

# 国泰基金管理有限公司关于修改国泰现金管理货币市场基金基金合同和托管协议的公告

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》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》等法律法规的规定及《国泰现金管理货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，经与基金托管人中国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备案，国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定自2016年6月17日起按照《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》的要求修改《基金合同》，同时根据《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》等法律法规对《基金合同》进行相应修改。本次修改系因法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行变更的情形，不需召开基金份额持有人大会。

本基金《基金合同》的主要修改内容详见本公告之附件。但附件中以星号（“\*”）标注的修改项，即：《国泰现金管理货币市场基金基金合同》“十四、基金的投资（二）投资范围和投资对象”一款以及“十四、基金的投资（七）基金投资组合比例限制”一款中第1项“1、本基金不得投资于下列金融工具：……”以及《国泰现金管理货币市场基金托管协议》“三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”第1款“1. 对基金的投资范围、投资对象进行监督”和第2款“2. 对基金投融资比例进行监督”之第(1)项“(1)本基金不得投资于以下金融工具：……”本次暂不修改，基金管理人将在符合相关法律法规和监管要求的前提下履行适当程序后进行修改，并另行公告。

基金管理人将对《国泰现金管理货币市场基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）中涉及上述修改的内容进行相应修改，《托管协议》的主要修改内容详见本公告之附件。基金管理人将在更新的《国泰现金管理货币市场基金更新招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）中，对涉及上述修改的内容进行相应更新。

本公告仅对本基金依据法律法规修改《基金合同》和《托管协议》的有关事

项予以说明。投资人欲了解上述基金的详细情况，请仔细阅读刊登于基金管理人网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）的本基金《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》等法律文件，以及相关业务公告。

本基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整上述有关内容。

投资人可访问本公司网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）或拨打全国免长途话费的客户服务电话（400-888-8688）咨询相关情况。

特此公告。

附件：国泰现金管理货币市场基金基金合同和托管协议变更修改对照表

国泰基金管理有限公司

2016年6月17日

附件：国泰现金管理货币市场基金基金合同和托管协议变更修改对照表

| 《国泰现金管理货币市场基金基金合同》变更修改对照表                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                             |
|--------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 章节                                                     | 原基金合同                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 修改后的基金合同                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 修改理由                                                                                                                        |
| 全文                                                     | 媒体                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 媒介                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 根据《运作办法》的表述调整进行修改                                                                                                           |
| 一、前言<br>(一) 订立《国泰现金管理货币市场基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则 | 2. 订立本基金合同的依据<br>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称“《暂行规定》”)、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(以下简称“《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〉》(以下简称“《信息披露特别规定》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号〈基金合同的内容与格式〉》及其他法律法规的有关规定。 | 2. 订立本基金合同的依据<br>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《货币市场基金监督管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》(以下简称“《有关问题的规定》”)、《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〉》(以下简称“《信息披露特别规定》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号〈基金合同的内容与格式〉》及其他法律法规的有关规定。 | 《公开募集证券投资基金运作管理办法》自2014年8月8日起施行,《证券投资基金运作管理办法》同时废止。<br>《货币市场基金监督管理办法》自2016年2月1日起施行,《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》同时废止。 |
| 一、前言<br>(二)                                            | 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基                                                                                                                                                                                                                                                                              | 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 根据《管理办法》第18条修改。                                                                                                             |

|      |                                                                                                |                                                                                                                                                                         |                    |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|      | 金份额持有人的最低收益。                                                                                   | 金份额持有人的最低收益。<br>投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。                                                                                          |                    |
| 二、释义 | 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订； | 《基金法》：指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订； | 根据相应法律法规的调整，更新该释义。 |
| 二、释义 | 《销售办法》：指 2011 年 6 月 9 日由中国证监会公布并于 2011 年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；                   | 《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                                                        | 根据相应法律法规的调整，更新该释义。 |
| 二、释义 | 《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；                   | 《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                                                     | 根据相应法律法规的调整，更新该释义。 |
| 二、释义 |                                                                                                | 《管理办法》：指中国证监会及中国人民银行2015年12月17日共同颁布并于2016年2月1日起施行的《货币市场基金监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                                         | 根据相应法律法规的调整，更新该释义。 |
| 二、释义 |                                                                                                | 《有关问题的规定》：指中国证监会及中国人民银行2015年12月17日共同颁布并于2016年2月1日起施行的《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                         | 根据相应法律法规的调整，更新该释义。 |
| 二、释义 | 摊余成本法：指估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余                                               | 摊余成本法：指计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余                                                                                                                        | 根据《有关问题的规定》第6条，更   |

