

华泰柏瑞基金管理有限公司

关于华泰柏瑞交易型货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据《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》、《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）和《华泰柏瑞交易型货币市场基金托管协议》（以下简称“托管协议”）的有关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，已完成对本公司管理的华泰柏瑞交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同和托管协议的修订，现将有关修订内容公告如下：

一、基金合同的修订内容

1、在“第一部分 前言”部分，进行修订：

1) 将“订立本基金合同的目的、依据和原则”中第二款修订为：“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》”）……《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《货币市场基金监督管理办法》和其他有关法律法规。”

2、在“第二部分 释义”部分，进行修订：

1) 将“43、摊余成本法”的释义修订为：“43、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，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益”

3、在“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分，进行修订：

1) 将“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”修订为：“本基金通常情况下不收取申购费用和赎回费用，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将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益最大化的情形除外。”

2) 将“七、拒绝或暂停申购的情形”修订为：

“(一)发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的场内或场外申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、上海证券交易所、销售机构、注册登记机构等因异常情况无法办理申购的情况。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7项暂停申购情形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。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购本金将退还给投资人。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。

（二）当本基金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正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受投资人的申购申请并根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。”

3) 将“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”修订为：

“（一）发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的场内或场外赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、上海证券交易所、销售机构、注册登记机构等因异常情况无法办理赎回的情形。

6、基金在开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

7、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

除因上述情形外，基金管理人也可以在以下情况发生时拒绝接受或暂停接受投资者的A类基金份额的赎回申请：

9、当日超过基金管理人规定的A类基金份额数量控制的赎回申请。

发生上述第1、2、3、4、5、6、7、8项暂停赎回的情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第6项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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公告。

(二)发生本基金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绝对值连续两个交易日超过0.5%的情形时，基金管理人有权暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算。基金管理人应当在实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，但无需召开基金份额持有人大会审议。”

4) 将“十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告”修订为：“十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告”

5) 将“十一、基金的非交易过户、转托管、冻结和解冻”修订为：“十二、基金的非交易过户、转托管、冻结和解冻”

6) 增加“十、为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，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，基金管理人可以参照上述第九条的规定延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项。”

4、在“第九部分 基金合同当事人及权利义务”部分，进行修订：

1) 将“一、基金管理人”中“(一)基金管理人简况”修订为：

“住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：贾波”

2) 将“二、基金托管人”中“(一)基金托管人简况”修订为：

“法定代表人：田国立”

5、在“第十四部分 基金的投资”部分，进行修订：

1) 将“二、投资范围”修订为：“本基金投资于以下金融工具：现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；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，以及中国证监会、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。”

2) 将“四、投资限制”修订为：

“1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票;
- (2) 可转换债券、可交换债券;
- (3) 信用等级在AAA级以下的企业债券;
- (4) 主体信用等级在AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具;
- (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券, 但已进入最后一个利率调整期的除外;
- (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;
- (7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制后, 基金管理人履行适当程序后, 本基金不受上述规定的限制。

2、组合限制

本基金的投资组合将遵循以下比例限制:

- (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120天, 平均剩余存续期不得超过240天;
- (2) 基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 其市值不得超过该证券的10%;
- (3) 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;
- (4) 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, 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%;
- (5) 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; 本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级, 信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级, 如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的, 应采用孰低原则确定其评级, 并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定;
- (6) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的20%; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的5%;
- (7) 本基金投资于现金、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%；

(8) 本基金投资于现金、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10%；

(9) 本基金投资于到期日在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%；

(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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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%；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。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(11) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

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；

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：

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；

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）。

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。

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。

(12) 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(13) 基金总资产不得超过基金资产净值的140%；

(14) 法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。

除上述第（10）、（11）项另有约定以及第（7）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。

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。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，在履行相关法律程序后，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受上述限制。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制；基金管理人应提前三个交易日公告，此调整无需召开基金份额持有人大会。

4、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。”

3) 将“七、投资组合平均剩余期限计算方法”修改为：

“七、投资组合平均剩余期限和剩余存续期计算方法

1、计算公式

本基金按下列公式计算平均剩余期限：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \sum \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

本基金按下列公式计算平均剩余存续期：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \sum \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期的确定方法

(1) 银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期为0天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期以计算日至交收日的剩余交易日天数计算。

(2) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。

(3) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期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银行存款，剩余期限和剩余存续期以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期以存款协议中约定的通知期计算。

(4) 中央银行票据的剩余期限和剩余存续期以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。

(5) 组合中债券的剩余期限和剩余存续期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：

1) 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；

2) 允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

(6) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。”

6、在“第十六部分 基金资产估值”部分，进行修订：

1) 将“三、估值方法”修改为：

“1、本基金估值采用“摊余成本法”，即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，在剩余存续期内按实际利率法摊销，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估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

2、为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净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。

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。”

7、在“第二十部分 基金的信息披露”部分，进行修订：

1) 将“五、公开披露的基金信息”中第“（八）临时报告”项修改为：

“28、本基金遇到极端风险情形，基金管理人及其股东使用自有资金从本基金购买相关金融工具；

29、中国证监会规定的其他事项。”

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改；

二、托管协议的修订内容

1、在“一、基金托管协议当事人”部分，进行修订：

1) 将（一）项修改为：

“注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人：贾波”

2) 将（二）项修改为：

“法定代表人：田国立”

