

华夏基金管理有限公司关于修订旗下货币市场基金基金合同的公告

根据《货币市场基金监督管理办法》（证监会令【第 120 号】）、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》（证监会公告[2015]30 号），经协商基金托管人同意，并报中国证监会备案，华夏基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对旗下货币市场基金基金合同中有关基金申购与赎回、基金投资、基金估值等内容进行修订。现将有关情况公告如下：

一、涉及基金

华夏现金增利证券投资基金、华夏货币市场基金、华夏保证金理财货币市场基金、华夏薪金宝货币市场基金、华夏财富宝货币市场基金、华夏收益宝货币市场基金。

二、基金合同的修订

（一）对上述全部货币市场基金基金合同的修订

在订立基金合同的依据中增加《货币市场基金监督管理办法》。

（二）对华夏现金增利证券投资基金基金合同的修订

1、对基金合同“十三、基金的申购与赎回”的修订

（1）将“（五）申购、赎回费用及申购份额与赎回金额的确定”中第 1 点修订为：

“1.本基金不收取申购费用和赎回费用。当基金持有的现金、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，基金管理人可以与基金托管人协商后，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，但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）在“（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”的“1.在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请”中新增第（6）、第（7）点，相关序号相应调整，具体增加内容为：

“（6）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；

（7）为了保护基金份额持有人的合法权益，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；”

(3)在“(八)巨额赎回的认定及处理方式”与“(九)拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”之间增加新段落，定义其序号为“(九)”，本章节相关的序号相应调整，具体增加内容为：

“(九) 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。”

(4)在本章节最后增加“(十一)基金份额转让”，具体增加内容为：

“(十一) 基金份额转让

在条件允许的情况下，基金管理人可以根据相关业务规则受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请。具体由基金管理人提前发布公告。”

2、对基金合同“十八、基金的投资”的修订

(1) 将“(二) 投资范围”修订为：

“(二) 投资范围

包括：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金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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“(六) 投资组合”、“(七) 禁止行为”修订为：

“(六) 投资组合

本基金投资组合符合以下规定：

1.本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

2.本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法参照《货币市场

基金监督管理办法》及相关法律法规的规定执行。如法律法规或监管机构对剩余期限或剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。

3.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。

4.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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 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、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

5.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%；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%。

6.法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

7.本基金在《管理办法》规定的时间内使基金投资比例符合上述 2-5 的规定。

8.因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内，基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述标准。

（七）禁止行为

本基金不得进行如下行为（法律法规或监管部门另有规定的除外）：

1.投资于股票。

2.投资于可转换债券、可交换债券。

3.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。

4.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。

5.投资于中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

6.从事法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

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。”

3、对基金合同“二十一、基金资产计价”的修订

将“（四）计价方法”中第4点修订为：

“4、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。”

（三）对华夏货币市场基金基金合同的修订

1、对基金合同“六、基金份额的申购与赎回”的修订

（1）将“（七）本基金的申购费用与赎回费用”修订为：

“（七）本基金的申购费用与赎回费用

本基金不收取申购费用与赎回费用。当基金持有的现金、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，基金管理人可以与基金托管人协商后，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，但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）在“（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”的“1、暂停或拒绝申购的情形处理”中增加第（5）、第（6）点，相关序号相应调整，具体增加内容为：

“（5）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；

（6）为了保护基金份额持有人的合法权益，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；”

（3）在“（十一）巨额赎回的认定及处理方式”与“（十二）基金的转换”之间增加新段落，定义其序号为“（十二）”，本章节相关的序号相应调整，具体增加内容为：

“（十二）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。”

（4）在本章节最后增加“（十七）基金份额转让”，具体增加内容为：

“（十七）基金份额转让

在条件允许的情况下，基金管理人可以根据相关业务规则受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请。具体由基金管理人提前发布公告。”

2、对基金合同“十二、基金的投资”的修订

（1）将“（三）投资范围”修订为：

“（三）投资范围

本基金投资于具有良好流动性货币市场工具，主要包括以下：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金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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“（六）投资策略”第 3 段修订为：

“根据货币市场利率水平的预测确定组合的平均剩余期限。当预测货币市场利率上升时，适当缩短投资组合的平均剩余期限，预测利率水平降低时，适当延

长投资组合的剩余期限。平均剩余期限决定了组合的风险收益水平，本基金的平均剩余期限控制在 120 天之内。”

(3) 将“(九) 平均剩余到期期限”修订为：

“(九) 平均剩余到期期限

本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法参照《货币市场基金监督管理办法》及相关法律法规的规定执行。如法律法规或监管机构对剩余期限或剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。”