|                                      |                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                 |                 |
|--------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                                      | 存续期内 <b>平均摊销</b> ，每日计提损益；                                                                                                                                                                                                             | 存续期内 <b>按实际利率法摊销</b> ，每日计提损益；                                                                                                                                                                                                                                   | 新该释义。           |
| 五、基金的备案<br>(五)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模  | 本基金合同存续期内， <b>基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。</b>                                                                                                                   | 本基金合同存续期内， <b>连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</b>                                                                                      | 根据《运作办法》第41条修改。 |
| 六、基金份额的申购、赎回与转换<br>(五)申购与赎回的数额限制     | <p>1. 本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。</p> <p>2. 基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定<b>媒体</b>上公告并报中国证监会备案。</p>                                                                                       | <p>1. 本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。</p> <p>2. <b>基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定，在特定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购，具体以基金管理人的公告为准。</b></p> <p>3. 基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定<b>媒介</b>上公告并报中国证监会备案。</p>                            | 根据《管理办法》第14条修改。 |
| 六、基金份额的申购、赎回与转换<br>(六)申购份额与赎回金额的计算方式 | <p>1. 本基金的基金份额净值保持为人民币 1.00 元。</p> <p>2. 本基金不收取申购费用和赎回费用。</p> <p>3. 本基金申购份额、赎回金额的计算方式按招募说明书的规定执行。</p> <p>4. 本基金申购份额、余额的处理方式为：申购份额计算结果以四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>5. 本基金赎回金额的处理方式为：赎回金额计算结果以四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，由此产生的</p> | <p>1. 本基金的基金份额净值保持为人民币 1.00 元。</p> <p>2. <b>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。</b></p> <p>3. <b>发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 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 5%且偏离度为负的情形时，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。</b></p> | 根据《管理办法》第17条修改。 |

|                                                                                             |                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                    |                           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|
|                                                                                             | 误差计入基金财产。                                                                                   | <p><b>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。</b></p> <p>4. 本基金申购份额、赎回金额的计算方式按招募说明书的规定执行。</p> <p>5. 本基金申购份额、余额的处理方式为：申购份额计算结果以四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>6. 本基金赎回金额的处理方式为：赎回金额计算结果以四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，由此产生的误差计入基金财产。</p> |                           |
| <p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1. 在以下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请</p> | <p>（7）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>                                                             | <p><b>（7）当影子定价法确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到或超过 0.5%时；</b></p> <p>（8）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>                                                                                                                                | <p>根据《管理办法》第12条修改。</p>    |
| <p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>（九）拒绝或暂停</p>                                                      | <p>（6）法律法规规定<b>或</b>经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项</p> | <p><b>（6）当影子定价法确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人决定履行适当程序后终止基金合同的；</b></p>                                                                                                                                      | <p>根据《管理办法》第12、17条修改。</p> |

|                                                            |                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                     |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| <p>停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>2. 在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请</p> | <p>的，基金管理人应当及时向中国证监会备案并公告。已成功确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被确认的赎回申请量占已确认的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以支付。</p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。</p> | <p>（7）法律法规规定、中国证监会认定<b>或基金合同约定</b>的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项的，基金管理人应当及时向中国证监会备案并公告。已成功确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被确认的赎回申请量占已确认的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以支付。</p> <p><b>为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 10%的，基金管理人可对其采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。</b></p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。</p> |                     |
| <p>八、基金合同当事人及其权利义务</p> <p>（一）基金管理人</p>                     | <p>法定代表人：<b>陈勇胜</b></p>                                                                                                                                              | <p>法定代表人：<b>唐建光</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <p>更新基金管理人基本信息。</p> |
| <p>八、基金合同当事人及其权利义务</p> <p>（一）基金托管人</p>                     | <p>法定代表人：<b>肖钢</b></p>                                                                                                                                               | <p>法定代表人：<b>田国立</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <p>更新基金托管人基本信息。</p> |
| <p>九、基金份额持</p>                                             | <p>2. 议事程序</p>                                                                                                                                                       | <p>2. 议事程序</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | <p>根据《运作办法》</p>     |

