

关于新华壹诺宝货币市场基金修改基金合同及托管协议的说明

新华壹诺宝货币市场基金基金合同原内容修改后内容第一部分前言 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》”)、《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。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》”)、《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》”)、《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管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。第二部分释义 45、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，每日计提损益第二部分释义 45、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。2. 本基金的申购、赎回价格为每份基金单位 1.00 元。投资者申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元，赎回所得的金额等于赎回份额乘以 1.00 元。3、申购份额的计算本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。4、赎回金额的计算本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。七、拒绝或暂停申购的情形八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形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一条 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。六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1. 本基金通常情况下不收取申购费用和赎回费用。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，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本基金利益最大化的情形除外。七、拒绝或暂停申购的情形增加一条 6、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 0.50%时；八、暂停赎回或延缓支

付赎回款项的情形增加一条（二）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。第十二部分基金的投资二、投资范围本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：1、现金；2、通知存款；3、短期融资券；4、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；5、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据；6、期限在一年以内（含一年）的债券回购；7、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；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。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。四、投资限制 1、本基金不得投资于以下金融工具：（1）股票、权证；（2）可转换债券；（3）剩余期限（或回售期限）超过 397 天的债券、资产支持证券、中期票据；（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；（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；（7）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。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。2、组合限制本基金的投资组合将遵循以下限制：（1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天（2）本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；（4）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。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%；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%；（5）除发生巨额赎回的情形外，本基金的投资组合中，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货币市场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 个工作日内进行调整；（6）本基金投资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%；（7）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。（8）本基金进行买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过397天。（9）中国证监会、中国人民银行规定的其他限制。本基金在基金合同生效后六个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。对于法律法规要求的强制性规定，当法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金将相应修改投资组合限制规定。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。法律法规另有规定的除外。

3、投资组合平均剩余期限计算方法其中：本基金投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（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、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券、剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据、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、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。（2）各类资产和负债剩余期限的确定方法1）银行存款、清算备付金、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。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。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。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。5）中央银行票据、资产支持证券、中期票据的剩余期限以计算日至中央银行票据、资产支持证券、中期票据到期日的实际剩余天数计算。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余期限。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。8）法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。

第十二部分基金的投资二、投资范围本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：1、现金；2、期限在1年以内（含1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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

四、投资限制1、本基金

不得投资于以下金融工具：（1）股票、权证；（2）可转换债券、可交换债券；（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；（4）信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；（5）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。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。

2、组合限制本基金的投资组合将遵循以下限制：（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%；（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基金资产净值的 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级，如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的，应采用孰低原则确定其评级，并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定；（4）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；（5）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上述比例限制。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%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%；（6）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，本基金债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 20%；（7）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%，中国证监会规定的特殊品种除外；（8）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%；（9）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证券投资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%；（10）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。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；（11）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；（12）本基金投资于现金、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%；（13）本基金投资于现金、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不得低于 10%；（14）本基金投资于到期日在 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%；（15）中国证监会、中国人民银行规定的其他限制。本基金在基金合同生效后六个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在 10 个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。对于法律法规要求的强制性规定，当法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金将相应修改投资组合限制规定。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。法律法规另有规定的除外。

3、投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期的计算方法其中：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、债权、非金融企业债务融资工具、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会及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。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。（2）各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定方法 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）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。3）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：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；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。4）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。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。6）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。7）买断式回购产生的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。8）法律法规、中国证监会另有规定的，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

