

关于金鹰货币市场证券投资基金 修改基金合同及托管协议的公告

一、本次修改的基本情况

金鹰货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1444号文核准公开募集，基金合同于2012年12月7日正式生效。

2017年8月31日中国证监会发布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，为使本基金符合上述法规的要求，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报监管机构备案，金鹰基金管理有限公司决定于2018年3月31日起修改金鹰货币市场证券投资基金基金合同（以下简称《基金合同》）及金鹰货币市场证券投资基金托管协议（以下简称《托管协议》），具体修改内容请详见附件1《金鹰货币市场证券投资基金基金合同修改对照表》、附件2《金鹰货币市场证券投资基金托管协议修改对照表》。

二、重要提示

1. 本次修订属于按照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，无需召开基金份额持有人大会。

2. 本公司将于公告当日，将修改后的本基金《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站。

3. 本公告构成本基金招募说明书的补充，基金管理人将在届时更新招募说明书时一并更新以上内容。

4. 投资者可通过本基金管理人的网站：www.gefund.com.cn 或客户服务电话：400-6135-888 了解详情。

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。投资人投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。投资有风险，敬请投资人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。

附件1：《金鹰货币市场证券投资基金基金合同修改对照表》

附件2：《金鹰货币市场证券投资基金托管协议修改对照表》

金鹰基金管理有限公司

2018年3月24日

附件 1：金鹰货币市场证券投资基金基金合同的修订内容

章节	原文内容	修订后内容
<p>一、 前言</p>	<p>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》”)、《关于实施《货币市场基金监督管理办法》有关问题的规定》(以下简称“《实施规定》”)和其他有关法律法规。</p>	<p>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》”)、《关于实施《货币市场基金监督管理办法》有关问题的规定》(以下简称“《实施规定》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。</p>
<p>二、 释义</p>	<p>无</p>	<p>增加： 69、《流动性风险管理规定》</p>

		<p>：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>70、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p>
<p>七、 基金份额的申购与赎回</p>	<p>无</p>	<p>(五)申购和赎回的金额 增加：</p> <p>5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</p>
	<p>(六)申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、除本基金合同或法律法规另有规定外，</p>	<p>(六)申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但出现</p>

<p>本基金的申购费率和赎回费率均为 0%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。</p> <p>5、在本基金持有的现金、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低于 5%，且采用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为负的情形时，对当日单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过基金总份额 1% 以上的赎回申请收取 1% 的强制赎回费，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</p>	<p>以下情形之一时，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。</p> <p>(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下，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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>(2) 当本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50% 的，且本基金投资组合中现金、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 10% 且偏离度为负时，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、</p>
---	--

	外。	应收申购款等。
	无	<p>六、拒绝或暂停申购的情形增加：</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>（最后一段修改为：）</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、8、10 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。</p>
	无	(八)暂停赎回或延缓支付赎回

		<p>款项的情形 增加：</p> <p>6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</p>
		<p>(九) 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式增加：</p> <p>(4) 当基金发生巨额赎回，在单个持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 25%的情形下，基金管理人可以延期办理该单个持有人超过上一开放日基金总份额 25%的赎回申请,对于单个持有人未超过上一开放日基金总份额 25%的赎回申请，与当日其它赎回申请一起，按照上述 (1) (2) 方式处理。当日未获受理的赎回申请将与下一开放日的赎回申请一并处理，直到全部赎回为止。如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p>
<p>八 、基金合同当事人及权利义务</p>	<p>(一) 基金管理人简况 注册地址：广州市</p>	<p>(一) 基金管理人简况 注册地址：广东省广州市南沙区海滨路 171 号 11 楼自编</p>

	<p>天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层</p> <p>法定代表人：凌富华</p> <p>注册资本：贰亿伍仟万元</p>	<p>1101 之一 J79</p> <p>法定代表人：刘岩</p> <p>注册资本：5.1020 亿元</p>
	<p>(二)基金托管人</p> <p>法定代表人：王洪章</p> <p>注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元</p>	<p>(二)基金托管人</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元</p>
		<p>(六)投资限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制： 增加：</p> <p>(2) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时（基金管理人固有资金投资的基金份额不纳入测算范围），本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、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 30%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p>

(3) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时（基金管理人固有资金投资的基金份额不纳入测算范围），本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、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 20%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(14) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；

(15) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的

		<p>资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；</p> <p>(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合本条款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
	<p>(六)投资限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(9) 本基金持有的现金、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%；</p> <p>(10) 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五个交易日内</p>	<p>(六)投资限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>修改为：</p> <p>(9) 本基金持有的现金、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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>(10) 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五个交易日内到期</p>

	<p>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%；</p> <p>除上述第(1)条、第(5)条 4) 项、第(7)条外，因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例及基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 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。</p>	<p>的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>除上述第(7)条第 4) 项、第(9)、(16)、(17)条外，因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例及基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 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。</p>
<p>十五、部分基金资产估值</p>	<p>无</p>	<p>(六) 暂停估值的情形 增加：</p> <p>4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p>
<p>十九、基金的信息披露</p>	<p>无</p>	<p>(七)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 增加：</p> <p>5、基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险</p>

		<p>分析。</p> <p>6、基金管理人应当至少披露报告期末基金前 10 名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</p> <p>7、报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
	<p>(八)临时报告与公告</p> <p>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达到 0.5%的情形；</p>	<p>(八)临时报告与公告</p> <p>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达到 0.5%的情形；</p>

	无	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(八) 临时报告与公告 增加:</p> <p>27、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项的;</p>
--	---	--

二、金鹰货币市场证券投资基金托管协议的修订内容

章节	原文内容	修订后内容
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人</p> <p>注册地址: 广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元</p> <p>法定代表人: 凌富华</p> <p>注册资本: 贰亿伍仟万元</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>注册地址: 广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79</p> <p>法定代表人: 刘岩</p> <p>注册资本: 5.1020 亿元</p>
	<p>(二) 基金托管人</p> <p>法定代表人: 王洪章</p> <p>注册资本: 贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>法定代表人: 田国立</p> <p>注册资本: 贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>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》”)等有关法律法</p>	<p>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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险</p>

	<p>规、基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p>
	<p>无</p>	<p>（二）2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制： 增加：</p> <p>（2）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时（基金管理人固有资金投资的基金份额不纳入测算范围），本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、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 30%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>（3）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时（基金管理人固有资金投资的基金份额不纳入测算范围），本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交</p>

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20%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（14）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%；

（15）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；

（16）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合本条款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性

		<p>受限资产的投资；</p> <p>(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
	<p>(二) 2、基金的投资组合应遵循以下限制修改为：</p> <p>(9) 本基金持有的现金、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%；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>.....</p> <p>除上述第(1)条、第(5)条 4) 项、第(7)条外，因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规</p>	<p>(二) 2、基金的投资组合应遵循以下限制 修改为：</p> <p>(9) 本基金持有的现金、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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>(10) 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>.....</p> <p>除上述第(7)条第4)项、第(9)、(16)、(17)条外，因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合上述规定的比例及基金合同约定的投资比例的，基金</p>

	<p>定的比例及基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 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。</p>	<p>管理人应当在 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。</p>
	<p>无</p>	<p>增加： （八）基金管理人应当在每个交易日 10:00 前将本基金前一交易日前 10 名基金份额持有人合计持有比例等信息报送基金托管人，基金托管人依法履行投资监督职责。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>无</p>	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 增加： 4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>无</p>	<p>（三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序 1.职责 增加： （4）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认</p>

		后，基金管理人应当暂停基金估值的；
--	--	-------------------