

光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信货币市场基金修订基金合同部分条款的公告

根据 2014 年 8 月 8 日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）及《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》，并根据 2016 年 2 月 1 日实行的《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》的规定，光大保德信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）现经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定对光大保德信货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同中的相关条款做相应修订。该修订事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。除此之外，更新了本公司及基金托管人的相关信息，该修订事项亦对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。现将修订内容公告如下：

一、对本基金原基金合同“一、释义”的修改

1、删去“《信托法》：指《中华人民共和国信托法》；”

2、“《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》；”修改为：“《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；”

3、“《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》；”修改为：“《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；”

4、“《暂行规定》指 2004 年 8 月 16 日由中国证监会与中国人民银行发布并于 2004 年 8 月 16 日起实施的《货币市场基金管理暂行规定》；”修改为：“《管理办法》：指 2015 年 12 月 17 日由中国证监会与中国人民银行发布并于 2016 年 2 月 1 日起实施的《货币市场基金监督管理办法》；”

5、“合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；”修改为：“合格境外机构投资者：符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；”

6、“摊余成本法：指估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益；”修改为：“摊余成本法：指计价对象

以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提损益；”

7、“T+n日：指T日后（不包括T日）第n个工作日；”修改为：“T+n日：指T日后（不包括T日）第n个工作日，n为自然数；”

二、对本基金原基金合同“二、前言”的修改

1、“（一）订立《光大保德信货币市场基金基金合同》的目的、依据和原则”项下的“2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《货币市场基金管理暂行规定》（以下简称《暂行规定》）、《基金管理公司进入银行间市场管理规定》（以下简称《管理规定》）及其它有关规定。”修改为：“2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《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》、《基金管理公司进入银行间同业市场管理规定》（以下简称《管理规定》）及其它有关规定。”

2、“（二）特别提示”项下的

“1.本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《暂行规定》、《试点办法》、《管理规定》、基金合同及其它有关规定发售基金份额，募集基金。”修改为：“1.本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《管理办法》、《管理规定》、基金合同及其它有关规定发售基金份额，募集基金。”

“3.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，但由于投资基金具有一定的风险，因此不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金的最低收益。”修改为：

“3.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，但由于投资基金具有一定的风险，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，因此不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金的最低收益。”

三、对本基金原基金合同“五、基金合同的备案”的修改

“（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中的

“本基金合同生效后，有效基金份额持有人数量达不到 200 人，或基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告；连续 20 个工作日出现上述情况的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。基金存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人在经中国证监会批准有权宣布本基金合同终止。法律法规另有规定的，按其规定办理。”

修改为：

“自 2014 年 8 月 8 日期起的基金存续期间内，如果连续 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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

四、对本基金原基金合同“六、基金份额的申购与赎回”的修改

1、“(六) 申购与赎回的数额限制”项下：

“1.每笔申购申请不得低于 1,000 元。”修改为：“1.各销售机构可以根据自己的业务情况设置本基金的单笔最低申购金额限制，投资者在销售机构办理本基金申购业务时，需遵循销售机构的相关约定。各销售机构对申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。”

“3.基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 1,000 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1,000 份的，在赎回时需一次全部赎回。”修改为：“3.基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 0.01 份基金份额。基金份额持有人在销售机构（网点）最低保留的基金份额余额为 0。”

“4.基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。”修改为：“4.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。”

2、“(七) 本基金的申购费用与赎回费用”中的“本基金不收取申购费用与赎回费用。”修改为：

“本基金一般不收取申购费用与赎回费用，但为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险而征收的强制赎回费用除外。

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，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（超过 1%的部分）征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。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。”

3、“(八) 申购份数与赎回金额的计算方式”中的

“2. 赎回金额的计算

本基金赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份数×基金份额净值

赎回金额计算结果保留到小数点后两位。”

修改为：

“2. 赎回金额的计算

本基金赎回金额的计算方法如下：

不收取强制赎回费时，赎回金额=赎回份数×基金份额净值

收取强制赎回费时，赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值-（赎回份额-T 日基金总份额
×1%）×T 日基金份额净值×1%

赎回金额计算结果保留到小数点后两位。”

4、“(十) 拒绝或暂停申购与赎回或延迟支付赎回款的情形及处理方式”项下的

“1. 暂停或拒绝申购的情形处理

……

发生上述（1）到（5）暂停申购情形时，基金管理人应当 2 日内在指定媒体上刊登暂停申购公告；

发生上述（6）拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。”

修改为：

“1. 暂停或拒绝申购的情形处理

……

(6) 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正偏离度绝对值达到 0.5%时；

发生上述（1）到（6）暂停申购情形时，基金管理人应当 2 日内在指定媒体上刊登暂停申购公告；

发生上述（7）拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。”

“2. 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延迟支付赎回款：”中增加“(4)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终止基金合同的；”

5、增加“(十七)保障不同类别基金份额持有人合法权益的措施

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。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。”

五、对本基金原基金合同“七、基金合同当事人及权利义务”的修改

1、“(一) 基金管理人的基本情况”中的

“.....

