

嘉合基金管理有限公司关于嘉合货币市场基金修改基金合同及托管协议的公告

嘉合基金管理有限公司（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，对本公司管理的嘉合货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同、托管协议等作相应修改，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《<嘉合货币市场基金基金合同>条款修改对照表》，本基金托管协议的修改内容详见附件《<嘉合货币市场基金托管协议>条款修改对照表》。本公司将在网站上公布经修改后的嘉合货币市场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（<http://www.haoamc.com>）或拨打本公司的客户服务电话 400-060-3299（免长途话费）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。

嘉合基金管理有限公司
二〇一八年三月二十九日

附件：

- 1、《<嘉合货币市场基金基金合同>条款修改对照表》
- 2、《<嘉合货币市场基金托管协议>条款修改对照表》

附件《嘉合货币市场基金基金合同》条款修改对照表

章节	原合同条款	修改后条款	修改理由
前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>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》”)、《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》、《关于实施<货币市场基金监督管理办法>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>》和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>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》”)、《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》、《关于实施<货币市场基金监督管理办法>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>》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>(以下简称“《流动性规定》”))和其他有关法律法规。</p>	补充本基金适用的法律依据。
释义	无	<p><u>13、《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</u></p>	补充流动性规定的定义。
释义	无	<p><u>55、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</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第 40 条，补充流动性受限资产定义。

		<p><u>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</u></p>	
基 金 份 额 的 申 购 与 赎 回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>无</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>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>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。</p> <p>5、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>6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p>	根据《流动性风险规定》第 19 条补充
基 金 份 额 的 申 购 与 赎 回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、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。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。基金管理人与基金托管人</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、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。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。基金管理人与基金托管人</p>	根据《流动性风险规定》第 31 条的规定补充。

	<p>系统性风险，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。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。</p>	<p>协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外；<u>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资产。</u></p>	
基金份额的申购与赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>4、基金管理人认为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。</p> <p>.....</p> <p>无</p> <p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9 项暂停申购情形之一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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>4、基金管理人认为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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</p> <p>.....</p> <p><u>9、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%的情形时。出现上述情形时，基金管理人有权将上述申请全部或部分确认失败。</u></p> <p><u>10、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限时。</u></p> <p><u>11、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，基金管理人应当采取暂停接受申购申请的措施。</u></p>	根据《流动性风险规定》第 19、24 条补充拒绝或暂停申购的情形。

	<p>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。</p>	<p>12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、11、12项暂停申购情形之一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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项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。</p>	
基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 无	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>8、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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</p>	根据《流动性风险规定》第24条的规定补充应当暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形。
基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2)部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成</p>	根据《流动性风险规定》第21条第2款的规定修改

		<p>较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p><u>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人的剩余赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请按照前述条款处理。</u></p>	
基 金 合 同 当 事 人 及	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>注册地址：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室</p>	更新基金管理人、基金托管人信息。

权利义务	<p>法定代表人：徐岱 注册资本：10000 万元</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：姜建清 注册资本：人民币 349,018,545,827 元</p>	<p>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 座 法定代表人：郝艳芬 注册资本：11000 万元</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：易会满 注册资本：人民币 34932123.46 万元</p>	
基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</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>无</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>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>.....</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</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><u>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。</u></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>.....</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 17、30、32、34 条删除并补充。</p>

	<p>(3) 本基金投资组合中的现金、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%; 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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不得低于 10%; 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%; 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>无</p>	<p>(3) 本基金投资组合中的现金、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>(4) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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不得低于 10%;</p> <p>(5) 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>(6) 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>.....</p> <p><u>(14) 本基金前 10 名份额持有人的持有份额（不包括基金管理人固有资金投资的基金份额）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%;</u></p> <p><u>(15) 本基金前 10 名份额持有人的持有份额（不包括基金管理人固有资金投资的基金份额）合计超过基金总份额的 20%时, 本基金投资组合的平</u></p>
--	--	---

	<p><u>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%；</u></p> <p><u>(16) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资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%；</u></p> <p><u>(17) 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；</u></p> <p><u>(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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；</u></p> <p><u>(19) 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</u></p>
--	---

