



天治基金管理有限公司

CHINA NATURE ASSET MANAGEMENT CO., LTD.

天治基金管理有限公司关于天治天得利货币市场基金修改 基金合同的公告

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》，经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，天治基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下天治天得利货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同进行修改。本次部分修改系因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行的修改，且其他修改未对原有基金份额持有人的利益造成任何实质性不利影响，根据基金合同的约定，不需召开持有人大会。本基金的托管协议相应部分一并修改。本基金基金合同、托管协议的修改已向监管机构备案。具体修改内容请见附件。

修改后的基金合同、托管协议将登载于本公司网站，并于 2018 年 3 月 31 日起生效，2018 年 3 月 31 日之前仍按照修改前的基金合同、托管协议的约定运作。

本公司将在更新本基金的招募说明书时，对上述相关内容进行相应修改。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

天治基金管理有限公司网站：www.chinanature.com.cn

客户服务电话：400-098-4800、021-60374800

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

附件：天治天得利货币市场基金基金合同修改对照表

天治基金管理有限公司

2018年3月30日

附件：天治天得利货币市场基金基金合同修改对照表

章节	修改前	修改后	备注
第一部分 “前言”	<p>原表述：</p> <p>为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范天治天得利货币市场基金(以下简称“本基金”)运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《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》”)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称“《暂行规定》”)及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投</p>	<p>修改为：</p> <p>为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范天治天得利货币市场基金(以下简称“本基金”)运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《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》”)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称“《暂行规定》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以</p>	<p>增加《流动性风险管理规定》 作为订立基金合同的依据</p>

	<p>投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《天治天得利货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）。</p> <p>增加表述</p>	<p>以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《天治天得利货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）。</p> <p>增加： 本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的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。</p>	
<p>第二部分“释义”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加： 《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》； 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</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》 增加相关释义</p>

		<p>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>	
<p>第六部分“基金份额的申购与赎回”之“(五)申购与赎回的数额限制”</p>	<p>增加表述</p>	<p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告;</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九条关于“拒绝或暂停接受投资者申购的情形”</p>

		其余序号作相应调整	
第六部分“基金份额的申购与赎回”之“(六) 申购费用和赎回费用”	原表述： 本基金的申购和赎回费率为零。	修改为： 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金的申购和赎回费率为零。 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 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	《流动性风险管理规定》第三十一条关于“货币市场基金的强制赎回费”

		益最大化的情形除外。	
第六部分“基金份额的申购与赎回”之“(七) 申购份额与赎回金额的计算”	<p>原表述：</p> <p>本基金的基金份额申购、赎回价格为人民币 1.00 元。</p> <p>1、本基金申购份额的计算： $\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{基金份额申购价格}$</p> <p>2、本基金赎回金额的计算： 赎回金额的确定分两种情况处理：</p> <p>(1) 部分赎回</p> <p>1) 如果投资者账户当前累计收益为正时，不结转账户当前累计收益。 $\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{基金份额赎回价格}$</p> <p>2) 账户当前累计收益为负时，按赎回比例结转账户当前累计收益。 $\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{基金份额赎回价}$</p>	<p>修改为：</p> <p>本基金的基金份额申购、赎回价格为人民币 1.00 元。</p> <p>1、本基金申购份额的计算： $\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{基金份额申购价格}$</p> <p>2、本基金赎回金额的计算： 赎回金额的确定分三种情况处理：</p> <p>(1) 部分赎回且不收取赎回费</p> <p>1) 如果投资者账户当前累计收益为正时，不结转账户当前累计收益。 $\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{基金份额赎回价格}$</p> <p>2) 账户当前累计收益为负时，按赎回比例结转账户当前累计收益。 $\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{基金份额赎回价}$</p>	《流动性风险管理规定》第三十一条关于“货币市场基金的强制赎回费”

	<p>格+赎回份额对应的累计收益</p> <p>其中, 赎回份额对应的累计收益=(申请赎回的基金份额/账户基金总份额)×账户当前累计收益</p> <p>(2) 全部赎回</p> <p>赎回金额=赎回份额×基金份额赎回价格+当前累计收益</p> <p>赎回金额的计算结果保留到小数点后2位, 小数点2位以后的部分舍去, 舍去部分所代表的资产归基金财产所有。</p>	<p>格+赎回份额对应的累计收益</p> <p>其中, 赎回份额对应的累计收益=(申请赎回的基金份额/账户基金总份额)×账户当前累计收益</p> <p>(2) 全部赎回且不收取赎回费</p> <p>赎回金额=赎回份额×基金份额赎回价格+当前累计收益</p> <p>(3) 在部分赎回或全部赎回时, 如发生收取强制赎回费的情形, 赎回费用应当从上述赎回金额中扣除, 赎回费用的计算方式为:</p> <p>赎回费用=(赎回份额-T 日本基金总份额×1%)×基金份额赎回价格×1%</p> <p>赎回金额的计算结果保留到小数点后2位, 小数点2位以后的部分舍去, 舍去部分所代表的资产归基金财产所有。</p>	
第六部分“基金份额的	增加表述	增加:	《流动性风险管理规定》第

