

# 关于建信嘉薪宝货币市场基金修改基金合同的公告

关于建信嘉薪宝货币市场基金修改基金合同的公告

建信嘉薪宝货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2014]338号文准予注册。本基金合同于2014年6月17日生效。自本基金合同生效至今，基金管理人一直本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。

根据《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》、北京证监局《关于修改货币市场基金合同有关问题的通知》，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，建信基金管理有限责任公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定修改《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）。

此外，本公司根据《基金合同》修改内容及实际情况对《建信嘉薪宝货币市场基金托管协议》涉及前述内容的章节进行修改，并更新了基金管理人和基金托管人的相关信息及完善表述等；本公司将在更新的《建信嘉薪宝货币市场基金招募说明书》中，对上述内容进行相应修改。

本次《基金合同》因相应的法律法规发生变动进行修改，不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，根据《基金合同》的约定无需召开基金份额持有人大会。本基金

《基金合同》的修改详见附件《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同修改内容对照表》。

本公司将于公告当日，将修改后的本基金《基金合同》、《建信嘉薪宝货币市场基金托管协议》及《建信嘉薪宝货币市场基金招募说明书》登载于公司网站。投资者欲了解基金信息请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及相关法律文件。

本基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整上述有关内容。

投资者可通过本基金管理人的网站：[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 或客户服务电话：  
400-81-95533（免长途话费），010-66228000 了解详情。

本公告的解释权归本公司所有。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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，基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并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。

建信基金管理有限责任公司

2016年7月9日

《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同修改内容对照表》

所属部分 《基金合同》原条款 《基金合同》修改后条款

全文 把全文出现的“媒体”修改为“媒介”

第一部分 前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则

.....

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。

.....

三、建信嘉薪宝货币市场基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 一、订立本基金合同的目的、依据和原则

.....

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》和其他有关法律法规。

.....

三、建信嘉薪宝货币市场基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

第二部分 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 日实施的《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

.....

46、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 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

.....

46、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和折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销

第五部分 基金备案 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案；基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，在基金管理人履行监管报告和信息披露程序后，本基金份额将自动转换为建信货币市场基金份额

（此转换事项无须经基金份额持有人大会决议），本基金合同终止。 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，在基金管理人履行监管报告和信息披露程序后，本基金份额将自动转换为建信货币市场基金份额（此转换事项无须经基金份额持有人大会决议），本基金合同终止。

## 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

.....

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 本基金不收取申购费用和赎回费用。

.....

## 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。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、本基金出现当日净收益或累计未分配净收益小于零的情形，为保护持有人的利益，基金管理人可视情况暂停本基金的申购。

7、基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构、销售机构等因异常情况无法办理申购业务。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

.....

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

五、申购和赎回的数量限制

.....

4、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。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

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。

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

.....

- 4、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。
- 5、当日超出基金管理人规定的总规模限制。
- 6、为保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人可以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。
- 7、当影子定价法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或超过 0.5%时。

## 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

.....

- 7、当影子定价法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的。
  - 8、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。
- 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。

## 第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

### (一) 基金管理人简况

.....

法定代表人：江先周

.....

### (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集基金； 一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

.....

法定代表人：许会斌

.....

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

第八部分 基金份额持有人大会

一、召开事由

.....

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，增加、减少、调整基金份额类别设置或调整各类别基金份额的销售服务费率或变更收费方式；

(4) 在不违反法律法规的前提下，基金管理人、基金份额登记机构、代销机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；

(5) 在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

(6) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(7) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

.....

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

.....

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法出具无异议意见之日起生效。本基金份额持有人大会未设日常机构。

### 一、召开事由

.....

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，增加、减少、调整基金份额类别设置或调整各类别基金份额的销售服务费率或变更收费方式；

(3) 在不违反法律法规的前提下，基金管理人、基金份额登记机构、代销机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；

(4) 在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(7) 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%，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，则基金合同将根据第十九部分的约定进行基金财产清算并终止。

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

.....

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

.....

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

(一) 基金管理人的更换程序

.....

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；

.....

（二）基金托管人的更换程序

.....

4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行； 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

（一）基金管理人的更换程序

.....

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案；

.....

（二）基金托管人的更换程序

.....

4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案；

第十一部分 基金份额的登记 四、基金份额登记机构的义务

.....

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录15年以上； 四、基金份额登记机构的义务

.....

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录20年以上；

第十二部分 基金的投资 二、投资范围

本基金将投资于以下金融工具：

2、通知存款；

3、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；

4、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；

5、期限在一年以内（含一年）的债券回购；

- 6、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
- 7、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。

.....

#### 四、投资限制

##### 1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (2) 可转换债券；
- (3) 剩余期限超过 397 天的债券；
- (4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；
- (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；

##### 2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。
- (2) 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%。
- (3) 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%。
- (4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。
- (5) 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%。
- (6) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。
- (7) 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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。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。

（8）本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准：

- 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。
- 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具备下列条件之一：
  - i. 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。
  - ii. 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）。
- ③同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。
- ④本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持。

（9）中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## …… 二、投资范围

本基金将投资于以下金融工具：

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；

3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具；

4、法律法规或中国证监会、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。

.....

#### 四、投资限制

1、本基金不得投资于以下金融工具：

(2) 可转换债券、可交换债券；

(3) 信用等级在 AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具；

(4) 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；

2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

(2) 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，不超过该证券的 10%。

(3) 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。

(4) 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%。

(5) 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。

(6) 本基金投资于有固定期限的银行存款（不包括本基金投资于有存款期限，但根据协议可以提前支取的银行存款）的比例，不得超过基金资产净值的 30%；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，合计不得超过基金资产净值的 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，合计不得超过基金资产净值的 5%。

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；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%；本基金投资的资产支持证券的信用评级，不高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。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。

(11) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 法律法规或中国证监会规定的其它比例限制。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资以最新的规定为准或不再受相关限制。

因证券市场波动、债券发行人合并、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。法律法规及中国证监会另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

.....

#### 4、投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算

(1) 平均剩余期限（天）的计算公式如下：

$$\left( \sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限} \right) / \left( \text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购} \right)$$

(2) 平均剩余存续期限的计算公式如下：

$$\left( \sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限} \right) / \left( \text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购} \right)$$

(3) 各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

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；

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；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；

3) 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；

4) 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；

5) 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：

A、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。

B、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。

平均剩余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。

#### 第十四部分 基金资产估值 三、估值方法

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。

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。 三、估值方法

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。

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“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。

#### 第十八部分 基金的信息披露 （六）临时报告

.....

#### 26、中国证监会规定的其他事项。 （六）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超过 0.5%的情形；

#### 27、中国证监会规定的其他事项。

#### 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 一、《基金合同》的变更

.....

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案后生效，自决议生效之日起在指定媒体公告。 一、《基金合同》的变更

.....

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效之日起在指定媒介公告。