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46-47 楼

办公地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46-47 楼

.....

注册资本：人民币 1 亿元

.....

经营范围：发起设立基金，基金管理业务，中国证监会允许的其他业务”

修改为：

“.....

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46 楼

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层

.....

注册资本：人民币 1.6 亿元

.....

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）”

2、“(二) 基金托管人的基本情况”中的

“.....

法定代表人：秦晓

.....

注册资本：人民币 68.48 亿元

.....

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；

外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；基金托管业务；代办开放式基金的认购、申购、赎回业务；受托投资管理托管业务及经中国银监会和中国人民银行批准的其他业务。

”修改为：

“.....

法定代表人：李建红

.....

注册资本：人民币 252.20 亿元

.....

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。”

六、对本基金原基金合同“八、基金份额持有人大会”的修改

1、“(三) 召集方式”中的

“3. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

.....

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。”

修改为：

“3. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

.....

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开，并告知基金管理人，基金管理人应当配合。”

2、“(五) 开会方式”中增加

“3. 重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第 1 款第（2）项 B、第 2 款第（4）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人参加，方可召开。”

3、“(六) 议事内容与程序”中的“2.议事程序”中的

“(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序和注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经律师见证或公证员公证后形成大会决议。大会召集人应当在决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案或核准。

.....

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前 30 天公布提案；在通知的表决截止日期后第二天由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关全程予以公证，形成决议并在 5 日之内报中国证监会备案或核准。”

修改为：

“(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序和注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经律师见证或公证员公证后形成大会决议。大会召集人应当在决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

.....

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前 30 天公布提案；在通知的表决截止日期后第二天由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关全程予以公证，形成决议并在 5 日之内报中国证监会备案。”

4、“(七) 表决”中的“2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：”中的“(2) 特别决议，特别决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上

通过方可作出。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。”修改为：“(2) 特别决议，特别决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并等重大事项必须以特别决议通过方为有效。”

5、“(九) 生效与公告”中的“基金份额持有人大会的召集人自决议做出之日起 5 日内报中国证监会核准或备案，经中国证监会依法核准或出具无异议意见之日起生效。”修改为：“基金份额持有人大会的召集人自决议做出之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。”

6、增加“(十) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。”

七、对本基金原基金合同“九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序”的修改

1、“(二) 基金管理人、基金托管人的更换程序”项下的

“1. 更换基金管理人的程序

……

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后六个月内对被提名的新任基金管理人形成决议；

(3) 核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准；

(4) 审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告同时报国务院证券监督管理机构备案；”

修改为：

“1. 更换基金管理人的程序

……

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后六个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；

(3) 备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；

(4) 审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告同时报中国证监会备案；”

“2. 更换基金托管人的程序

.....

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后六个月内对被提名的新任基金托管人形成决议；

(3) 核准：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须经中国证监会核准；”

修改为：

“2. 更换基金托管人的程序

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后六个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；

(3) 备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；”

2、增加“3. 本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。”

八、对本基金原基金合同“十一、基金份额的登记”的修改

“(二) 基金注册登记机构承担如下职责和义务：”中的“2.保管基金份额持有人开户资料、申购与赎回交易资料与基金份额持有人名册等业务记录 15 年以上；”修改为：“2.妥善保存登记数据，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二十年；”

九、对本基金原基金合同“十二、基金的投资”的修改

1、“(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的短期金融工具，目前主要包括现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、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）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；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。”

修改为：

“(二) 投资范围

本基金的投资范围包括：

1. 现金；

2. 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（或简称“央行票据”）、同业存单；

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；

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。”

2、“(四) 平均剩余期限的计算方法”项下的

“本基金按以下方法计算投资组合平均剩余期限，其中各类资产、负债及回购的剩余期限按证监会相关规定确定：

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

修改为：

“1.计算公式

投资组合平均剩余期限的计算公式为：

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

投资组合平均剩余存续期限的计算公式为：

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

2. 各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

(1) 银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限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限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限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限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限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限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限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限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：

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。

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。

(6) 对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。

如法律法规或中国证监会对剩余期限、剩余存续期限计算方法另有规定的从其规定。”

