

东吴基金管理有限公司关于修改

“东吴货币市场证券投资基金”基金合同和托管协议的公告

由中国农业银行托管，东吴基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）管理的“东吴货币市场证券投资基金”（以下简称“本基金”）已于 2010 年 5 月 11 日正式成立。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》、“关于实施《货币市场基金监督管理办法》有关问题的规定”、《东吴货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）以及《东吴货币市场证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的有关规定，经与本基金基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人拟对本基金《基金合同》和《托管协议》等法律文件相关内容进行修改。

本次《基金合同》修改因相关法律法规变动引起，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，符合本基金《基金合同》的约定，无需召开基金份额持有人大会。

现将本基金《基金合同》及《托管协议》修改内容公告如下：

一、基金合同的修订内容:

章节	原基金合同	修订基金合同
前言	<p>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》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》”)和其他有关法律法规。</p>	<p>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》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》和其他有关法律法规。</p>
前言	<p>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, 但不保证投资于本基金一定盈利, 也不保证最低收益。</p>	<p>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, 但不保证投资于本基金一定盈利, 也不保证最低收益。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。</p>
释义	<p>9、《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, 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》及颁布机关对其不时作出的修订</p>	<p>9、《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, 经 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修订, 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</p>

	<p>12、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及其不时作出的修订</p>	<p>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作出的修订</p> <p>12、《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》及其不时作出的修订</p> <p>13、《管理办法》：指中国证监会、中国人民银行2015年12月17日颁布，2016年2月1日实施的《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</p>
<p>释义</p>	<p>51、摊余成本法：指估值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，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益</p>	<p>52、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，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益</p>
<p>基金备案</p>	<p>(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20</p>	<p>(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内，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</p>

	<p>个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。</p>	<p>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。</p>
<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>(五) 申购和赎回的金额</p>	<p>(五) 申购和赎回的金额</p> <p>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。</p>
<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、本基金的申购费率和赎回费率均为 0%。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。</p>	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金的申购费率和赎回费率均为 0%。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。</p> <p>6、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</p>

		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。
基金份额的申购与赎回	(七) 拒绝或暂停申购的情形	(七) 拒绝或暂停申购的情形 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正偏离度绝对值达到或超过 0.5% 时。
基金份额的申购与赎回 (P19)	(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。	(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。
基金份额的申购与赎回		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。
基金合同当事人及权利义务	1、基金管理人简况 法定代表人：徐建平	1、基金管理人简况 法定代表人：王炯
基金合同当事人及权利义务	1、基金托管人简况 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 注册资本：2600 亿元人民币	1、基金托管人简况 法定代表人：周慕冰 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：32,479,411.7 万元人

		人民币
<p style="text-align: center;">基金份额持有人大会</p>	<p>(三) 召集人和召集方式</p> <p>2、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 10 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 60 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。</p> <p>3、代表基金份额 10%以上（以上含本数，下同）的基金份额持有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 10 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 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自</p>	<p>(三) 召集人和召集方式</p> <p>2、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 10 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 60 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 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p> <p>3、代表基金份额 10%以上（以上含本数，下同）的基金份额持有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 10 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 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 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</p>

	收到书面提议之日起 10 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 60 日内召开。	管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
基金份额持有人大会	<p>(2) 特别决议</p> <p>特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。</p> <p>3、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。</p>	<p>(2) 特别决议</p> <p>特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同、本基金与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。</p> <p>3、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。</p>
基金份额持有人大会	<p>(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式</p> <p>1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。</p>	<p>(九) 基金份额持有人大会决议的公告时间、方式</p> <p>1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，并在生效后方可执行。</p>