	<p>(11) 法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>.....</p> <p>除上述另有约定外，因证券市场波动、债券发行人合并、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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>的投资范围保持一致；</u></p> <p><u>(20)</u> 法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>.....</p> <p>除上述<u>第 (3)、(12)、(18)、(19)</u> 项外，因证券市场波动、债券发行人合并、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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	
基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p>	根据《流动性风险规定》第 24 条补充。。

	<p>无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p><u>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，基金管理人与基金托管人协商一致的；</u></p> <p><u>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</u></p>	
基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定网站上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，分别报中国证监会和基金管理人。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定网站上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人。</p>	根据《流动性风险规定》第 26 条及第 27 条补充定期报告的内容。

	<p>工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p><u>本基金持续运作过程中，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。</u></p> <p><u>基金运作期间，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基金定期报告“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。</u></p> <p><u>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。</u></p>	
基 金 的 信 息 披 露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（六）临时报告</p> <p>26、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%时情形；当“影子定价”确定的基金资产</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（六）临时报告</p> <p>无</p> <p>26、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<u>负偏离度绝对值达到 0.25%或正负偏离度绝对值达到 0.5%时</u>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</p>	根据《流动性风险规定》第 25、26 条补充临时报告的内容。

	<p>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； 28、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>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； <u>28、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；</u> <u>29、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；</u> <u>30、中国证监会规定的其他事项。</u></p>	
--	---	--	--

附件《嘉合货币市场基金托管协议》条款修改对照表

章节	原合同条款	修改后条款	修改理由
基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人</p> <p>名称: 嘉合基金管理有限公司</p> <p>住所: 上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室</p> <p>法定代表人: 徐岱</p> <p>注册资本: 10000 万元</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>名称: 中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032)</p> <p>法定代表人: 姜建清</p> <p>.....</p> <p>注册资本: 人民币 349,018,545,827 元</p> <p>批准设立机关和设立文号: 国务院《关于中国</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>名称: 嘉合基金管理有限公司</p> <p><u>注册地址:</u> 上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室</p> <p><u>办公地址:</u> 上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 座</p> <p>法定代表人: <u>郝艳芬</u></p> <p>注册资本: 11000 万元</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>名称: 中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人: <u>易会满</u></p> <p>.....</p> <p><u>注册资本: 人民币 34932123.46 万元</u></p> <p>批准设立机关和设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号)</p>	更新基金管理人、基金托管人信息。

	<p>人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)</p> <p>无</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p><u>基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3号</u></p> <p>存续期间：持续经营</p>	
基金托管协议的依据、目的和原则	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》、《关于实施<货币市场基金监督管理办法>有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《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》)、《嘉合货币市场基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定。</p>	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》、《关于实施<货币市场基金监督管理办法>有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、 <u>《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》)</u>、《嘉合货币市场基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定。</p>	补充本基金适用的法律依据。

基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>.....</p> <p>本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>.....</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>无。</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>.....</p> <p>本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>.....</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><u>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。</u></p>	根据《流动性风险规定》第 33 条补充。
基金托管	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p>	根据《流动性风险规定》第 17、30、32、34 条补充

人对基金管理人的业务监督和核查	<p>金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>.....</p> <p>(3) 本基金投资组合中的现金、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%; 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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不得低于 10%; 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%; 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>.....</p> <p>(10) 基金总资产不得超过基金净资产的</p>	<p>.....</p> <p>(3) 本基金投资组合中的现金、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>(4) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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不得低于 10%;</p> <p>(5) 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>(6) 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>.....</p> <p>(14) <u>本基金前 10 名份额持有人的持有份额（不包括基金管理人固有资金投资的基金份额）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%;</u></p> <p>(15) <u>本基金前 10 名份额持有人的持有份额（不包括基金管理人固有资</u></p>	
------------------------	---	---	--

	<p>140%。 无 (11)法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。 …… 除上述另有约定外，因证券市场波动、债券发行人合并、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，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>金投资的基金份额)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%；</u></p> <p><u>(16) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资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%。</u></p> <p><u>(17) 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；</u></p> <p><u>(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的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；</u></p> <p><u>(19) 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</u></p>	
--	---	---	--

	<p><u>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；</u></p> <p><u>(20) 法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。</u></p> <p>.....</p> <p>除上述<u>第 (3)、(12)、(18)、(19)</u> 项外，因证券市场波动、债券发行人合并、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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	
--	--	--