

# 东吴基金管理有限公司关于修改东吴货币市场证券投资基金基金合同、托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》）等法律法规和《东吴货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同或《基金合同》）的有关规定，为保护投资者利益，东吴基金管理有限公司（以下简称本公司）经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案，对东吴货币市场证券投资基金（以下简称本基金）的基金合同、托管协议相关内容进行修订。

现将具体事项公告如下：

## 一、基金合同的修订内容

根据 2017 年 10 月 1 日起实施的《流动性风险管理规定》，本公司对本基金基金合同和托管协议的相关内容进行了修订，具体修改内容请见附件修改前后条款对照表。本次修订对是因相应的法律法规发生变动而进行的，不需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会上海监管局备案。基金合同和托管协议的具体修订内容详见附件。本次修改后的基金合同、托管协议将于 2018 年 3 月 31 日起正式施行。

## 二、重要提示

- 1、本次修改遵照法律法规、中国证监会的相关规定和基金合同的约定执行，可不经基金份额持有人大会表决。
- 2、本基金管理人将在指定媒介上公布经修改后的基金合同和托管协议。本基金管理人将在更新基金招募说明书时，对上述相关内容进行相应修订。
- 3、投资者可登录本基金管理人网站（[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-821-0588、021-50509666）进行咨询、查询。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并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。

东吴基金管理有限公司

二〇一八年三月二十六日

附件 1:《东吴货币市场证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

附件 2:《东吴货币市场证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表

附件 1:《东吴货币市场证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

章节 原表述 修改后表述

### 一、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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国合同法》、《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》）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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国合同法》、《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》）、《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

动性规定》)和其他有关法律法规。

二、释义 增加《流动性风险规定》的释义：

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

二、释义 增加流动性受限资产的释义：

62、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，但中国证监会认可的特殊情形或另有规定的除外

七、基金份额的申购与赎回（五）、申购和赎回的金额

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，具体规定请参见相关公告。

七、基金份额的申购与赎回（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

5、本基金的申购费率和赎回费率均为 0%。本基金的申购费率、赎回费率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。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

5、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金的申购费率和赎回费率均为 0%。本基金的申购费率、赎回费率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。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。

6、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，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财产。

七、基金份额的申购与赎回（七）拒绝或暂停申购的情形

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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；

七、基金份额的申购与赎回（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

5、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

七、基金份额的申购与赎回（九）巨额赎回的情形及处理方式

（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）

全额赎回或（2）部分延期赎回方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

#### 八、基金合同当事人及权利义务 (一)基金管理人

法定代表人：徐建平 (一)基金管理人

法定代表人：王炯

#### 八、基金合同当事人及权利义务 (二)基金托管人

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

注册资本：2600 亿元人民币

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 (二)基金托管人

法定代表人：周慕冰

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

组织形式：股份有限公司

### 十三、基金的投资

#### (七)投资限制

##### 1、组合限制

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除第(3)、(11)和(12)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

#### (七)投资限制

##### 1、组合限制

(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%；

(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%；

(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；

(17) 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；

(18) 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%。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除第(3)、(11)、(12)、(16)和(17)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

### 十三、基金的投资

#### (七)投资限制

##### 2、本基金不得投资于以下金融工具：

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。

#### 十五、基金资产的估值 (七) 暂停估值的情形

5、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后，基金管理人应当暂停基金估值；

#### 十九、基金的信息披露 (五) 公开披露的基金信息

##### 7、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

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，为保障其他投资者利益，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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，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分析等。

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。

#### 十九、基金的信息披露 8、临时报告

##### 8、临时报告

(27) 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(28) 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；

附件 2:《东吴货币市场证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表

章节 原表述 修改后表述

#### 一、基金托管协议当事人 (一) 基金管理人

法定代表人：徐建平 (一) 基金管理人

法定代表人：王炯

#### 一、基金托管协议当事人 (二) 基金托管人

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

邮政编码：100048

法定代表人：项俊波

注册资金：2600 亿元人民币 (二) 基金托管人

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

注册资本：32,479,411.7 万元人民币



## 二、基金托管协议的依据、目的和原则 (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》)等有关法律、法规(以下简称法律法规)、基金合同及其他有关规定制订。

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管理规定》等有关法律、法规(以下简称法律法规)、基金合同及其他有关规定制订。

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%; 本基金管理人管理的全部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%;

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,除第(3)、(11)、(12)

项外,基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%; 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部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%;

(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 个工作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%;

(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 个工作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%;

(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;

(17) 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;

(18) 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%。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,除第(3)、(11)、(12)、(16)和(17)项外,基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

## 八、基金资产净值计算和会计核算 (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(5) 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后,基金管理人应当暂停基金估值;