3、“(七) 投资限制”中的

- “1. 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
 2. 与本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
 3. 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%；
 4. 在全国银行间债券市场中的债券回购最长期限为一年，债券回购到期后不展期；
 5. 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的 20% 的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整；
 6. 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 180 天；
 7. 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%；
 8. 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；
 9. 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，暂不投资于交易所短期债券；
 10. 法律法规及监管机关规定的其他投资限制。法律法规和监管机关另有规定时，从其规定。
- 本基金于基金合同生效之日起一个月内达到上述规定。因基金规模变动，市场剧烈变化或其它不可抗力因素导致投资组合不符合上述 1—3 项规定不在限制之内，但基金管理人应在十个交易日内进行调整，以使投资组合符合上述规定。法律法规和监管机关另有规定时，从其规定。”

修改为：

- “1.与本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

2. 投资于固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但如果基金投资有存款期限但协议中约定可以提前支取的银行存款，不受该比例限制；

3. 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，合计不得超过基金资产净值的 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，合计不得超过基金资产净值的 5%；

4. 在全国银行间债券市场中的债券回购最长期限为一年，债券回购到期后不展期；

5. 除发生巨额赎回情形、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%；

6. 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；

7. 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%；

8. 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%；

9. 本基金管理人管理的全部证券投资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%；

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；本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级；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，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

11. 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

12. 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的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；

13. 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%；

14. 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%；

15. 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%；

16. 法律法规及监管机关规定的其他投资限制。法律法规和监管机关另有规定时，从其规定。

本基金于基金合同生效之日起一个月内达到上述规定。除上述（6）、（10）、（13）外，因基金规模变动，市场剧烈变化或其它不可抗力因素导致投资组合不符合上述规定的，但基金管理人应在十个交易日内进行调整，以使投资组合符合上述规定，但中国证监会规定的特殊情形除

外。但自 2016 年 2 月 1 日起，本基金投资组合中已持有的金融工具及比例不符合《货币市场基金监督管理办法》规定的，可以在《货币市场基金监督管理办法》施行之日起一年内调整；投资组合中已有的流动性资产比例不符合上述第（14）、（15）项规定的，可以在《货币市场基金监督管理办法》施行之日起 6 个月内调整。但新投资的金融工具及比例，自《货币市场基金监督管理办法》施行之日起应符合要求。

法律法规和监管机关另有规定时，从其规定。”

4、“(八) 禁止行为”中的

“为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1. 投资于股票；
2. 投资于可转换债券；
3. 投资于剩余期限超过 397 天的债券；
4. 投资于信用等级在 AAA 级以下的企业债券；
5. 本基金不得与基金管理人的股东进行交易，不得通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数；
6. 本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；
7. 承销证券；
8. 向他人贷款或者提供担保；
9. 从事承担无限责任的投资；
10. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
11. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
12. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他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；
13. 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；
14. 法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。法律法规另有规定时，从其规定。”

修改为：

“为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1. 投资于股票；
2. 投资于可转换债券、可交换债券；
3. 投资于信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具；
4. 本基金不得投资于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；

5. 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

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。

法律法规另有规定时，从其规定。”

十、对本基金原基金合同“十四、基金资产的估值”的修改

1、“(四) 估值方法”项下的

“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，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。”修改为：“1、本基金估值采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。”

“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，采用市场利率或交易价格，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的一定幅度时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害。”修改为：“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，采用市场利率或交易价格，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 个工作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 个工作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，或者履行适当程序后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。”

2、“(八) 特殊情形的处理”中的“2、由于证券交易场所或登记结算公司发送的数据错误，或战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值及收益率计算错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影

响。”修改为：“2、由于证券交易场所或登记结算公司发送的数据错误，或战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值及收益率计算错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。”

十一、对本基金原基金合同“十八、基金的信息披露”的修改

1、“(三) 基金临时信息披露”中的

“……

11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

……”

修改为：

“……

11. 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

……

19. 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%、正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%的情形；”

十二、对本基金原基金合同“十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的修改

“(一) 基金合同的变更”中的“1. 涉及本基金合同第八条第(二)款第1项规定的事项，须变更基金合同的，应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准，自核准或备案之日起生效。”修改为：“1. 涉及本基金合同第八条第(二)款第1项规定的事项，须变更基金合同的，应经基金份额持有人大会决议通过。关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后两个工作日内在指定媒体公告。”

十三、对本基金原基金合同“二十一、争议的处理”的修改

“……本基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议应当通过协商或者调解解决，协商或者调解不能解决的，可将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会华东分会并根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。”修改为：“……本基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议应当通过协商或者调解解决，协商或者调解不能解决的，可将争议提交中国国际经济贸易仲

裁委员会上海分会并根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。”

此外，本公司根据上述修订对本基金《托管协议》涉及前述内容的章节进行了修改；本公司将在更新的《光大保德信货币市场基金招募说明书》中，对上述内容进行相应修改。

投资者可拨打光大保德信基金管理有限公司客户服务电话：021-80262888，400-820-2888，或登录公司网站 www.epf.com.cn，了解详情。

特此公告。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年十一月十九日