

东兴安盈宝货币市场基金托管协议 修改对照表

章节	原条款	新条款	修改理由
基金托管协议的依据、目的和原则	<p>(一) 订立托管协议的依据</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》、《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〉》、《东兴安盈宝货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</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》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性管理规定》”)</u>、《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》、《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〉》、《东兴安盈宝货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。</p>	增加《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为托管协议的依据
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(二)</p> <p>1. 组合限制</p> <p>(1)本基金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;</p> <p>(10)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>④除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以</p>	<p>(二)</p> <p>1. 组合限制</p> <p>(1) <u>除基金合同另有约定外</u>,本基金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;</p> <p>(10)③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</p>	<p>完善表述</p> <p>增加流动性受限资产投资限制、逆回购交易风险管理</p>

章节	原条款	新条款	修改理由
	<p>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%。</p> <p>除上述第（8）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。</p>	<p>不得超过 20%。</p> <p>增加：</p> <p><u>（12）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>（13）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></p> <p><u>（14）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>（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；</u></p> <p><u>（16）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计</u></p>	

章节	原条款	新条款	修改理由
		<p><u>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>(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；</u></p> <p>除上述第 (1)、第 (8)、第 (10) 的①、第 (16)、第 (17) 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。</p>	
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(二)</p> <p>2. 本基金不得投资于以下金融工具：</p>	<p>(二)</p> <p>2.本基金不得投资于以下金融工具： 增加： <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> <u>基金管理人应当在每个交易日 10:00 前将货币市场基金前一交易日前 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</u></p>	<p>增加投资限制</p>

章节	原条款	新条款	修改理由
基金资产净值计算和会计核算	(四) 暂停估值的情形	职责。 (四) 暂停估值的情形 增加： 3. <u>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>	增加极端情形下暂停估值的情形