

# 关于修改嘉实活期宝货币市场基金合同及托管协议的公告

关于修改嘉实活期宝货币市场基金合同及托管协议的公告

## 一、本次修改的基本情况

《货币市场基金监督管理办法》由中国证监会、中国人民银行于2015年12月17日颁布，并于2016年2月1日正式实施。为适应监管要求，推动产品持续良性发展，我司对嘉实活期宝货币市场基金的基金合同、托管协议等法律文件在基金投资范围、投资限制、申购赎回限制条款等方面根据《管理办法》进行了相应调整。嘉实基金管理有限公司作为上述货币市场基金的管理人，已与嘉实活期宝货币的托管人就基金合同、托管协议等的修改达成一致，并报中国证监会备案。

## 二、基金合同的修订情况

基于上述调整，本公司将对本基金的基金合同中涉及的相关内容进行修订，具体修订内容详见附件《〈嘉实活期宝货币市场基金基金合同〉按〈货币市场基金监督管理办法〉修订对照表》。

## 三、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，不需召开基金份额持有人大会。本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

2、本公告仅对本基金根据法律法规修订有关事项予以说明。基金管理人将在本公告发布当日，将修改后的基金合同、托管协议登载于本公司网站，将在更新的基金招募说明书中，对涉及上述修订的内容进行相应更新。本基金基金合同的修改详见附件《〈嘉实活期宝货币市场基金基金合同〉按〈货币市场基金监督管理办法〉修订对照表》，托管协议涉及基金合同相关变动处一并修改。

3、投资者在销售机构办理本基金的投资事务，具体办理规则及程序请遵循销售机构的规定。

投资者可以通过拨打本公司客服热线（400-600-8800）或登录本公司网站（[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)）获取相关信息。

特此公告

嘉实基金管理有限公司

2016年9月7日

附件：《〈嘉实活期宝货币市场基金基金合同〉按〈货币市场基金监督管理办法〉  
修订对照表》

《嘉实活期宝货币市场基金基金合同》按《货币市场基金监督管理办法》修订对照表

章节 原《嘉实活期宝货币市场基金基金合同》版本 修订后《嘉实活期宝货币市场基金基金合同》版本 修改理由

内容 内容

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》”）、《货币市场基金管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《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》”）和其他有关法律、法规。

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》

（以下简称“《管理办法》”）、《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》”）和其他有关法律法规。

根据法律修订的实际情况调整。

三、嘉实活期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。

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。

三、嘉实活期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。

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。

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。

根据《货币市场基金监督管理办法》补充相关内容。

第二部分 释义 9、《基金法》：指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013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

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

9、《基金法》：指2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过；2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起施行并根据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》修正的《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

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；

13、《管理办法》：指中国证监会、中国人民银行2015年12月17日颁布，

2016年2月1日实施的《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

根据法律修订的实际情况调整。

第二部分 释义 52、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。 53、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，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》调整表述。

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。

法律法规另有规定时，从其规定。

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，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。 根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》调整相关内容

第六部分 基金份额的申购与赎回 四、申购与赎回的程序

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以办理时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构不晚于T+1日对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。若申购不成功或无效，则申购款项(不含利息)退还给投资人。

四、申购与赎回的程序

3、申购和赎回申请的确认

投资人交付申购款项并由登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请并由登记机构确认赎回时，赎回生效。基金管理人应以办理时间结

束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金注册登记机构不晚于T+1日对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。若申购不成功或无效,则申购款项(不含利息)退还给投资人。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》完善表达。

#### 六、申购份额与赎回金额的计算方式

2、本基金不收取申购费用和赎回费用。

#### 六、申购份额与赎回金额的计算方式

2、本基金不收取申购费用和赎回费用,但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,本基金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。

根据《货币市场基金监督管理办法》补充。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

(一)发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

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。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

(一)发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

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;为了保护基金份额持有人的合法权益,基金管理人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。

(二)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,基金管理人应当暂停接受投资人的申购申请并根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。

根据《货币市场基金监督管理办法》补充。

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

无 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

(二) 发生本基金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% 的情形时, 基金管理人有权暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算。基金管理人应当在实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

根据《货币市场基金监督管理办法》补充。

#### 九、巨额赎回的认定及处理方式

##### 2、巨额赎回的处理方式

#### 九、巨额赎回的认定及处理方式

##### 2、巨额赎回的处理方式

(3) 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, 基金管理人可以参照上述第 (2) 款的规定延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项。