|                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                              |                 |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 有人大会<br>(七) 议事内容与程序                           | 在现场开会的方式下, 首先由召集人宣读提案, 经讨论后进行表决, 并形成大会决议, <b>报经中国证监会核准或备案后生效</b> 。在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人在会议通知中公布提案, 在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议, <b>报经中国证监会核准或备案后生效</b> 。                                                                                                                                   | 在现场开会的方式下, 首先由召集人宣读提案, 经讨论后进行表决, 并形成大会决议, <b>决议自表决通过之日起生效并报中国证监会备案</b> 。在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人在会议通知中公布提案, 在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议, <b>决议自表决通过之日起生效并报中国证监会备案</b> 。                                                                                          | 第48条修改。         |
| 九、基金份额持有人大会<br>(十) 生效与公告                      | <p>1. 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律规定表决通过的事项, 召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会<b>核准或者备案</b>。基金份额持有人大会决定的事项<b>经中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效</b>。</p> <p>2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。</p> <p>3. 基金份额持有人大会决议应当自<b>中国证监会核准或出具无异议意见后2日内</b>, 由基金份额持有人大会召集人在指定<b>媒体</b>上公告。</p> | <p>1. 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律规定表决通过的事项, 召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会<b>备案</b>。基金份额持有人大会决定的事项<b>自表决通过之日起生效</b>。</p> <p>2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。</p> <p>3. 基金份额持有人大会决议应当自<b>生效之日起2日内</b>, 由基金份额持有人大会召集人在指定<b>媒介</b>上公告。</p> | 根据《运作办法》第48条修改。 |
| 十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序<br>(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序 | <p>1. 基金管理人的更换程序</p> <p>原基金管理人退任后, 基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前, 中国证监会可指定临时基金管理人。</p> <p>(1) 提名: 新任基金管理人由基金托管人或单独或合计代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。</p> <p>(2) 决议: 基金份额持有人大会对更换基金管理人</p>                                                                                                                     | <p>1. 基金管理人的更换程序</p> <p>原基金管理人退任后, 基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前, 中国证监会可指定临时基金管理人。</p> <p>(1) 提名: 新任基金管理人由基金托管人或单独或合计代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。</p> <p>(2) 决议: 基金份额持有人大会对更换基金管理人</p>                                                                                        | 根据《运作办法》第48条修改。 |

|                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                        |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
|                                                         | <p>形成有效决议。</p> <p>(3) <b>核准</b>并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会<b>核准</b>，并应自<b>中国证监会核准</b>后2日内在指定<b>媒体</b>上公告。</p>                                                                                                                                                                           | <p>形成有效决议。</p> <p>(3) <b>备案</b>并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会<b>备案</b>，并应自<b>基金份额持有人大会决议生效后</b>2日内在指定<b>媒介</b>上公告。</p>                                                                                                                                                                           |                        |
| <p>十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> <p>(二)基金管理人和基金托管人的更换程序</p> | <p>2. 基金托管人的更换程序</p> <p>原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。</p> <p>(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或单独或合计代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。</p> <p>(3) <b>核准</b>并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会<b>核准</b>，并应自<b>中国证监会核准</b>后2日内在指定<b>媒体</b>上公告。</p> | <p>2. 基金托管人的更换程序</p> <p>原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在6个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。</p> <p>(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或单独或合计代表10%以上基金份额的基金份额持有人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。</p> <p>(3) <b>备案</b>并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起5日内，由大会召集人报中国证监会<b>备案</b>，并应自<b>基金份额持有人大会决议生效后</b>2日内在指定<b>媒介</b>上公告。</p> | <p>根据《运作办法》第48条修改。</p> |
| <p>十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> <p>(二)基金管理人和基金托管人的更换程序</p> | <p>3. 基金管理人与基金托管人同时更换</p> <p>(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人。</p> <p>(2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行。</p> <p>(3) 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议<b>获得中国证监会核准</b>后2日内在指定<b>媒体</b>上联合公告。</p>                                                           | <p>3. 基金管理人与基金托管人同时更换</p> <p>(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人。</p> <p>(2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行。</p> <p>(3) 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议<b>生效后</b>2日内在指定<b>媒介</b>上联合公告。</p>                                                                        | <p>根据《运作办法》第48条修改。</p> |