<p>申购与赎回”之“(九) 暂停申购的情形及处理方式”</p>	<p>原表述： 发生上述暂停申购情形时，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 4 项暂停申购情形时，基金管理人应依照有关规定在中国证监会指定媒体上公告。</p>	<p>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，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施；</p> <p>6、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>其余序号作相应调整</p> <p>修改为： 发生上述暂停申购情形时，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形时，基金管理人应依照有关规定在中国证监会指定媒体上公告。</p>	<p>十九、二十四条关于“拒绝或暂停接受投资者申购的情形”</p> <p>相应调整序号</p>
----------------------------------	---	---	---

<p>第六部分“基金份额的申购与赎回”之“(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加： 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确认后,并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施； 其余序号作相应调整</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条关于“拒绝或暂停接受投资者赎回申请或延缓支付赎回款项的情形”</p>
<p>第六部分 “基金份额的申购与赎回”之“(十一)巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”之“(2) 部分顺延赎回”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加： 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%的,基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理,对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十一条关于“开放式基金巨额赎回的相关规定”</p>
<p>第七部分“基金合同当</p>	<p>原表述：</p>	<p>修改为：</p>	<p>更新了基金合同中基金管理</p>

<p>事人及权利义务”之 “（一）基金管理人”</p>	<p>（一）基金管理人简况 名称：天治基金管理有限公司 注册地址：上海市延平路83号501-503室 办公地址：上海市复兴西路159号 法定代表人：赵玉彪 成立时间：2003年5月27日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：证监基金字[2003]73号 组织形式：有限责任公司 注册资本：1.6亿元人民币 存续期间：永续经营</p>	<p>（一）基金管理人简况 名称：天治基金管理有限公司 注册地址：上海市浦东新区莲振路298号4号楼231室 办公地址：上海市复兴西路159号 法定代表人：吕文龙 成立时间：2003年5月27日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：证监基金字[2003]73号 组织形式：其他有限责任公司 注册资本：1.6亿元人民币 存续期间：持续经营</p>	<p>人的信息</p>
<p>第七部分“基金合同当事人及权利义务”之 “（二）基金托管人”</p>	<p>原表述： 1、基金托管人简况 名称：中国民生银行股份有限公司</p>	<p>修改为： 1、基金托管人简况 名称：中国民生银行股份有限公司</p>	<p>更新了基金合同中基金托管人的信息</p>

	<p>注册地址：北京市东城区正义路4号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人：经叔平 成立时间：1996年2月7日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号 组织形式：其他股份有限公司（上市） 注册资本：2,586,721,300元人民币 存续期间：持续经营</p>	<p>注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人：洪崎 成立时间：1996年2月7日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号 组织形式：其他股份有限公司（上市） 注册资本：28,365,585,227元人民币 存续期间：持续经营</p>	
<p>第十二部分“基金的投资”之“（八）投资组合限制”</p>	<p>原表述： 6、投资组合的平均剩余期限每个交易日都不得超过180天； 12、因基金规模变动、市场波动、发债</p>	<p>修改为： 6、投资组合的平均剩余期限每个交易日都不得超过180天，但第11项另有约定除外；</p>	<p>《流动性风险管理规定》第八章“关于货币市场基金特别规定”、第十六条关于“流动性受限资产的投资限制”</p>

	<p>公司合并等</p> <p>增加表述</p>	<p>17、除上述第 13、14 项外，因基金规模变动、市场波动、发债公司合并等增加：</p> <p>10、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%；</p> <p>11、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%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份</p>	<p>以及第十七条关于“逆回购交易的质押品的限制”</p>
--	--------------------------	--	-------------------------------

		<p>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%;</p> <p>12、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>本基金拟投资于主体信用评级低于</p>	
--	--	---	--

		<p>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>13、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;</p> <p>14、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;</p>	
--	--	---	--

		其余序号作相应调整	
第十四部分“基金的估值”之“(七) 暂停估值的情形”	增加表述	增加： 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，基金管理人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； 其余序号作相应调整	《流动性风险管理规定》第二十四条补充
第十八部分“基金的信息披露”之“(一) 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”	增加表述	增加： 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，为保障其他投资者权益，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	《流动性风险管理规定》第二十六条第(二)项关于《流动性风险管理规定》第二十七条关于“报告期内单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形”

		<p>特有风险。</p> <p>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。</p> <p>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>《流动性风险管理规定》第三十六条“关于货币市场基金的信息披露”</p>
<p>第十八部分“基金的信息披露”之“(一)公开披露的基金信息”之“6、临时报告”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加:</p> <p>(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;</p> <p>其余序号作相应调整</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条第(二)项关于“流动性风险分析披露”的规定</p>