

---

## 华泰保兴基金管理有限公司

### 关于修改华泰保兴货币市场基金

### 基金合同、托管协议和招募说明书的公告

根据中国证监会2017年10月1日起施行的《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》”），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。

华泰保兴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，对旗下托管在中国银行股份有限公司的华泰保兴货币市场基金（以下简称“本基金”）的法律文件进行了修改。

本次修改系因相应的法律法规发生变动而进行的修改，且对原有基金份额持有人利益无实质不利影响，不需召开基金份额持有人大会。

本基金基金合同、托管协议和招募说明书的修改对照详见附件。修改后的基金合同、托管协议和招募说明书均已报监管机构备案。本公司将于公告当日，将修改后的本基金基金合同、托管协议和招募说明书登载于本公司官方网站。修改后的法律文件将于2018年3月31日起生效。

投资人可通过登录本公司官方网站（[www.ehuataifund.com](http://www.ehuataifund.com)），或拨打本公司客户服务电话 400-632-9090 咨询相关信息。

#### 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将来表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营情况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。基金投资有风险，敬请投资人认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金相关法律文件，关注基金的投资风险，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。

---

附件：华泰保兴货币市场基金基金合同、托管协议和招募说明书修改对照  
表

华泰保兴基金管理有限公司

2018年3月30日

附件：

## 华泰保兴货币市场基金基金合同、托管协议和招募说明书修改对照表

### 一、对基金合同主要修订内容、依据

章节	修订内容	修订依据
第一部分前言	增加： “《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》”）”的表述	将《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》”）纳入基金合同制订依据
第一部分前言	增加： “六、本基金单一投资者持有的基金份额数量不得超过或者超过本基金基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。”	根据《流动性风险管理规定》增加集中度要求
第二部分释义	增加： “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”	补充《流动性风险管理规定》的释义
第二部分释义	增加： “56、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	补充流动性受限资产的释义

	<p>有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、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”</p>	
<p><b>第六部分基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>“五、申购和赎回的数量限制”中，增加：</p> <p>“4、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>《流动性风险管理规定》第十九条第二款</p>
<p><b>第六部分基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”之“5、强制赎回费”中，增加：</p> <p>“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。”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第三十一条</p>
<p><b>第六部分基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>“七、拒绝或暂停申购的情形”中，增加：</p> <p>“2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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>8、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的50%，或者变相规避50%集中度的情形时。”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九条、第二十四条</p>

	<p>修改表述：</p> <p>“发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9 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介上刊登暂停申购公告。”</p>	
<p><b>第六部分基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”中，增加：</p> <p>“2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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。”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>
<p><b>第六部分基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>“九、巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”中，增加：</p> <p>“（4）如果基金发生巨额赎回，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，基金管理人可以延期办理赎回申请。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，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>《流动性风险管理规定》第二十一条（二）</p>
<p><b>第十二部分基金的投资</b></p>	<p>“二、投资范围”中，增加：</p> <p>“……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>《流动性风险管理规定》第十八条</p>

<p><b>第十二部分</b> <b>基金的投资</b></p>	<p>“四、投资限制”之“1、组合限制”中，增加： “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。”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第三十三条</p>
<p><b>第十二部分</b> <b>基金的投资</b></p>	<p>“四、投资限制”之“3、基金投资组合比例限制”中，调整并增加： “（6）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%； （10）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； （11）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； （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）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%，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>《流动性风险管理规定》第十七条、第十八条、第三十条、第三十二条、第三十三条、第三十四条、第四十条</p>

	<p>(17) 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%，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>(18) 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>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；</p> <p>(19) 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；</p> <p>除上述（1）、（10）、（12）、（18）、（19）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，但基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”</p>	
<p><b>第十四部分</b> <b>基金资产估值</b></p>	<p>“六、暂停估值的情形”中，增加：</p> <p>“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一致的，基金管理人应当暂停基金估值时；”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>
<p><b>第十八部分</b> <b>基金的信息披露</b></p>	<p>“五、公开披露的基金信息”之“（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”中，增加：</p> <p>“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。</p> <p>基金运作期间，报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条、第三十六条</p>

	<p>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。</p> <p>对于货币市场基金，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。”</p>	
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	<p>“五、公开披露的基金信息”之“（六）临时报告”中，增加：</p> <p>“30、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的；</p> <p>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；”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条、第三十三条</p>

## 二、对托管协议主要修订内容、依据

章节	修订内容	修订依据
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	<p>在“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之“1、对基金的投资范围、投资对象进行监督：”中，增加：</p> <p>“……，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>“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。”</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十八条</p> <p>《流动性风险管理规定》第三十三条</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核</b></p>	<p>在“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之“2、对基金投融资比例进行监督；”中，增加：</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十七条、第十八条、第三十</p>



查	<p>“（5）本基金管理人管理的且由本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%；</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>（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；</p> <p>（15）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%，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>（16）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%，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>（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</p>	<p>条、第三十二条、第三十三条、第三十四条、第四十条</p>
---	--	---------------------------------

	<p>基金资产净值的 10%；</p> <p>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；</p> <p>（18）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。本基金管理人承诺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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p> <p>除上述（1）、（9）、（11）、（17）、（18）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。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	
--	--	--

### 三、对招募说明书主要修订内容、依据

章节	修订内容	修订依据
<b>重要提示</b>	增加： “六、本基金单一投资者持有的基金份额数量不得超过或者超过本基金基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。”	根据《流动性风险管理规定》增加集中度要求
<b>一、绪言</b>	增加： “《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》”）”的表述	将《流动性风险管理规定》纳入招募说明书制订依据
<b>二、释义</b>	增加： “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	补充《流动性风险管理规定》的释义

