持有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；</p> <p>本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全</p>	

		<p>过基金资产净值的 30%;</p> <p>(4) 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%;</p> <p>(5) 本基金买断式 回购融入基础债券的剩 余期限不得超过 397 天;</p> <p>(6) 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—商业 银行的存款,不得超过 基金资产净值的 5%;</p> <p>(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%;</p> <p>(8) 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</p>	<p>部基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;</p> <p>(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;</p> <p>(4) 本基金投资于具有基 金托管资格的同—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%;</p> <p>投资于不具有基金托 管资格的同—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%;</p> <p>(5) 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%;</p> <p>1) 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%;</p> <p>2) 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%;</p> <p>3) 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%;</p>	
--	--	---	--	--

		<p>例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；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%；</p> <p>(9) 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；</p> <p>(10) 除发生巨额赎回的情形外，本基金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本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；</p> <p>(11) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除上述第 (10) 条</p>	<p>4) 本基金投资的资产支持证券的信用评级，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；</p> <p>(6) 本基金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；</p> <p>(7) 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%；</p> <p>(8) 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%；</p> <p>(9) 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占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；</p> <p>(10) 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</p>	
--	--	--	--	--

		<p>外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p>3、本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>(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；</p> <p>(2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：</p> <p>1) 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；</p> <p>2) 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）。</p>	<p>占基金资产净值的比例不得超过 20%；</p> <p>(11) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(12) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除上述第（1）条、第（5）条 4) 项、第（7）条外，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及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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	
--	--	---	---	--

	<p>同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用评级级别为准。</p> <p>本基金持有的短期融资券信用等级下降、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 20 个交易日内对其予以全部减持。</p> <p>4、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。</p> <p>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。</p>		
--	---	--	--

44	十三、基金的投资	<p>(六)投资限制</p> <p>6、禁止行为</p> <p>(1)承销证券；</p> <p>(2)向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(3)从事承担无限责任的投资；</p> <p>(4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</p> <p>(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</p> <p>(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(8)依照法律法规有关规定，由中国证监</p>	<p>(六)投资限制</p> <p>4、禁止行为</p> <p>(1)承销证券；</p> <p>(2)违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(3)从事承担无限责任的投资；</p> <p>(4)买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；</p> <p>(5)向基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予</p>	<p>根据《基金法》及《运作办法》完善相关表述</p>
----	----------	--	---	-----------------------------

		<p>会规定禁止的其他活动；</p> <p>(9) 本基金不得与基金管理人的股东进行交易，不得通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数；</p> <p>(10) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。</p>	<p>以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。</p>	
44	十三、基金的投资	<p>(七) 投资组合平均剩余期限计算方法</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> $\frac{(\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \sum \text{债券正回购} \times \text{剩余期限})}{(\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购})}$ <p>其中：投资于金融工具产生的资产包括现</p>	<p>(七) 投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法</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>按下列公式计算平均剩余存续期限：</p> $\frac{(\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限})}{(\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购})}$	<p>根据《规定》修改平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法。</p>

		<p>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、中国证监会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一年以内(含一年)的正回购、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的确定方法</p> <p>(1) 银行存款、清算</p>	<p>期限+债券正回购×剩余存续期限) / (投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+债券正回购)</p> <p>其中: 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)的资产支持证券、债券、非金融企业债务融资工具; 买断式回购产生的待回购债券; 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一年以内(含一年)的正回购、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、剩余存续期限的确定方法</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;</p>	
--	--	---	---	--

		<p>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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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</p>	<p>(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；</p> <p>(3) 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；</p> <p>(4) 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；</p> <p>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；</p> <p>(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；</p> <p>(6) 本基金资产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：</p>	
--	--	---	--	--