<p>基金管理人、 基金托管人的 更换条件和程 序</p>	<p>1、基金管理人的更换条件 有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止：</p>	<p>1、基金管理人的更换条件 有下列情形之一的，基金管理人 职责终止：</p>
<p>基金管理人、 基金托管人的 更换条件和程 序</p>	<p>2、基金管理人的更换程序 (3) 核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人，更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行； (6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上公告；</p>	<p>2、基金管理人的更换程序 (3) 备案：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人，更换基金管理人的基金份额持有人大会决议须经中国证监会备案； (6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人决议生效后依照有关规定在指定媒体上公告；</p>
<p>基金管理人、 基金托管人的 更换条件和程 序</p>	<p>1、基金托管人的更换条件 有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止： 2、基金托管人的更换程序 (3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行； (6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上公告。 (三) 基金管理人与基金托管人</p>	<p>1、基金托管人的更换条件 有下列情形之一的，基金托管人 职责终止： 2、基金托管人的更换程序 (3) 备案：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议须经中国证监会备案； (6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人更换基金托管人决议生效后依照有关规定在指定媒体上公告。 (三) 基金管理人与基金托管人同 时更换</p>

	<p>同时更换</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获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上联合公告。</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生效后依照有关规定在指定媒体上联合公告。</p>
基金份额的注册登记	<p>(四)注册登记机构承担如下义务：</p> <p>3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回与转换等业务记录 15 年以上；</p>	<p>(四)注册登记机构承担如下义务：</p> <p>3、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；</p>
基金的投资	<p>(三)投资范围</p> <p>1、现金；</p> <p>2、通知存款；</p> <p>3、短期融资券；</p> <p>4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；</p> <p>5、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；</p> <p>6、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；</p> <p>7、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；</p> <p>8、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；</p>	<p>(三)投资范围</p> <p>现金，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，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、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。</p>

	<p>9、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。</p>	
<p>基金的投资</p>	<p>1、组合限制</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 120 天；</p> <p>(2) 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>(3) 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 个工作日内进行调整；</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</p>	<p>1、组合限制</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 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；</p> <p>(2) 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%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 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) 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>(5) 本基金投资于有固定期限的银行存款（不包括本基金投资于有存款期限，但根据协议可以提前支取的银行存款）的比例，不得超过基金资产净值的 30%；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</p>

<p>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%；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>(8) 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>(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%；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>(11) 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的信用级别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；</p> <p>(12) 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>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%；</p> <p>(6) 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>(7) 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>(8) 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>(9) 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) 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%；</p> <p>(11) 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%；</p> <p>(12) 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的信用级别应不低于国内信用评级机</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。</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。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 个工作日内对其予以全部减持。</p> <p>如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因</p>	<p>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；</p> <p>(13) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(14) 法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。</p> <p>除第 (1)、(6)、(12) 外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
--	--	--

	素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的， 除第(3)、(11)和(12)项外 ，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。	
基金的投资	<p>2、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)剩余期限超过 397 天的债券；</p> <p>(4)信用等级在 AAA 级 以下的企业债券；</p> <p>(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；</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、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p>	<p>2、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+级 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>
基金的投资	(九)投资组合平均剩余期限的计算方法	(九)投资组合平均剩余期限与 平均剩余存续期 的计算方法
基金的投资	<p>1. 计算公式其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产 (含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限</p>	<p>1. 计算公式</p> <p>其中：投资于金融工具产生的资产包括现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、同业存单、逆回购、中央银行票据，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债</p>

	<p>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、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。</p>	<p>务融资工具、资产支持证券、买断式回购产生的待回购债券或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>基金的投资</p>	<p>2、各类资产和负债剩余期限的确定方法</p> <p>(1) 银行存款、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易日的剩余交易日天数计算；买断式回购履约金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>(2) 一年以内(含一年) 银行存款、大额存单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一个利率调整日的实际剩余天数计算。</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>2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定方法</p> <p>(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易日的剩余交易日天数计算；</p> <p>(2) 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；</p> <p>(3) 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：</p> <p>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</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>对其他金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，参照行业公认的方法或者中国证监会规定的方法计算其剩余期限。</p>	<p>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；</p> <p>(4) 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。</p> <p>(5) 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。</p> <p>(6) 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。</p> <p>(7) 买断式回购产生的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。</p> <p>(8) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>对其他金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，参照行业公认的方法或者中国证监会规定的方法计算其剩余期限和剩余存续期限。</p> <p>平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限和剩余存续期限计算方法另有规定的从其规定。</p>
基金资产的估	(四) 估值方法	(四) 估值方法

<p>值</p>	<p>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，在剩余存续期内平均摊销，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。</p>	<p>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。</p>
<p>基金资产的估值</p>	<p>(四) 估值方法</p> <p>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“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达到或超过的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5% 的情形，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的公允价值。</p>	<p>(四) 估值方法</p> <p>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</p>

