

西部利得基金管理有限公司关于西部利得天添益货币市场证券投资 基金修改基金合同的公告

公告送出日期：2018年3月26日

根据中国证券监督管理委员会于2017年8月31日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（证监会公告[2017]12号），经与基金托管人宁波银行股份有限公司协商一致并报中国证监会上海证监局备案，西部利得基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对西部利得天添益货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）的《西部利得天添益货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行调整，并更新基金管理人信息，现将具体事宜公告如下：

一、《基金合同》的修改内容

本基金《基金合同》修改事项属于因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改，且其他相应修改对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不属于法律法规规定或《基金合同》约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项。《基金合同》的具体修改内容如下：

| 章节 | 原文条款 | 修改后条款 |
|------------|--|--|
| 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》”）、《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》”）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》”）、 <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>《流动性规定》</u> ”）、《货币市场基金监督管理办法》（以下简称“《管理办法》”）和其他有关法律法规。 |
| 第二部分 | 无 | 13、《流动性规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施 |

| | | |
|----------------|---|--|
| 释义 | | <p>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>63、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> |
| 第六部分基金份额的申购与赎回 | <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p> | <p>五、申购和赎回的数量限制</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>1、本基金不收取申购费用，在通常情况下不收取赎回费用。</p> <p>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，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</p> <p>1、本基金不收取申购费用，在通常情况下不收取赎回费用。但为确保基金平稳工作，避免诱发系统性风险，本基金可对以下情形征收强制赎回费用：</p> <p><u>(1) 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。</u></p> <p><u>(2) 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></p> <p>出现上述任一情形时，本基金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基金利益最大化的情形除外。</p> |
| | 七、拒绝或暂停申购的情形 | 七、拒绝或暂停申购的情形 |

| | | |
|--|--|--|
| | <p>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。……</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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</p> <p>9、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>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。……</p> |
| | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>无</p> | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>7、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</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>（2）部分延期赎回：……</p> <p>无</p> | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>（2）部分延期赎回：……</p> <p>若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以办理延期办理赎回申请。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。对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，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，对于当日的赎回申请，按单个账</p> |

| | | |
|---------------------------|---|--|
| | | <p>户赎回申请量占赎回申请总量的比例支付当日的赎回款项。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，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>第十二部分 基金的投资</p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 基金的投资组合应遵循以下限制： 7) 本基金需保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定：</p> <p>①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>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%；</p> <p>③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%；</p> <p>……</p> <p>除上述第 1)、第 7) 的①项和第 8) 项外，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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 基金的投资组合应遵循以下限制： 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%；</p> <p>3) 根据本基金基金份额持有人的集中度，对上述投资组合实施如下调整： 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 30%； 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 20%；</p> <p>9) 本基金需保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定：</p> <p>①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>12) 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%；</p> |

| | | |
|-----------------------|-------------------------------------|--|
| | | <p><u>因证券市场波动、证券停牌、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；</u></p> <p><u>13) 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%；</u></p> <p><u>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>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%；</u></p> <p><u>15) 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基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p>除上述第 1)、第 9) 的①项和第 10)、12)、15) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、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因素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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> |
| | <p>2、禁止行为</p> <p>.....</p> <p>无</p> | <p>2、禁止行为<u>及特殊交易</u></p> <p>.....</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>第十四部分 基金资产</p> | <p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p> | <p>六、暂停估值的情形</p> <p><u>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一致</u></p> |

| | | |
|------------------|--|---|
| 估值 | | 的； |
| 第十八部分 基金的信息披露 | <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p> <p>……</p> <p>无</p> | <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p> <p>……</p> <p><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></p> <p><u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p> <p><u>本基金应当在年度报告、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>(六) 临时报告</p> <p>18、以“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或超过 0.25%，或正偏离度绝对值达到或超过 0.5%；</p> | <p>(六) 临时报告</p> <p>18、以“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正负偏离度绝对值达到或超过 0.5%；</p> <p><u>29、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时；</u></p> <p><u>30、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时；</u></p> |

*基金合同内容摘要部分、托管协议涉及上述内容的一并修改；

二、重要提示

1、为不影响原有基金份额持有人的利益，本次修订后的《基金合同》将自 2018 年 3 月 31 日起正式实施。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的本基金基金合同及托管协议；招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改。

3、投资者可拨打本公司客户服务电话（4007-007-818）或登陆本公司网站（www.westleadfund.com）咨询相关事宜。

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。敬请投资人留意投资风险。

特此公告。

西部利得基金管理有限公司
2018年3月26日