		<p>余期限；</p> <p>(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；</p> <p>(8) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>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。</p>	<p>本基金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；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。</p> <p>(7) 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。</p> <p>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计算方法另有规定的从其规定。</p>	
48	十五、基金资产的估值	<p>(二) 估值方法</p> <p>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。</p> <p>2、如有确凿证据表</p>	<p>(二) 估值方法</p> <p>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。本基金采用上述方法对基金资产进行估值核算，可能会带来基金净值的波动。</p> <p>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</p>	<p>1、根据《规定》调整表述；</p> <p>2、根据《管理办法》第12条调整估值偏离的处理规定。</p> <p>3、完善</p>

		<p>明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>	<p>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”。</p> <p>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0.50%时，基金管理人应暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调到0.50%以内。当负偏离度绝对值达到0.50%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，并将负偏离度绝对值控制在0.50%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.50%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。</p> <p>3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公</p>	<p>相 关 表 述</p>
--	--	---	--	----------------

			允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按届时有效且最能反映公允价值的其他估值方法进行估值。	
61	十九、基金的信息披露	<p>(八)临时报告与公告</p> <p>26、当“影子定价”计算的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值与“摊余成本法影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过 0.5% 的情形;</p>	<p>(八)临时报告与公告</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;</p>	根据《管理办法》第 12 条补充临时报告的内容。
62	十九、基金的信息披露	<p>(十二)信息披露文件的存放与查阅</p> <p>无。</p>	<p>最后自然段增加如下内容:</p> <p>如将来法律法规修改或中国证监会发布新的监管规定导致货币市场基金信息披露的相关规则变更的,基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。</p>	完善合同相关表述。
63	二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>(一)……</p> <p>2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生</p>	<p>(一)……</p> <p>2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,并自决议生效后 2 个工作日内在指定媒体公告。</p>	根据最新法律法规的修订进行修改

		效之日起 2 日內在至少 一種指定媒體公告。		
--	--	---------------------------	--	--

**附件 2：金鹰货币市场证券投资基金托管协议修改对照表**

页码	章节	旧版条款	新版条款	修改理由
1	一、基金托管协议当事人	住所：广东省广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22、23 楼 邮政编码：510620 法定代表人：刘东	住所：广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 楼 邮政编码：510623 法定代表人：凌富华	根据实际情况更新
3	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) ……</p> <p>本基金主要投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限限制的债券、央行票据、回购，以及中国证监会、中国人民银行认可的、允许货币市场基金投资的其他金融工具，包括：</p> <p>1、现金；</p> <p>2、通知存款；</p> <p>3、短期融资券；</p> <p>4、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；</p> <p>5、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；</p> <p>6、期限在一年以内（含一年）的债券回购；</p> <p>7、期限在一年以内（含一年）的中央银行票</p>	<p>(一) ……</p> <p>本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体范围如下：</p> <p>1、现金；</p> <p>2、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；</p> <p>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；</p> <p>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>如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。</p>	根据《管理办法》第 4 条调整本基金的投资范围。

		<p>据；</p> <p>8、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>如在本基金存续期内出现新的金融产品，且监管部门允许开放式货币市场基金投资，本基金管理人履行相关程序后可将其纳入本基金的投资范围。</p>		
3	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(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：</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、资产支持证券和中期票据；</p> <p>(4) 信用等级在AAA级以下的企业债券；</p> <p>(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；</p> <p>(6) 非在全国银行间</p>	<p>(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：</p> <p>1、本基金不得投资于以下金融工具：</p> <p>(1) 股票、权证、股指期货；</p> <p>(2) 可转换债券、可交换债券；</p> <p>(3) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；</p> <p>(4) 信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；</p> <p>(5) 非在全国银行间债</p>	<p>根据《管理办法》相关规定调整本基金的投资组合限制，并完善相关表述。</p>

	<p>债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；</p> <p>(7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(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；</p> <p>(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；</p> <p>(4) 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%；</p> <p>(5) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(6) 本基金存放在具有基金托管资格的同一</p>	<p>易的资产支持证券；</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>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(1) 本基金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>(2) 本基金持有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；</p> <p>本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(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；</p> <p>(4) 本基金投资于具有</p>	
--	---	---	--