		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。
基金的信息披露	(25) 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；	(25) 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%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；
基金的信息披露	10、基金份额持有人大会决议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。	10、基金份额持有人大会决议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。
基金合同的变更、终止与基金财产的清算	2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告。 (二) 本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：	2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告。 (二) 本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同将终止：

(注：同一个修改内容如在全文或者合同摘要多次出现的，不一一列举。)

除以上修订外，根据“关于实施《货币市场基金监督管理办法》有关问题的规定”，对基金合同“十三、基金的投资(九)投资组合平均剩余期限的计算方法 1、计算公式”平均剩余期限和平均剩余存续期限计算公式进行了修订和补充：

原平均剩余期限计算公式为：

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

修改为：

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

添加平均剩余存续期限计算公式：

本基金按下列公式计算平均剩余存续期限：

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

二、基金托管协议修订：

根据上述基金合同的修改，对《东吴货币市场证券投资基金托管协议》相关内容进行同步修订如下：

1、在“一、基金托管协议当事人”部分进行修改：

(1) 将（一）基金管理人 法定代表人修改为“王炯”。

(2) 将（二）基金托管人更新为：

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：中国银监会银监复【2009】13 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；办理票据承兑与贴现；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、

金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；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；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

2、在“三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”部分进行如下修改：

(1) 将“本基金投资于法律法规允许投资的金融工具”做如下修改：现金，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，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、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“基金的投资组合将遵循以下限制：”做如下修改：

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) 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%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

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；

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%；

5) 本基金投资于有固定期限的银行存款（不包括本基金投资于有存款期限，但根据协议可以提前支取的银行存款）的比例，不得超过基金资产净值的30%；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%；

6) 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%;

7) 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%;

8) 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%;

9) 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%;

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%;

11) 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%;

12) 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的信用级别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;

13) 基金资产总值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。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。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。

除第(1)、(6)、(12)外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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,基金管理人应当在 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。法律法规另有规定的,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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

3、在“八、基金资产净值计算和会计核算”部分进行如下修改:

将“2、估值方法”做如下修改:

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。

4、在“十四、基金管理人和基金托管人的更换”部分进行如下修改：

(1) 将“1、基金管理人的更换条件”做如下修改：有下列情形之一的，基金管理人职责终止

(2) 将“2、基金管理人的更换程序”做如下修改：

1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或者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；

2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

3) 备案：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人。更换基金管理人的基金份额持有人大会决议须经中国证监会备案；

4) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值；

5) 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；审计费用在基金财产中列支；

6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人决议生效后依照有关规定在指定媒体上公告；

7)基金名称变更：基金管理人退任后，应原任基金管理人要求，本基金应替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

(3) 将“(二)基金托管人的更换”做如下修改：

1、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 1)基金托管人被依法取消其基金托管资格的；
- 2)基金托管人解散、依法撤销或依法宣布破产；
- 3)基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- 4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金托管人的更换程序

1)提名：新任基金托管人由基金管理人或者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；

2)决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议；

3)备案：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人。更换基金托管人的基金份额持有人大会决议须经中国证监会备案；

4)交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时与新任基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值；

5)审计：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用从基金财产中列支；

6)公告：基金托管人更换后，由基金管理人更换基金托管人决议生效后依照有关规定在指定媒体上公告。

3、基金管理人与基金托管人同时更换

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；

2)基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

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生效后依照有关规定在指定媒体上联合公告。

5、在“十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算”部分修改“

将“(一)托管协议的变更程序”做如下修改

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不

得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

三、重要提示

1、本基金将在最近一次更新招募说明书及摘要时对上述修改内容进行更新。

2、本公司将在网站上公布经修改后的《基金合同》和《托管协议》。本公告的解释权归东吴基金管理有限公司。投资者如对上述事项有任何疑问，可以登录本公司网站（www.scfunds.com.cn）或拨打客户服务电话（400-821-0588）了解详情。

四、风险提示

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。基金的过往业绩不代表未来表现，敬请投资者注意投资风险。投资者投资于基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等相关法律文件，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

东吴基金管理有限公司

2016年12月17日