

## 兴业基金管理有限公司关于修改兴业鑫天盈货币市场基金基金合同及托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（主席第23号令）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会第104号令）、《证券投资基金销售管理办法》（证监会第91号令）、《货币市场基金监督管理办法》（证监会第120号令）、《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）等法律法规的规定及“兴业鑫天盈货币市场基金”（以下简称“本基金”）的基金合同和托管协议的约定，经基金托管人招商银行股份有限公司与基金管理人兴业基金管理有限公司协商一致，并报请中国证券监督管理委员会备案，双方同意对本基金的基金合同及托管协议的相关内容进行了相应修订。

现根据《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）（证监会第19号令）、《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〉》，将相关情况公告如下：

### 一、兴业鑫天盈货币市场基金基金合同修改内容

#### 1、“第一部分 前言”下“一、2”中：

“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》’）、《货币市场基金管理暂行规定》、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》、《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〉》和其他有关法律法规。”修订为：

“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〉》和其他有关法律法规。”

#### 2、“第一部分 前言”下“三”中：

增加“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，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。”

#### 3、“第二部分 释义”下“46”中：

“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”修订为：

“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”

#### 4、“第二部分 释义”下“46”下：

增加：“47、影子定价：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’”；并调整后续序号。

#### 5、“第六部分 基金份额的申购与赎回”下“五、3”下：

增加“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。”；并调整后续序号。

#### 6、“第六部分 基金份额的申购与赎回”下“六、1”中：

“本基金不收取申购费用和赎回费用。”修订为：

“本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但当基金持有的现金、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，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的1%以上的赎回申请（超过基金总份额1%以上的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。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。”

7、“第六部分 基金份额的申购与赎回”下“六、2”中：

“本基金的申购、赎回价格为每份基金份额 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。”修改为：

“本基金的申购、赎回价格为每份基金份额 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（特殊情况下扣除赎回费用）。”

8、“第六部分 基金份额的申购与赎回”下“七、6”下：

“7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、基金达到总规模限额(如适用)且基金管理人未调整基金规模时。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。”修订为：

“7、某笔申购超过基金管理人公告的单笔申购上限。

8、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 0.5%时。

9、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

10、基金达到总规模限额(如适用)且基金管理人未调整基金规模时。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、10、11 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。”

9、“第六部分 基金份额的申购与赎回”下“八、3”下：

增加“4、为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，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。

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，基金管理人决定履行适当程序终止基金合同的。”并调整后序号。

10、“第六部分 基金份额的申购与赎回”下“八”中：

“发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。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。”修订为：

“发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。若出现上述第 6 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。”

11、“第六部分 基金份额的申购与赎回”中增加：

“十六、基金份额转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十七、基金管理人可在不违反相关法律法规、不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。”

12、“第七部分 基金合同当事人及权利义务”下“一”中：

“注册资本：5 亿元人民币”修订为：“注册资本：7 亿元人民币”

13、“第十二部分 基金的投资”下“二”中：

“本基金投资于以下金融工具：

(1) 现金；

(2) 通知存款；

(3) 短期融资券（包括超级短期融资券）；

(4) 1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；

(5) 期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；

(6) 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；

(7) 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；

(8) 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据；

(9) 期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称‘央行票据’）

(10) 中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。”修订为：

“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，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，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。”

14、“第十二部分 基金的投资”下“四”中：

“1、组合限制

(1) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

(2) 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%；

(3) 投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款除外；

(4) 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%；

(5) 通过买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；

(6) 存款银行仅限于有基金托管资格、基金销售业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。本基金存放在具有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%；

(7) 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%；

(8) 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；

(9) 持有的全部资产支持证券的市值不得超过基金资产净值的 20%；持有的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%；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%；

(10) 除发生巨额赎回的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应在 5 个交易日内进行调整；

(11) 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应具备下列条件之一：

(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)。

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。

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。

(12) 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。

(13) 本基金不得投资于以下金融工具

①股票和权证；

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、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

(14) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述 (10)、(11)、(12) 项外，由于证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。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。在上述期间内，本基金的投资范围、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。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(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；

(7) 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；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。”修订为：

### “1、组合限制

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) 债项信用等级在 AAA 级以下的企业债券、主体信用等级在 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；

(5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

- (2) 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) 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) 投资于固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但如果基金投资有存款期限，但协议中约定可以提前支取的银行存款，不受该比例限制；
- (5) 投资于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%；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，合计不得超过基金资产净值的 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，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%；
- (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 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%；
- (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%；
- (11) 本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级；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，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (12) 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；
- (13) 法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

除第(7)、(11)项外，由于市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。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。法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金的上述限制相应变更或取消。

本基金已经持有的金融工具及比例不符合新修订的《货币市场基金监督管理办法》规定的，应在新修订的《货币市场基金监督管理办法》施行之日起一年内调整；对于货币市场基金新投资的金融工具及比例，应自新修订的《货币市场基金监督管理办法》施行之日起即应符合要求。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (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；
- (7) 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；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。”

## 15、“第十二部分 基金的投资”中：

### “七、投资组合的平均剩余期限计算方法

#### (一) 计算公式

本基金按下列公式计算平均剩余期限：

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。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。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。

#### (二) 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。”修订为:

#### “七、投资组合的平均剩余期限和平均剩余存续期计算方法

##### (一) 计算公式

本基金按下列公式计算平均剩余期限:

本基金投资组合平均剩余存续期限的计算公式为:

其中:投资于金融工具产生的资产包括现金,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,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。

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。

##### (二) 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、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。

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和

剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。”

16、“第十四部分 基金资产估值”下“三、1”中：

“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，在剩余存续期内按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。”修订为：

“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。”

17、“第十四部分 基金资产估值”下“三、2”中：

“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。”修订为：

“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的负偏离度达到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自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，或者履行适当程序后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。”

18、“第十八部分 基金的信息披露”下“五、（六）”中：

“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百分之零点五的情形”修订为：

“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%时的情形；”

19、基金合同内容摘要涉及的部分也参照基金正文一并修改。

二、兴业鑫天盈货币市场基金托管协议修改内容

1、“一、基金托管协议当事人”下“（一）”中：

“注册资本：5亿元人民币”修订为：“注册资本：7亿元人民币”

2、“一、基金托管协议当事人”下“（二）”中：

删除了以下内容：

“经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。”

3、“二、基金托管协议的依据、目的和原则”下“（一）”中：

“本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称‘《基金法》’）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》’）、《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〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。”

修订为：

“本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称‘《基金法》’）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同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”下“（一）”中：

“基金托管人根据有关法律法规的规定以及基金合同的约定，对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等，进行严格监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。”修订为：

“基金托管人根据有关法律法规的规定以及基金合同的约定，对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等，进行严格监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。”

5、“三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”下“（一）”中：

“1. 本基金的投资范围为：

- 1) 现金；
- 2) 通知存款；
- 3) 短期融资券（包括超级短期融资券）；
- 4) 1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单；
- 5) 期限在1年以内（含1年）的债券回购；
- 6) 剩余期限在397天以内（含397天）的债券；
- 7) 剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；
- 8) 剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据；
- 9) 期限在1年以内（含1年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）
- 10) 中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：

- 1) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天；
- 2) 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%；
- 3) 投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的30%，有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款除外；
- 4) 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%；
- 5) 通过买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过397天；
- 6) 存款银行仅限于有基金托管资格、基金销售业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。本基金存放在具有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%；
- 7) 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%；
- 8) 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；
- 9) 持有的全部资产支持证券的市值不得超过基金资产净值的20%；持有的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%；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%;

10) 除发生巨额赎回的情形外, 债券正回购的资金余额在每个交易日不得超过基金资产净值的 20%; 因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的, 基金管理人应在 5 个交易日内进行调整;

11) 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应具备下列条件之一:

(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)。

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。

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。

12) 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。

13) 本基金不得投资于以下金融工具

①股票和权证;

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、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

14) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述 10)、11)、12) 项外, 由于证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准。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。在上述期间内, 本基金的投资范围、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。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(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;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资;

(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;

(7) 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;

(8) 法律、行政法规或者国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。”修订为:

“1. 本基金的投资范围为:

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, 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，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。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2. 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) 债项信用等级在 AAA 级以下的企业债券、主体信用等级在 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；
- (5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；
- (2) 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) 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) 投资于固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但如果基金投资有存款期限，但协议中约定可以提前支取的银行存款，不受该比例限制；
- (5) 投资于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%；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，合计不得超过基金资产净值的 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，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%；
- (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 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%；
- (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%；
- (11) 本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级；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，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (12) 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；
- (13) 法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

除第（7）、（11）项外，由于市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。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。法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金的上述限制相应变更或取消。

本基金已经持有的金融工具及比例不符合新修订的《货币市场基金监督管理办法》规定的，应在新修订的《货币市场基金监督管理办法》施行之日起一年内调整；对于货币市场基金新投资的金融工具及比例，应自新修订的《货币市场基金监督管理办法》施行之日起即应符合要求。

3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (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；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (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；
- (7) 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；
- (8) 法律、行政法规或者国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。”

6、“三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”下“(二)”中：

“1. 本基金的存款银行应是具有证券投资基金托管资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外基金投资人托管人资格的商业银行。

2. 单只基金投资定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；存放在具有基金托管资格的同一银行存款不得超过基金资产净值的 30%。

有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策，基金公司履行适当程序后，可相应调整投资组合限制的规定。”修订为：

“1. 投资于固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但如果基金投资有存款期限，但协议中约定可以提前支取的银行存款，不受该比例限制；

2. 投资于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%；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，合计不得超过基金资产净值的 5%；有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策，基金公司履行适当程序后，可相应调整投资组合限制的规定。”

7、“三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”下“(三)”中：

“（1）符合资格的存款银行，基金管理人应与存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》（以下简称《总体合作协议》），确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。”

修改为：

“（1）基金管理人应与存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》（以下简称《总体合作协议》），确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。”

三、重要提示

1、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，并在下期更新的《兴业鑫天盈货币市场基金招募说明书》中，对上述相关内容进行相应修改。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。

2、投资者可通过兴业基金管理有限公司客户服务电话：40000-95561；或登录本公司网站 [www.cib-fund.com.cn](http://www.cib-fund.com.cn) 了解详情。

四、风险提示

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，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。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。本公司提醒投资人在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资者投资基金时应认真阅读基金的基金合同、托管协议、招募说明书等文件。

本次修订不影响我公司及兴业鑫天盈货币市场基金已签署的全部法律文件的效力及其履行。

特此公告。

兴业基金管理有限公司

2016年10月28日