	<p>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%;</p> <p>(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%;</p> <p>(8)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%;</p> <p>(9)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;</p> <p>(10)除发生巨额赎回的情形外,本基金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本基金</p>	<p>基金托管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%;</p> <p>投资于不具有基金托管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%;</p> <p>(5)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%;</p> <p>1)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%;</p> <p>2)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%;</p> <p>3)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%;</p> <p>4)本基金投资的资产支持证券的信用评级,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</p>	
--	---	---	--

	<p>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;</p> <p>(11) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除上述第(10)条外, 因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的, 基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到上述标准。法律法规另有规定时, 从其规定。</p> <p>3、本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准:</p> <p>(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;</p> <p>(2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券, 其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一:</p> <p>1) 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;</p> <p>2) 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</p>	<p>个月内予以全部卖出;</p> <p>(6) 本基金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;</p> <p>(7) 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%;</p> <p>(8) 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%;</p> <p>(9) 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占基金资产净值的比例合计不得超过 30%;</p> <p>(10) 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%;</p> <p>(11) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;</p> <p>(12) 中国证监会规定的其他比例限制。</p>	
--	---	--	--

		<p>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）。</p> <p>同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用评级为准。</p> <p>本基金持有的短期融资券信用等级下降、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 20 个交易日内对其予以全部减持。</p> <p>4、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。</p> <p>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。</p>	<p>除上述第（1）条、第（5）条 4）项、第（7）条外，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及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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	
5	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核	<p>（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进</p>	<p>（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。</p>	<p>根据《基金法》及《运作办法》完善相关表述</p>

	查	<p>行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。</p> <p>若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的</p>	<p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。</p>	
--	---	---	--	--

		发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。		
8	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(六) 5、本基金投资于银行存款应符合以下规定：</p> <p>(1) 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或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。</p> <p>(2) 本基金定期存款的期限不得超过一年(含一年)，且到期后不得展期。</p> <p>(3) 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百分之三十。</p> <p>(4) 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百分之五。</p> <p>(5) 本基金投资于定期存款的比例，不得超过基金资产净值的百分之三十。</p> <p>基金托管人将据此监督。</p>	<p>(六) 5. 本基金投资于银行存款应符合以下规定：</p> <p>(1) 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；</p> <p>(2) 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%；</p> <p>(3) 本基金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%；</p> <p>基金托管人将据此监督。</p>	根据《管理办法》第 6 条进行修改

22	八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2. 估值方法</p> <p>(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。在有关法律法规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。</p> <p>(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</p>	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2. 估值方法</p> <p>(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。本基金采用上述方法对基金资产进行估值核算，可能会带来基金净值的波动。</p> <p>(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”。</p> <p>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</p>	<p>1、根据《规定》调整表述；</p> <p>2、根据《管理办法》第 12 条调整估值偏离的处理规定。</p> <p>3、完善相关表述</p>
----	-----------------	---	--	--

	<p>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。</p> <p>(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>(4) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。</p>	<p>到 0.50%时，基金管理人应暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调到 0.50%以内。当负偏离度绝对值达到 0.50%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，并将负偏离度绝对值控制在 0.50%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%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。</p> <p>(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按届时有效且最能反映公允价值的其他估值方法进行估值。</p> <p>(4) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，</p>	
--	---	---	--

			共同查明原因，双方协商解决。	
36	十五、禁止行为	<p>(九)基金财产用于下列投资或者活动：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 承销证券；</li> <li>2. 向他人贷款或者提供担保；</li> <li>3. 从事承担无限责任的投资；</li> <li>4. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</li> <li>5. 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</li> <li>6. 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；</li> <li>7. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</li> <li>8. 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则</li> </ol>	<p>(九)基金财产用于下列投资或者活动：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 承销证券；</li> <li>2. 违反规定向他人贷款或者提供担保；</li> <li>3. 从事承担无限责任的投资；</li> <li>4. 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；</li> <li>5. 向基金管理人、基金托管人出资；</li> <li>6. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</li> <li>7. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</li> </ol> <p>法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。</p>	根据《基金法》进行修订

		本基金投资不再受相关限制。		
--	--	---------------	--	--