

# 先锋基金管理有限公司关于先锋现金宝货币市场基金修订 基金合同、托管协议部分条款的公告

根据《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“《规定》”）及基金合同和托管协议的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，先锋基金管理有限公司决定对先锋现金宝货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同、托管协议进行修订。现将相关事宜公告如下：

## 一、基金合同和托管协议修订

基金合同、托管协议具体修订内容详见附件《先锋现金宝货币市场基金基金合同修改对照表》和《先锋现金宝货币市场基金托管协议修改对照表》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项，并已履行规定程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

二、上述基金合同、托管协议的修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。基金管理人将在届时更新本基金招募说明书时一并更新相关内容。

## 三、其他事项

1、投资者可通过以下途径咨询有关详情

先锋基金管理有限公司客户服务电话：400-815-9998

先锋基金管理有限公司网址：[www.xf-fund.com](http://www.xf-fund.com)

2、风险提示

（1）本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》，所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理基金申购、赎回业务产生一定影响，包括且不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购/赎回申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

(2) 基金管理人承诺以诚实信用、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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

附件一：《先锋现金宝货币市场基金基金合同修改对照表》

附件二：《先锋现金宝货币市场基金托管协议修改对照表》

先锋基金管理有限公司

二〇一八年三月二十四日

附件一：先锋现金宝货币市场基金基金合同修改对照表

修改章节	修改前	修改后
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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《监督管理办法》)、《关于实施&lt;货币市场基金监督管理办法&gt;有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号&lt;货币市场基金信息披露特别规定&gt;》等有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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《监督管理办法》)、《关于实施&lt;货币市场基金监督管理办法&gt;有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号&lt;货币市场基金信息披露特别规定&gt;》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>(以下简称“<u>《流动性风险管理规定》</u>”)等有关法律法规。</p>
	无	<p><u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过50%的除外。</u></p>
第二部分 释义	无	<p><u>13、《流动性风险管理规定》：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</u></p>
	无	<p><u>55、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）、停牌股</u></p>

		<p><u>票、流通受限的新股及非公开发行股票、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；就本基金而言，指货币市场基金依法可投资的符合前述条件的资产，但中国证监会认可的特殊情形除外</u></p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与 赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制 无</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制 <u>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。</u></p>
	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金一般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，<u>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</u>，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（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财产。<u>基金管理人</u>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>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金一般情况下不收取申购费用和赎回费用。<u>但出现以下情形之一</u>，在满足相关流动性风险管理要求的前提下，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（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财产： <u>（1）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；</u> <u>（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%，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；</u> 基金管理人</p>

		<p>认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。</p>
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 5、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。……</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、<del>11</del>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 5、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<u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响</u>时。 …… <b>11、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。</b> <b>12、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暂停接受基金申购申请的措施。</b></p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、<b>12、13</b>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>
	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 无</p> <p>发生上述第 1、2、3、4、6、7、8情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 <b>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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</b></p> <p>发生上述第 1、2、3、4、6、7、<b>8、9</b>情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回</p>

	<p>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 5 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。</p>	<p>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 5 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。</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 (2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理且无优先权，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</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 (2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。<b><u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的</u></b>赎回申请，应当按单个账户<b><u>非自动延期办理的</u></b>赎回申请量占<b><u>非自动延期办理的</u></b>赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理且无优先权，以此类推，直到全部赎回为</p>

		止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。
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 …… 注册资本： <del>10,000 万元人民币</del>	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 …… 注册资本： <u>15,000 万元人民币</u>
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、本基金不得投资于以下金融工具： (1) 股票、股指期货、国债期货； (2) 可转换债券、可交换债券； (3) 剩余期限超过 397 天的债券； (4) 信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具； (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外； (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) 流通受限证券； (8) 权证； (9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。  2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制： <del>(10) 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%；</del> <del>(11) 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%；</del>	四、投资限制 1、本基金不得投资于以下金融工具： (1) 股票、股指期货、国债期货； (2) 可转换债券、可交换债券； (3) 剩余期限超过 397 天的债券； (4) 信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具； (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外； (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) 流通受限证券； (8) 权证； (9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。 <u>本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。</u> 2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制： <u>(2) 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%；</u> <u>(3) 本基金根据基金份额持有人集中度情况对上述第 (1)、(2) 项投资组合实施调整，并遵守以下要求：</u> <u>1) 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</u>