|                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                      |                   |
|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| 十三、基金份额的注册登记<br>(三) 注册登记机构履行如下职责： | 5. 保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 5. 妥善保存注册登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年，法律法规另有规定的从其规定；                                                                                                                                                        | 根据《基金法》第 102 条修改。 |
| * 十四、基金的投资<br>(二) 投资范围            | <p>本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 现金；</li> <li>2. 通知存款；</li> <li>3. 短期融资券；</li> <li>4. 1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；</li> <li>5. 期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；</li> <li>6. 期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；</li> <li>7. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据；</li> <li>8. 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。</li> </ol> | <p>本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 现金；</li> <li>2. 期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；</li> <li>3. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；</li> <li>4. 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。</li> </ol>  | 根据《管理办法》第 4 条修改。  |
| * 十四、基金的投资<br>(七) 基金投资组合比例限制      | <p>1. 本基金不得投资于以下金融工具：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 股票；</li> <li>(2) 可转换债券；</li> <li>(3) 剩余期限超过 397 天的债券；</li> <li>(4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；</li> <li>(5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；</li> <li>(6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；</li> </ol>                                                                      | <p>1. 本基金不得投资于以下金融工具：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 股票；</li> <li>(2) 可转换债券、可交换债券；</li> <li>(3) 信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具；</li> <li>(4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；</li> <li>(5) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；</li> </ol> | 根据《管理办法》第 5 条修改。  |

|                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                              |
|---------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|
|                                       | <p>(7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>(6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                              |
| <p>十四、基金的投资</p> <p>(七) 基金投资组合比例限制</p> | <p>2. 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 90 天；</p> <p>(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；</p> <p>(4) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；</p> <p>(5) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(6) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(7) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(8) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信</p> | <p>2. 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 90 天，<b>平均剩余存续期不得超过 240 天；</b></p> <p>(2) <b>本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</b>本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；</p> <p>(4) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。</p> <p>(5) 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%；</p> <p>(6) 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</p> | <p>根据《运作办法》第32条、《管理办法》第6条、第7条、第8条、第9条修改。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |  |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
|  | <p>用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;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%;</p> <p>(10) 除发生巨额赎回的情形外,本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%;因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的,基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整;</p> <p>(11) 法律法规和基金合同规定的其他限制。</p> <p>除上述第(10)项外,因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到上述标准。法律法规另有规定时,从其规定。</p> | <p>的比例合计不得低于 10%;</p> <p>(7) 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>(8) 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不得超过 20%;</p> <p>(9) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%,本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;</p> <p>(10) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;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%;</p> <p>(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140% ;</p> <p>(12) 法律法规和基金合同规定的其他限制。</p> <p>除上述第(5)项外,因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到上述标准,但中国证监</p> |  |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|

|                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                          |                                          |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|
|                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。                                                               |                                          |
| 十四、基金的投资<br>（七）基金投资组合比例限制 | <p>3. 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>（1）国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>（2）根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：</p> <p>①国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>②国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。</p> <p>同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。</p> <p>本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个交易日内对其予以全部减持。</p> <p>4. 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。</p> | <p>3. 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。</p> | 根据《管理办法》第43条，《关于货币市场基金投资短期融资券有关问题的通知》废止。 |
| 十四、基金的投资<br>（八）投资组合       | <p>（八）投资组合平均剩余期限的计算</p> <p>1. 平均剩余期限（天）的计算公式如下：</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>（八）投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期限的计算</p> <p>1. 平均剩余期限（天）的计算公式如下：</p>                             | 根据《有关问题的规定》修改。                           |

