**交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金修改基金合同的公告**

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据中国证监会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》的有关规定及相关监管要求，对本公司管理的交银施罗德货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同作相应修改，前述修改已与基金托管人协商一致，并报监管机构备案。

上述修改系因相应的法律法规发生变动而进行的修改，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。上述修改自本公告发布之日起生效。

重要提示：

1、本基金基金合同的修改内容详见附件修订对照表，本基金托管协议中相关条款根据基金合同进行修订。本公司将在网站上公布经修改后的交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同和托管协议，并更新基金管理人和基金托管人的相关信息。

2、本公司将在更新基金招募说明书时，对上述相关内容进行相应修订。

3、投资者可登录本公司网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）或拨打本公司的客户服务电话400-700-5000（免长途话费），（021）61055000进行咨询、查询。

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。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一八年三月二十二日

**附件《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》修改对照表**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **章节** | **原文内容** | **修改后内容** |
| 1. **第一部分 前言** | （一） 订立《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》的目的、依据和原则  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，规范交银施罗德货币市场证券投资基金（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、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）。 | （一） 订立《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》的目的、依据和原则  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，规范交银施罗德货币市场证券投资基金（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》（以下简称《流动性规定》）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《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）。 |
| 1. **第二部分 释义** |  | 新增内容如下：  《流动性规定》： 指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；  ……  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； |
| **第六部分 基金的申购、赎回及其他业务** | 五、申购与赎回的数额限制 | 五、申购与赎回的数额限制  新增内容如下：  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。具体请参见招募说明书或相关公告。 |
| **第六部分**  **基金的申购、赎回及其他业务** | 六、申购费用和赎回费用  本基金的申购和赎回费率为零。 | 六、申购费用和赎回费用  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。 |
| **第六部分**  **基金的申购、赎回及其他业务** | 七、申购份额与赎回金额的计算  2、本基金赎回支付金额的计算：  赎回金额=赎回份额X基金份额净值+赎回份额对应的未付收益  赎回金额以人民币元为单位，保留至小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，四舍五入部分所代表的资产归基金所有。 | 七、申购份额与赎回金额的计算  2、本基金赎回支付金额的计算（不包含特殊情况）：  赎回金额=赎回份额X基金份额净值+赎回份额对应的未付收益  赎回金额以人民币元为单位，保留至小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，四舍五入部分所代表的资产归基金所有。 |
| **第六部分**  **基金的申购、赎回及其他业务** | 九、暂停申购的情形及处理方式  发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，申购款项将全额退还投资者。基金管理人应当根据有关规定在中国证监会指定媒体上刊登暂停申购公告。 | 九、暂停申购的情形及处理方式  新增内容如下：  （6）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；  （7）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。出现上述情形时，基金管理人有权将上述申购申请全部或部分确认失败。  ……  发生上述（1）到（6）项暂停申购情形时，申购款项将全额退还投资者。基金管理人应当根据有关规定在中国证监会指定媒体上刊登暂停申购公告。 |
| **第六部分**   1. **基金的申购、赎回及其他业务** | 十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 | 十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式  新增内容如下：  （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接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项； |
| **第六部分**   1. **基金的申购、赎回及其他业务** | 十一、巨额赎回的情形及处理方式  2、巨额赎回的处理方式  （2）部分顺延赎回 | 十一、巨额赎回的情形及处理方式  2、巨额赎回的处理方式  （2）部分顺延赎回  新增内容如下：  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日基金总份额20%的情形下，基金管理人有权采取如下措施：对于该类基金份额持有人当日超过20%的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理；对于该类基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该类基金份额持有人在当日选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。 |
| **第七部分 基金合同当事人及权利义务** | 一、基金管理人  （一） 基金管理人简况  注册地址：上海市交通银行大楼二层（裙）  法定代表人：谢红兵 | 一、基金管理人  （一） 基金管理人简况  注册地址：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）  法定代表人：于亚利 |
| **第七部分 基金合同当事人及权利义务** | 一、基金托管人  （一） 基金托管人简况  名称：中国农业银行  注册地址：北京市复兴路甲23号  办公地址：北京市西三环北路100号金玉大厦  法定代表人：项俊波  成立日期：1979年2月23日  注册资金：361亿元人民币  存续期间：持续经营  组织形式：国有独资  批准设立机关和批准设立文号：国发（1979）056号 | 一、基金托管人  （一） 基金托管人简况  名称：中国农业银行股份有限公司  住所：北京市东城区建国门内大街69号  法定代表人：周慕冰  成立时间：2009年1月15日  批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2009】13号  组织形式：股份有限公司  注册资本：叁仟贰佰肆拾柒亿玖仟肆佰壹拾壹万柒仟元  存续期间：持续经营  基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号 |
| **第十二部分 基金的投资** | 八、投资组合限制  1、本基金不得投资于以下金融工具： | 八、投资组合限制  1、本基金不得投资于以下金融工具：  增加内容如下：  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。 |
| **第十二部分 基金的投资** | 八、投资组合限制  2、本基金投资组合遵循如下投资限制：  ……  因基金规模或市场变化导致投资组合超过以上比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规和监管机关另有规定时，从其规定。 | 八、投资组合限制  2、本基金投资组合遵循如下投资限制：  新增内容如下：  （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%；  （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%；  （12）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%；  （13）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；  （14）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；  （15）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；  ……  除上述第（14）项、第（15）项外，因基金规模或市场变化导致投资组合超过以上比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规和监管机关另有规定时，从其规定。 |
| 1. **第十四部分 基金资产估值** | 七、暂停估值的情形 | 七、暂停估值的情形  新增内容如下：  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确认后，基金管理人应当暂停估值； |
| **第二十部分 基金的信息披露** | 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《信息披露特别规定》、基金合同及其他有关规定。 | 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《信息披露特别规定》、《流动性规定》、基金合同及其他有关规定。 |
| **第十八部分 基金的信息披露** | 一、公开披露的基金信息  （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 | 一、公开披露的基金信息  （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  新增内容如下：  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，为保障其他投资者的权益，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特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。  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。  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。 |
| **第十八部分 基金的信息披露** | 一、公开披露的基金信息  （六）临时报告 | 一、公开披露的基金信息  （六）临时报告  新增内容如下：  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；  28）本基金投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单； |