	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： “56、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”	补充流动性受限资产的释义
八、基金份额的申购与赎回	“（四）申购和赎回的数额限定”中，增加： “4、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。”	《流动性风险管理规定》第十九条第二款
八、基金份额的申购与赎回	“（六）基金的申购费和赎回费”之第 2 条中，增加： “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。”	《流动性风险管理规定》第三十一条
八、基金份额的申购与赎回	“（八）拒绝或暂停申购的情形”之“1、发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：”中，增加： “（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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	《流动性风险管理规定》第十九条、第二十四条

	<p>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>（8）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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的50%，或者变相规避50%集中度的情形时。”</p> <p>修改表述：</p> <p>“发生上述第（1）、（2）、（3）、（5）、（6）、（7）、（8）、（9）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介上刊登暂停申购公告。”</p>	
<b>八、基金份额的申购与赎回</b>	<p>“（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”之“1、发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：”中，增加：</p> <p>“（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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。”</p>	《流动性风险管理规定》第二十四条
<b>八、基金份额的申购与赎回</b>	<p>“（十）巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”中，增加：</p> <p>“（4）如果基金发生巨额赎回，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，基金管理人可以延期办理赎回申请。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。”</p>	《流动性风险管理规定》第二十一条（二）

	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。”	
九、基金的投资	“（二）投资范围”中，增加： “……其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”	《流动性风险管理规定》第十八条
九、基金的投资	“（四）投资限制”之“1、组合限制”中，增加： “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。”	《流动性风险管理规定》第三十三条
九、基金的投资	“（四）投资限制”之“3、基金投资组合比例限制”中，调整并增加： “（6）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%； （10）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； （11）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； （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	《流动性风险管理规定》第十七条、第十八条、第三十条、第三十二条、第三十三条、第三十四条、第四十条

	<p>认定的其他品种；</p> <p>（16）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%，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>（17）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%，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>（18）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>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；</p> <p>（19）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；</p> <p>除上述（1）、（10）、（12）、（18）、（19）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，但基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”</p>	
<p><b>十二、基金资产的估值</b></p>	<p>“（六）暂停估值的情形”中，增加：</p> <p>“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</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>

	定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值时；”	
<b>十六、基金的信息披露</b>	<p>“（五）公开披露的基金信息”之“5、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”中，增加：</p> <p>“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。</p> <p>基金运作期间，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。</p> <p>对于货币市场基金，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。”</p>	《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条、第三十六条
<b>十六、基金的信息披露</b>	<p>“（五）公开披露的基金信息”之“6、临时报告”中，增加：</p> <p>“30、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的；</p> <p>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；”</p>	《流动性风险管理规定》第二十六条、第三十三条
<b>十七、风险揭示</b>	<p>增加：</p> <p>“（七）本基金投资市场、行业及资产的流动性风险评估</p> <p>本基金主要投资于货币市场工具等具有良好流动性的金融工具，资本市场成交活跃程度、基金持仓资产的变现能力以及投资者的申购/赎回行为将对本基金所面临的流动性风险产生直接影响。</p> <p>资本市场成交量低迷、基金持仓集中度过高、基金资产变现能力下降、单一基金份额持有人持有基金份额比例过高等因素，将使得本基金面临流动性风险。</p> <p>在本基金的投资运作过程中，基金管理人将充分评估本基金所面临的流动性风险，并根据基金合同的约定及实际情况，合理</p>	《流动性风险管理规定》第二十六条

	<p>采取控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请设定、单一投资者申购金额上限、综合运用延期办理巨额赎回申请等各类流动性风险管理工具、降低基金资产持仓集中度、降低流动受限资产投资比例等措施，有效防范本基金所面临的流动性风险。</p> <p>（八）本基金发生巨额赎回情形下的流动性风险管理措施</p> <p>在本基金发生巨额赎回的情形下，基金管理人将在与基金托管人协商一致，并在确保投资者得到公平对待的前提下，依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对巨额赎回申请等进行适度调整，作为本基金发生巨额赎回的特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。</p> <p>上述各类流动性风险管理工具包括但不限于：1、延期办理巨额赎回申请；2、暂停接受赎回申请；3、延缓支付赎回款项；4、收取短期赎回费；5、暂停基金估值；6、摆动定价；7、中国证监会认定的其他措施。</p> <p>在采用上述流动性风险管理工具时，基金管理人严格遵守法律法规及基金合同的约定，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。</p> <p>（九）实施备用的流动性风险管理工具的规定</p> <p>1、实施备用流动性风险管理工具的情形：在本基金发生巨额赎回的情形下，本基金管理人将实施备用流动性风险管理工具。</p> <p>2、实施备用流动性风险管理工具的程序：本基金管理人将在与基金托管人协商一致，并在确保投资者得到公平对待的前提下，依照法律法规及基金合同的约定实施备用流动性风险管理工具，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。</p> <p>3、实施备用流动性风险管理工具对投资者的影响：在实施备用流动性风险管理工具的情形下，可能会导致本基金份额持有人的部分或全部赎回申请被确认失败或者被收取短期赎回费。”</p>	
<p><b>十九、基金</b></p>	<p>根据托基金合同内容做相应修订</p>	<p>《流动性风险</p>



---

合同内容摘要		管理规定》
二十、托管协议内容摘要	根据托管协议内容做相应修订	《流动性风险管理规定》