|                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|
| <p>平均剩余期限与平均剩余存续期限的计算</p>                        | $\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$ <p>其中：投资于金融工具产生的资产包括<b>现金类资产</b>（含<b>银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金</b>）、一年以内（含一年）的<b>银行定期存款、大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、期限在一年以内（含一年）的逆回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券</b>、中国证监会及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。</p> <p>投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内（含一年）正回购、买断式回购产生的待返售债券等。</p> <p>采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。</p> | $\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限}}$ <p>平均剩余存续期限（天）的计算公式如下：</p> <p>其中：投资于金融工具产生的资产包括<b>现金、期限在一年以内（含一年）的银行定期存款、同业存单、逆回购、中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券</b>，中国证监会及中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。</p> <p>投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内（含一年）正回购、买断式回购产生的待返售债券等。</p> <p>采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。</p> |                       |
| <p>十四、基金的投资</p> <p>（八）投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期限的计算</p> | <p>2. 各类资产和负债剩余期限的确定</p> <p>（1）<b>银行存款</b>、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天；证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；<b>买断式回购履约金</b>的剩余期限以<b>计算日至协议到期日的实际剩余天数</b>计算。</p> <p>（2）一年以内（含一年）<b>银行定期存款、大额存单</b>的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>（3）组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：</p> <p>允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下</p>                                                                                                                                                                                                                                          | <p>2. 各类资产和负债剩余期限<b>和剩余存续期限</b>的确定</p> <p>（1）<b>银行活期存款</b>、清算备付金、交易保证金的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>为0天；证券清算款的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>以计算日至交收日的剩余交易日天数计算。</p> <p>（2）<b>银行定期存款、同业存单</b>的剩余期限和<b>剩余存续期限</b>以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的<b>银行存款</b>，剩余期限和<b>剩余存续期限</b>以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；<b>银行通知存款</b>的剩余期限和<b>剩余</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                              | <p>根据《有关问题的规定》修改。</p> |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
|                        | <p><b>一个利率调整日的实际剩余天数计算。</b></p> <p>(4) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(5) 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限。</p> <p>(7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(8) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。</p> | <p><b>存续期限以存款协议中约定的通知期计算。</b></p> <p>(3) 组合中债券的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：<br/> <b>允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。</b><br/> <b>允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。</b></p> <p>(4) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(5) 中央银行票据的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>为该基础债券的剩余期限。</p> <p>(7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限<b>和剩余存续期限</b>以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(8) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。</p> |                |
| 十七、基金财产的估值<br>(四) 估值方法 | <p>1. 本基金估值采用摊余成本法，即<b>估值</b>对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法前，本基金暂不投资于交易所短期债券。</p>                                                                                        | <p>1. 本基金估值采用摊余成本法，即<b>计价</b>对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法前，本基金暂不投资于交易所短期债券。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 根据《有关问题的规定》修改。 |
| 十七、基金财产                | <p>2. 为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净</p>                                                                                                                                                                                                                                   | <p>2. 为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 根据《管理办法》       |

|                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                        |
|-----------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|
| <p>的估值</p> <p>(四)估值方法</p>               | <p>值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整。当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离度的绝对值达到或超过0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。</p> | <p>值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。</p> | <p>第12条修改。</p>         |
| <p>二十一、基金的信息披露</p> <p>(六)临时报告与公告</p>    | <p>18. 当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过0.5%的情形；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                              | <p>18. 当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值负偏离度绝对值达到0.25%或正负偏离度绝对值达到0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续2个交易日出现负偏离度绝对值超过0.5%的情形；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>根据《管理办法》第12条修改。</p> |
| <p>二十一、基金的信息披露</p> <p>(八)基金份额持有人大会决</p> | <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和</p>                                                                                                                                                                                                                                       | <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>根据《运作办法》第48条修改。</p> |

|                                          |                                                                                                              |                                                                                                                      |                    |
|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
| 议                                        | 表决方式等事项。                                                                                                     | 事项。                                                                                                                  |                    |
| 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算<br><br>(一)基金合同的变更 | 2. 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会 <b>核准或备案</b> ，并自中国证监会 <b>核准或出具无异议意见之日起生效</b> , 按照《信息披露办法》的有关规定在 <b>指定媒体公告</b> 。 | 2. 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会 <b>备案</b> 。关于基金合同变更的 <b>基金份额持有人大会决议</b> 自生效后 <b>方可执行</b> ，自决议生效之日起 <b>2 日内在指定媒介公告</b> 。 | 根据《运作办法》第48条修改。    |
| 二十七、基金合同内容摘要                             | 根据基金合同正文修改一并更新                                                                                               |                                                                                                                      |                    |
| 《国泰现金管理货币市场基金托管协议》变更修改对照表                |                                                                                                              |                                                                                                                      |                    |
| 章节                                       | 原托管协议                                                                                                        | 修改后的托管协议                                                                                                             | 修改理由               |
| 全文                                       | 媒体                                                                                                           | 媒介                                                                                                                   | 根据《运作办法》的表述调整进行修改  |
| 一、托管协议当事人<br><br>(一)基金管理人（或简称“管理人”）      | 法定代表人： <b>陈勇胜</b>                                                                                            | 法定代表人： <b>唐建光</b>                                                                                                    | 更新基金管理人基本信息。       |
| 一、托管协议当事人<br><br>(二)基金托管人（或简称“托管人”）      | 法定代表人： <b>肖钢</b>                                                                                             | 法定代表人： <b>田国立</b>                                                                                                    | 更新基金托管人基本信息。       |
| 二、托管协议的依据、目的、原                           | 本协议依据《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                                                           | 本协议依据《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》”）、《公                                                                   | 根据2014年7月7日颁布的《公开募 |