根据《货币市场基金监督管理办法》补充。

### 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

名称: 嘉实基金管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元

法定代表人: 安奎

设立日期: 1999 年 3 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基字[1999]5 号文

组织形式: 有限责任公司(中外合资)

注册资本: 壹亿伍仟万元人民币

存续期限: 持续经营

联系电话: 010-65215588

#### 一、基金管理人

#### (一) 基金管理人简况

名称: 嘉实基金管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元

法定代表人: 邓红国

设立日期：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]5 号文

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：010-65215588

更新基金管理人的简况

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司 二、基金托管人

### （一）基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司 更新基金托管人的简况

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

成立时间：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：国发[1979]056 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 32,479,411.7 万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】23 号

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 32,479,411.7 万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】23 号

## 第八部分基金份额持有人大会 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自报请中国证监会备案之日起生效或监管机关无异议



之日起生效。

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。该表决通过之日为基金份额持有人大会计票完成且计票结果符合法律法规和基金合同规定的决议通过条件之日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》修订。

### 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报中国证监会备案后方可执行；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人向中国证监会备案后 2 日内在指定媒体公告；

#### 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报中国证监会备案；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；

根据《公开募证券投资基金运作管理办法》修订

##### （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报中国证监会备案后方可执行；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人向中国证监会备案后 2 内在指定媒体公告；

##### （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报中国证监会备案；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；

根据《公开募证券投资基金运作管理办法》修订

##### （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议报请中国证监会备案后 2 日内在指定媒体上联合公告。

(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》修订

第十一部分基金份额的登记 四、基金登记机构的义务

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、基金登记机构的义务

3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；根据《基金法》修改

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，包括现金，通知存款，短期融资券，超短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，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，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

二、投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许基金投资的金融工具，包括：现金；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；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；以及中国证监会、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。

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货币市场工具的，在不改变基金投资目标、基金风险收益特征的前提下，本基金可参与投资，不需要召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按照届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。根据《货币市场基金监督管理办法》修订。

1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票。
- (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。

(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。

1、本基金不得投资于以下金融工具：

(1) 股票。

(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) 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。

(6) 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。根据《货币市场基金监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》修订。

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) 除发生巨额赎回的情形外，货币市场基金的投资组合中，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%。

(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) 本基金投资于定期存款（不包括有存款期限，但根据协议可以提前支取且没有利息损失的银行存款）的比例不得超过基金资产净值的 30%；

(7) 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%。

(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%；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。

（9）法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门调整上述限制，则本基金投资将按照调整后的规则执行。

因证券市场波动、证券发行人合并、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。

## 2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）货币市场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；

（3）存放在具有基金托管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%；存放在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，合计不得超过基金资产净值的 5%；

（4）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；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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在每个交易日均不得超

过基金资产净值的 20%。

(9) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

(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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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。

(11) 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%。

(12) 中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

除上述第(5)条以及其他另有约定外，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，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。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。根据《货币市场基金监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》修订。

#### 4、投资组合平均剩余期限的计算

(1) 平均剩余期限（天）的计算公式如下：

—

其中：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、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）正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

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。

(2) 各类资产和负债剩余期限的确定

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成交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。根据协议可提前支取且没有利息损失的银行协议存款，若协议中约定提前 N 天通知支取，则其剩余期限按 N 天计算。

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；银行通知存款的剩余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；允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售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。

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。

4、投资组合平均剩余期限的计算

(1) 平均剩余期限（天）的计算公式如下：

-

(2) 平均剩余存续期限（天）的计算公式如下：

其中：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、同业存单、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）正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

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。

### （3）各类资产和负债剩余期限及剩余存续期的确定

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) 一年以内(含一年)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) 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和剩余存续期限。

9) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。

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》补充。

第十四部分基金资产估值 四、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，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，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前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

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”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，可按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。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偏离度的绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。

#### 四、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，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，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前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

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的绝对值调整到 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。根据《货币市场基金监督管理办法》修订。

根据《货币市场基金监督管理办法》修订。

第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息



(六) 临时报告

11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

五、公开披露的基金信息

(六) 临时报告

11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁； 根据《基金法》补充。

26、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度绝对值达到或超过 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正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.25%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%的情形；

27、本基金遇到极端风险情形，基金管理人及其股东使用固有资金从本基金购买相关金融工具；

根据《货币市场基金监督管理办法》补充。