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。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负偏离度的绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个工作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 个工作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）临时报告第十八部分基金的信息披露（六）临时报告增加两条 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%、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；新华壹诺宝货币市场基金托管协议原内容修改后内容本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：1、现金；2、通知存款；3、短期融资券；4、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；5、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据；6、期限在一年以内（含一年）的债券回购；7、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；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。（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、本基金不得投资于以下金融工具：（1）股票、权证；（2）可转换债券；（3）剩余期限（或回售期限）超过 397 天的债券、资产支持证券、中期票据；（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；（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；（7）中国证监会禁止投资的其他金融工具。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。2、本基金的投资组合将遵循以下限制：（1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天；（2）本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%（4）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。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%；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%。（5）除发生巨额赎回的情形外，本基金的投资组合中，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货币市场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；（6）本基金投资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%；（7）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。（8）本基金进行买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天。（9）中国证监会、中国人民银行规定的其他限制。本基金在基金合同生效后六个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在 10 个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。对于法律法规要求的强制性规定，当法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金将相应修改投资组合限制规定。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。法律法规另有规定的除外。本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：1、现金 2、期限在 1 年以内（含 1 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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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。（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、本基金不得投资于以下金融工具：（1）股票、权证；（2）可转换债券、可交换债券；（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；（4）信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具；（5）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。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。2、本基金的投资组合将遵循以下限制：（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%；本基金与由基金管理人管理的且在本基金托管人处托管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%；（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基金资产净值的 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级，如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的，应采用孰低原则确定其评级，并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定；（4）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；（5）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上述比例限制。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%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%；（6）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，本基金债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 20%；（7）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%，中国证监会规定的特殊品种除外；（8）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%；（9）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且在本基金托管人处托管的全部证券投资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%；（10）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。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；（11）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；（12）本基金投资于现金、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%；（13）本基

金投资于现金、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不得低于 10%；（14）本基金投资于到期日在 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%。（15）中国证监会、中国人民银行规定的其他限制。本基金在基金合同生效后六个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在 10 个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。对于法律法规要求的强制性规定，当法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金将相应修改投资组合限制规定。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基金合同生效之日起开始。法律法规另有规定的除外。

五、基金财产的保管 5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

五、基金财产的保管 5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行或交易/登记结算机构扣收结算费和账户维护费等费用）。

六、指令的发送、确认及执行 1. 指令的发送基金管理人应于划款前 1 个工作日向基金托管人发送指令并确认。对于要求当天到账的指令，必须在当天 15:30 前向基金托管人发送，15:30 之后发送的，基金托管人尽力执行，但不能保证划账成功。如果要求当天某一时点到账的指令，则指令需要提前 2 个工作小时发送，并相关付款条件已经具备。基金托管人将视付款条件具备时为指令送达时间。对新股申购网下发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T 日)的前一工作日下班前将指令发送给基金托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00。

2. 指令的确认基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证有关内容及印鉴和签名，如有疑问必须及时通知基金管理人。

六、指令的发送、确认及执行 1. 指令的发送基金管理人应于划款前 1 个工作日向基金托管人发送指令并确认。对于要求当天到账的指令，必须在当天 15:30 前向基金托管人发送，15:30 之后发送的，基金托管人尽力执行，但不能保证划账成功。如果要求当天某一时点到账的指令，则指令需要提前 2 个工作小时发送，并相关付款条件已经具备。基金托管人将视付款条件具备时为指令送达时间。对新股申购网下发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T 日)的前一工作日下班前将指令发送给基金

托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00。对于中国证券登记结算有限责任公司实行 T+0 非担保交收的业务，基金管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至托管人。因基金管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中登公司所造成的损失由基金管理人承担，包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与人最低备付金带来的利息损失。基金管理人应确保基金托管人在执行指令时，基金资金账户有足够的资金余额，在基金资金头寸充足的情况下，基金托管人对基金管理人符合法律法规、《基金合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。

2. 指令的确认基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证指令的要素是否齐全，并将指令所载签字和印鉴与授权通知进行表面真实性及权限范围核对，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。有关内容及印鉴和签名，如有疑问必须及时通知基金管理人。

七、交易及清算交收安排

(二) 基金投资证券后的清算交收安排

七、交易及清算交收安排增加一条：实行场内 T+0 交收的资金清算按照基金托管人的相关规定流程执行。

(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

2. 估值方法 (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，并披露临时报告。

(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

2. 估值方法 (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负偏离度的绝对值达到 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。

2016 年 8 月 25 日星期四 B51Disclosure 信息披露 zqsb@stcn.com(0755)83501750