

# 关于修改泰达宏利活期友货币市场基金基金合同和托管协议的公告

泰达宏利活期友货币市场基金（以下简称本基金）基金份额持有人大会于2017年9月5日表决通过了《关于修改泰达宏利活期友货币市场基金投资范围及投资限制的议案》，对本基金投资范围及投资限制等内容进行了修订。依据本次持有人大会决议，相应修改本基金的基金合同如下：

## 一、修改方案要点

对《基金合同》修订对照表如下：

所属部分 《基金合同》原条款 《基金合同》修改后条款

### 第12章基金的投资 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、短期融资券，期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、中期票据、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。

### 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，期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单，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，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。

### 第12章基金的投资 四、投资限制

#### 1、组合限制

本基金不得投资于以下金融工具：

- （1）股票、权证、股指期货、流通受限证券；
- （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+以下的债券与中期票据、短期融资券；
- （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）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。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

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，不得超过该证券的10%；
- （3）同一机构发行的债券、中期票据、短期融资券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）存放在具有基金托管资格的同业商业银行的存款、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业商业银行的存款、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在每个交易日均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%；
- （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；

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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%；

(14) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

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；

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 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

A,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；

B,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；

(15) 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%；

(16) 法律、法规、基金合同规定的其他投资比例限制。

除上述（1）、（10）、（11）条外，由于市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合上述约定的，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。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。如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

本基金已经持有的金融工具及比例不符合新修订的《监督管理办法》规定的，应在新修订的《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《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) 向基金管理人、基金托管人出资；

(5) 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；

(6) 法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

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。四、投资限制

### 1、组合限制

本基金不得投资于以下金融工具：

(1)股票、权证、股指期货、流通受限证券；

- (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；
- (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。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。  
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，不得超过该证券的 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) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款、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在每个交易日均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%；
- (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；
- (11) 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%；
- (12) 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%；
- (13) 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%；
- (14) 法律、法规、基金合同规定的其他投资比例限制。

除上述（1）、（10）、（11）条外，由于市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合上述约定的，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。  
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。如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 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) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；

(6) 法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循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的同意，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。

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。

## 第 12 章 基金的投资 七、投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限计算方法

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）、银行定期存款、同业存单、债券、逆回购、中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、中期票据、短期融资券、或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。

### 七、投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限计算方法

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）、银行定期存款、同业存单、债券、逆回购、中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。

根据上述变更，泰达宏利基金管理有限公司与本基金托管人对本基金的托管协议进行相应修订；本基金的招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改。

### 二、重要提示：

- 1、本公司将在网站上公布经修改后的泰达宏利活期友货币市场基金基金合同及托管协议；
- 2、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

本公司客户服务电话：400-698-8888、010-66555662

本公司网站：[www.mfcteda.com](http://www.mfcteda.com)

### 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。投资者投资于本基金时应认真阅读该基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司

2017 年 9 月 9 日