|                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                             |                   |
|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| 则和解释<br>(一) 依据          | 券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与《国泰现金管理货币市场基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。                                                                                                                                                                                                              | <b>开募集</b> 证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与《国泰现金管理货币市场基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。                                                                                                                        | 集证券投资基金运作管理办法》修改。 |
| * 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | <p>1. 对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 包括:</p> <p>(1) 现金;</p> <p>(2) <b>通知存款;</b></p> <p>(3) <b>短期融资券;</b></p> <p>(4) 1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单;</p> <p>(5) 期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购; 期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据; 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据;</p> <p>中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的<b>金融工具</b>。</p> | <p>1. 对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 包括:</p> <p>(1) 现金;</p> <p>(2) 期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;</p> <p>(3) 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;</p> <p>(4) 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的<b>货币市场工具</b>。</p> | 根据《管理办法》第4条修改。    |
| * 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | <p>2. 对基金投融资比例进行监督。</p> <p>(1) 本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>1) 股票;</p> <p>2) 可转换债券;</p> <p>3) <b>剩余期限超过 397 天的债券;</b></p> <p>4) <b>信用等级在 AAA 级以下的企业债券;</b></p> <p>5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券, 但</p>                                                                                                                             | <p>2. 对基金投融资比例进行监督。</p> <p>(1) 本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>1) 股票;</p> <p>2) 可转换债券、可交换债券;</p> <p>3) 信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具;</p> <p>4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券, 已</p>                                                                              | 根据《管理办法》第5条修改。    |

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                              |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|
|                       | <p>市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；</p> <p>6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；</p> <p>7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>进入最后一个利率调整期的除外；</p> <p>5) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；</p> <p>6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                              |
| 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | <p>(2) 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 90 天；</p> <p>2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；</p> <p>4) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；</p> <p>5) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>6) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>7) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>8) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得</p> | <p>(2) 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 90 天，<b>平均剩余存续期不得超过 240 天；</b></p> <p>2) <b>本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</b>本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>3) 本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；</p> <p>4) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%；</p> <p>5) 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%；</p> | <p>根据《运作办法》第32条、《管理办法》第6条、第7条、第8条、第9条修改。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |  |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
|  | <p>超过基金资产净值的 40%;</p> <p>9) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%; 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%; 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%;</p> <p>10) 除发生巨额赎回的情形外, 本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%; 因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的, 基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整;</p> <p>11) 法律法规和基金合同规定的其他限制。</p> <p>除上述第(10)项外, 因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的, 基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到上述标准。法律法规另有规定时, 从其规定。</p> | <p>6) 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%;</p> <p>7) 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>8) 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不得超过 20%;</p> <p>9) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%, 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;</p> <p>10) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%; 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%; 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%;</p> <p>11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;</p> <p>12) 法律法规和基金合同规定的其他限制。</p> <p>除上述第 5) 项外, 因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的, 基金管理人应在 10</p> |  |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                          |
|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|
|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 个交易日内进行调整，以达到上述标准， <b>但中国证监会规定的特殊情形除外</b> 。法律法规另有规定时，从其规定。                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                          |
| 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | <p>(3) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：</p> <p>① 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>② 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。</p> <p>同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。</p> <p>本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个交易日内对其予以全部减持。</p> <p>(4) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。</p> <p>本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 3 个月内对其予以全部卖出。</p> | <p>(3) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。</p> <p>本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 3 个月内对其予以全部卖出。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。</p> <p>如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。</p> | 根据《管理办法》第43条，《关于货币市场基金投资短期融资券有关问题的通知》废止。 |

|                                                |                                                                                                                                                                                      |                                                                                               |                    |
|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|                                                | <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。</p> <p>如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。</p> |                                                                                               |                    |
| 十五、禁止行为                                        | <p>(一)《基金法》第二十条、<b>第三十一条</b>禁止的行为。</p> <p>(二)《基金法》<b>第五十九条</b>禁止的投资或活动。</p>                                                                                                          | <p>(一)《基金法》第二十条、<b>第三十八条</b>禁止的行为。</p> <p>(二)《基金法》<b>第七十三条</b>禁止的投资或活动。</p>                   | 根据2015年修改的《基金法》修改。 |
| <p>十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>(一)托管协议的变更</p> | <p>本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当按照届时相关规定报中国证监会<b>核准或备案</b>。</p>                                                                                     | <p>本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当按照届时相关规定报中国证监会<b>备案</b>。</p> | 根据《运作办法》第48条修改。    |