

# 天弘基金管理有限公司关于天弘云商宝货币市场基金修订 基金合同部分条款的公告

根据中国证监会颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《规定》”）等法律法规及监管要求，天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人协商一致，对旗下天弘云商宝货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同部分条款进行修订，具体内容敬请投资者详见附件。

本次修订主要涉及基金合同中释义、基金的投资、申购与赎回、资产估值、信息披露等部分内容。同时，经与基金托管人协商一致，根据基金合同的修订内容，对本基金托管协议相应做出了调整。

## 重要提示：

1、本次系根据《规定》要求修订本基金的基金合同及托管协议，并按照相关法律法规的要求履行相应程序。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等法律文件，审慎进行投资决策。

本基金的招募说明书将根据法定时间要求，进行更新及披露。

2、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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》等相关法律文件。

3、投资者可登陆我公司官方网站（[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)）或拨打我公司客户服务热线（95046）进行详细咨询。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日

附件：《天弘云商宝货币市场基金基金合同》修订对照表

附件：

## 《天弘云商宝货币市场基金基金合同》修订对照表

所在部分	修改前内容	修改后内容
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>.....</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》”）、《货币市场基金管理暂行规定》、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</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》”）、《货币市场基金管理暂行规定》、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》、<u>《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》、<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>”）</u>和其他有</p>

		关法律法规。
第二部分 释义	.....	<p>.....</p> <p>13、<u>《流动性风险管理规定》</u>： 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（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>55、<u>流动性受限资产</u>：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（新增，以下序号顺延）</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>.....</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>4、<u>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</u></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和赎回费用。</p> <p>.....</p>	<p><u>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。具体请参见相关规定。（新增，以下序号顺延）</u></p> <p>.....</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和赎回费用，<u>但当本基金前 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，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，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 1%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资产。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。具体征收方法届时以基</u></p>
--	---	--

	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</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。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、4、6、7 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。如果投资</p>	<p><u>金管理人公告为准。</u></p> <p>.....</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</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。</p> <p><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接受投资人的申购申请。</u></p> <p>.....</p> <p><u>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的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。（新增，以下序号顺延）</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、4、6、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。如果投资</p>
--	--	--

	<p>人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。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</p> <p>.....</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。</p> <p>.....</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p>	<p>人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。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</p> <p>.....</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。<u>当前一开放日基金资产净值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投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</u></p> <p>.....</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p><u>(3)当基金出现巨额赎回时,在单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额10%的情形下,基金管理人认为支付</u></p>
--	---	---

		<p><u>该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出 10% 的赎回申请实施延期办理。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，具体参照上述（2）方式处理。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，以此类推，直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述（1）、（2）方式处理，具体见相关公告。（新增，以下序号顺延）</u></p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>一、基金管理人 ..... <u>住所：天津市河马区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层</u> .....</p>	<p>一、基金管理人 ..... <u>注册地址：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号</u> <u>办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层（新增）</u></p>

	<p>二、基金托管人</p> <p>.....</p> <p>法定代表人：<u>姜建清</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币</p> <p><u>349,018,545,827 元</u></p>	<p><u>邮政编码：300203（新增）</u></p> <p>.....</p> <p><u>经营范围：基金募集、基金销售、</u> <u>资产管理、从事特定客户资产管</u> <u>理业务、中国证监会许可的其他</u> <u>业务。（新增）</u></p> <p>.....</p> <p>二、基金托管人</p> <p>.....</p> <p>法定代表人：<u>易会满</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币</p> <p><u>35,640,625.71 万元</u></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>.....</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p><u>（1）当本基金前 10 名份额持有</u> <u>人的持有份额合计超过基金总</u> <u>份额的 50%时，本基金投资组合</u> <u>的平均剩余期限不得超过 60</u> <u>天，平均剩余存续期不得超过</u> <u>120 天；投资组合中现金、国债、</u> <u>中央银行票据、政策性金融债券</u> <u>以及 5 个交易日内到期的其他</u> <u>金融工具占基金资产净值的比</u> <u>例合计不得低于 30%；当本基金</u> <u>前 10 名份额持有人的持有份额</u></p>

	<p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天；</p> <p>.....</p>	<p><u>合计超过基金总份额的 20%时，</u>  <u>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>（新增）</p> <p><u>(2) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计未超过基金总份额的 20%时，</u>本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天；</p> <p>.....</p> <p><u>(5) 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>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。本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银</p>
--	--	---

		<p><u>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;(新增,以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(8) 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%; (新增, 以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(21) 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;(新增)</u></p> <p><u>(22) 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</u></p>
--	--	--

	<p>除上述 (6)、(13)、(14) 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，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>围保持一致；(新增，以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p>除上述 (2)、(9)、(16)、(17)、(21)、(22) 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，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>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>.....</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停估值；(新增，以下序号顺延)</u></p>
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>.....</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>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</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>(六) 临时报告</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p><u>基金管理人应在半年度报告、年度报告等文件中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。(新增)</u></p> <p><u>本基金应当在半年度报告、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。(新增)</u></p> <p><u>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定风险。(新增)</u></p> <p>(六) 临时报告</p> <p>.....</p> <p><u>27、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;(新增,以下序号顺延)</u></p>
--	---	---