2、在“三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”部分，进行修订：

1) 将（一）项修改为：

“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。本基金投资于以下金融工具：现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；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，以及中国证监会、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。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。”

2) 将“（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。”修改为：

“（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

（1）本基金不得投资于以下金融工具：

- 1) 股票；
- 2) 可转换债券、可交换债券；
- 3) 信用等级在AAA级以下的企业债券；
- 4) 主体信用等级在AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具；
- 5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外；
- 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；
- 7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制后，基金管理人履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

（2）基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

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120天，平均剩余存续期不得超过240天；

2) 基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 其市值不得超过该证券的 10%;

3) 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;

4) 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, 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%;

5) 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; 本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级, 信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级, 如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的, 应采用孰低原则确定其评级, 并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定;

6) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 20%; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 5%;

7) 本基金投资于现金、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%;

8) 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作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%;

9) 本基金投资于到期日在 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%;

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%, 中国证监会规定的特殊品种除外; 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%; 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管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%; 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。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

11) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准:

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;

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:

i) 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；

ii) 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）。

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。

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。

12) 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

13) 基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；

14) 法律法规或中国证监会规定的其它比例限制。

除上述第 10)、11) 项另有约定以及第 7) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。

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。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

(3) 如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，在履行相关法律程序后，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受上述限制。”

3、在“五、基金财产的保管”部分，进行修订：

1) 将第（四）款第 3 项修改为：

“3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。”

4、在“六、指令的发送、确认及执行”部分，进行修订：

1) 将第（三）款第 2 项“指令的确认”修改为：“基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证指令的要素是否齐全，并将指令所载签字和印鉴与授权通知进行表面真实性及权限范围核对，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。如有疑问必须及时通知基金管理人。”

2) 将第（三）款第 3 项“指令的时间和执行”修改为：“基金管理人尽量于划款前 1 个工作日向基金托管人发送指令并确认。对于要求当天到账的指令，必须在当天 15:30 前向基金托管人发送，15:30 之后发送的，基金托管人尽力执行，但不能保证划账成功。如果要

求当天某一时点到账的指令,则指令需要提前2个工作小时发送,并相关付款条件已经具备。基金托管人将视付款条件具备时为指令送达时间。对于中国证券登记结算有限责任公司实行T+0非担保交收的业务,基金管理人应在交易日14:00前将划款指令发送至托管人。因基金管理人指令传输不及时,致使资金未能及时划入中登公司所造成的损失由基金管理人承担,包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与人最低备付金带来的利息损失。基金管理人应确保基金托管人在执行指令时,基金资金账户有足够的资金余额,在基金资金头寸充足的情况下,基金托管人对基金管理人符合法律法规、《基金合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。”

5、在“七、交易及清算交收安排”部分,进行修订:

1) 将“(六)投资银行存款的特别约定”修改为:

“1.本基金投资银行存款前,基金管理人应与存款银行签订具体存款协议,包括但不限于以下内容:。

(1)存款账户必须以本基金名义开立,并将基金托管人为本基金开立的基金银行账户指定为唯一回款账户,任何情况下,存款银行都不得将存款投资本息划往任何其他账户。

(2)存款银行不得接受基金管理人或基金托管人任何一方单方面提出的对存款进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销、变更印鉴及回款账户信息等可能导致财产转移的操作申请。

(3)约定存款证实书的具体传递交接方式及交接期限。

(4)资金划转过程中需要使用存款银行过渡账户的,存款银行须保证资金在过渡账户中不出现滞留,不被挪用。

2.本基金投资银行存款,必须采用双方认可的方式办理。托管人负责依据管理人提供的银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件办理资金的支付以及存款证实书的接收、保管与交付,切实履行托管职责。托管人负责对存款开户证实书进行保管,不负责对存款开户证实书真伪的辨别,不承担存款开户证实书对应存款的本金及收益的安全。

3.基金管理人投资银行存款或办理存款支取时,应提前书面通知基金托管人,以便基金托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。因发生逾期支取、提前支取或部分提前支取,托管银行不承担相应利息损失及逾期支取手续费。”

6、在“八、基金资产净值计算和会计核算”部分,进行修订:

1) 将“(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2、估值方法”修改为:

“(1)本基金估值采用“摊余成本法”,即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,在剩余存续期内按实际利率法摊销,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估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

(2) 为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净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。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。”

7、在“十一、基金费用”部分，进行修订：

1) 将“（七）基金管理费和基金托管费的复核程序、支付方式和时间”修改为：

“（七）基金管理费、基金托管费和销售服务费的复核程序、支付方式和时间

1. 复核程序

基金托管人对基金管理人计提的基金管理费、基金托管费和销售服务等费用，根据本托管协议和基金合同的有关规定进行复核。

2. 支付方式和时间

基金管理费、基金托管费和销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。”

三、重要提示

1、风险提示：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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者，投资者投资于基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

2、本基金《基金合同》的修订对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。此次修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

3、公司将于公告当日，将修改后的本基金《基金合同》和《托管协议》登载于公司网站。

4、本公告构成本基金《招募说明书》的补充，基金管理人将在届时更新招募说明书时一并更新以上内容。

5、本基金管理人可以在法律法规和本基金《基金合同》规定范围内调整上述有关内容。投资者可登录本基金公司网站（www.huatai-pb.com）查阅修订后的《基金合同》全文或拨打客户服务电话（400-888-0001、（021）38784638）咨询相关事宜。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一八年三月十日