		<p><u>的 50%时,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%;</u></p> <p><u>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 20%时,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%;</u></p> <p><u>(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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p> <p><u>(13) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于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%;</u></p> <p><u>(14) 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;</u></p> <p><u>(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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基金不符合前</u></p>
--	--	---

	<p>除上述第（1）、<del>（9）</del>条外，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的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>	<p><u>述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>（16）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；</u>  除上述第（1）、<u>（11）、（15）、（16）</u>条外，由于证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动、<u>基金份额持有人赎回</u>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的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形  1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；  2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；  3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形  1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；  2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；  <u>3、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；</u>  4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息  （五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告  基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介。基金年度报告的财务会</p>	<p>五、公开披露的基金信息  （五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告  基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介。基金年度报告的财务会</p>

	<p>计报告应当经过审计。  基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介。  基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介。  基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。  基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>计报告应当经过审计。  基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介。  基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介。  基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。  基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。  <u>本基金持续运作过程中，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分析等。</u>  <u>基金运作期间，如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，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在定期报告“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。</u>  <u>基金管理人应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u></p>
<p>五、公开披露的基金信息  （六）临时报告  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</p>	<p>五、公开披露的基金信息  （六）临时报告  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</p>	<p>五、公开披露的基金信息  （六）临时报告  <u>30、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；</u></p>

	值达到 <del>0.25%</del> 或正负偏离度绝对值达到 0.50% 的情形；	<b>31、本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单；</b>
--	---	---

附件二：先锋现金宝货币市场基金托管协议修改对照表

修改章节	修改前	修改后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>(一) 基金管理人 ..... 注册资本：<del>10,000</del> 万元人民币</p> <p>(二) 基金托管人 ..... 经营范围：..... 保险兼业代理业务（有效期至 <del>2017 年 02 月 18 日</del>）；.....</p>	<p>(一) 基金管理人 ..... 注册资本：<u>15,000</u> 万元人民币</p> <p>(二) 基金托管人 ..... 经营范围：..... 保险兼业代理业务（有效期至 <u>2020 年 02 月 18 日</u>）；.....</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 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》”)、《货币市场基金监督管理办法》(以下简称《监督管理办法》)、《关于实施&lt;货币市场基金监督管理办法&gt;有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号&lt;货币市场基金信息披露特别规定&gt;》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 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》”)、《货币市场基金监督管理办法》(以下简称《监督管理办法》)、《关于实施&lt;货币市场基金监督管理办法&gt;有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号&lt;货币市场基金信息披露特别规定&gt;》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(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： 基金的投资组合应遵循以下限制： 1、本基金不得投资于以下金融工具： (1) 股票、股指期货、国债期货； (2) 可转换债券、可交换债券； (3) 剩余期限超过 397 天的债券； (4) 信用等级在 AA+ 级以下的债</p>	<p>(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： 基金的投资组合应遵循以下限制： 1、本基金不得投资于以下金融工具： (1) 股票、股指期货、国债期货； (2) 可转换债券、可交换债券； (3) 剩余期限超过 397 天的债券； (4) 信用等级在 AA+ 级以</p>

	<p>券与非金融企业债务融资工具；  (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外；  (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) 流通受限证券；  (8) 权证；  (9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：  <del>(10) 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%；</del>  <del>(11) 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%；</del></p>	<p>下的债券与非金融企业债务融资工具；  (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外；  (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) 流通受限证券；  (8) 权证；  (9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p><u>本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。</u></p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：  <u>(2) 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%；</u>  <u>(3) 本基金根据基金份额持有人集中度情况对上述第 (1)、(2) 项投资组合实施调整，并遵守以下要求：</u>  <u>1) 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，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%；</u>  <u>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 20% 时，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</u></p>
--	---	---

	<p>除上述第（1）、<del>（9）</del>条外，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的，基金管理</p>	<p><u>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%；</u></p> <p><u>（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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p><u>（13）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于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%；</u></p> <p><u>（14）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；</u></p> <p><u>（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的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基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>（16）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；</u></p> <p>除上述第（1）、<u>（11）</u>、<u>（15）</u>、<u>（16）</u>条外，由于证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动、<u>基金份额持有人赎回</u>等基金</p>
--	---	--

	<p>人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>	<p>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的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(四) 暂停估值的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</li> <li>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</li> <li>3、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</li> </ol>	<p>(四) 暂停估值的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</li> <li>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</li> <li><b><u>3、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；</u></b></li> <li>4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</li> </ol>