(4) 将“(十) 投资限制”、“(十一) 禁止行为”修订为：

“(十) 投资限制

本基金投资组合应当符合以下规定：

1、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。

2、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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 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、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

3、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%；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%。

4、在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的百分之四十。

5、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，不超过该证券的 10%。

6、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

7、本基金在《管理办法》规定的时间内使基金投资比例符合上述 1-3 的规定。

8、因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出上述规定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。

（十一）禁止行为

本基金不得进行如下行为（法律法规或监管部门另有规定的除外）：

1、投资于股票。

2、投资于可转换债券、可交换债券。

3、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。

4、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。

5、投资于中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

6、从事法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

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。”

3、对基金合同“十四、基金资产的估值”的修订

将“（四）估值方法”中第 4 点修订为：

“4. 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。”

（四）对华夏保证金理财货币市场基金基金合同的修订

1、对基金合同“六、基金份额的申购与赎回”的修订

（1）将“（十）申购和赎回的价格、费用及其用途”中第 2 点修订为：

“2、本基金不收取申购费用与赎回费用。当基金持有的现金、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，基金管理人可以与基金托管人协商后，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，但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）在“（十一）拒绝或暂停申购的情形”中增加第 10、第 11 点，相关序号相应调整，具体增加内容为：

“10、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。

11、为了保护基金份额持有人的合法权益，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。”

同时，将本部分倒数第三段第 1 句修改为“发生上述第 1、2、3、4、8、9、10 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。”

（3）在“（十三）巨额赎回的情形及处理方式”与“（十四）暂停申购或赎回的备案和重新开放申购或赎回的公告”之间增加新段落，定义其序号为“（十四）”，本章节相关的序号相应调整，具体增加内容为：

“（十四）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。”

（4）将“（十八）基金上市交易”修订为“（十九）基金上市交易及基金份额转让”，具体修订内容为：

“（十九）基金上市交易及基金份额转让

在未来系统条件允许的情况下，基金管理人可以根据上海证券交易所相关上市交易规则安排本基金上市交易事宜。具体上市交易安排由基金管理人届时提前发布公告。

在条件允许的情况下，基金管理人也可以根据相关业务规则受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易方式进行份额转让的申请，具体由基金管理人届时提前发布公告。”

2、对基金合同“十二、基金的投资”的修订

（1）将“（二）投资范围”修订为：

“（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，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金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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“（五）投资限制”中第 1 点、第 2 点修订为：

“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）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。

（4）信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具。

（5）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，本基金不受上述规定的限制。

2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法参照《货币市场

基金监督管理办法》及相关法律法规的规定执行。如法律法规或监管机构对剩余期限或剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。

(2) 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。

(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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 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、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

(4) 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%；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%。

(5) 本基金投资的短期融资券及其他非金融企业债务融资工具、债券的信用评级在国内信用评级机构评定的 AA+ 级及以上，或者相当于 AA+ 级及以上的信用级别。

(6) 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%。

(7) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。

(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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。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。

（9）中国证监会规定的其他比例限制。

本基金在《管理办法》规定的时间内使基金投资比例符合上述（1）-（5）的规定。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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。

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、对基金合同“十四、基金资产的估值”的修订

将“（三）估值方法”中第 2 点修订为：

“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。”

（五）对华夏薪金宝货币市场基金、华夏财富宝货币市场基金、华夏收益宝货币市场基金基金合同的修订

1、对基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”的修订

（1）将“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”中第 1 点修订为：

华夏薪金宝货币市场基金：

“1、本基金不收取申购费用和赎回费用。当基金持有的现金、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，基金管理人可以与基金托管人协商后，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，但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。”

华夏财富宝货币市场基金、华夏收益宝货币市场基金：

“1、本基金目前不收取申购费用和赎回费用。当基金持有的现金、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，基金管理人可以与基金托管人协商后，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，但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）在“七、拒绝或暂停申购的情形”中增加第 8、第 9 点，相关序号相应调整，具体增加内容为：

“8、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。

9、为了保护基金份额持有人的合法权益，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。”

同时，将本部分最后一段第 1 句修改为“发生上述第 1、2、3、4、6、7、8 项暂停申购情形且基金管理人决定拒绝或暂停基金投资者的申购申请时，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。”

（3）在“九、巨额赎回的情形及处理方式”与“十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告”之间增加新段落，定义其序号为“十”，本章节相关的序号相应调整，具体增加内容为：

“十、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。”

(4) 在华夏薪金宝货币市场基金、华夏财富宝货币市场基金“十五、基金的冻结和解冻”与“十六”之间增加新段落，根据前述序号调整，定义其序号为“十七”，本章节相关的序号相应调整，具体增加内容为：

“十七、基金份额转让

在条件允许的情况下，基金管理人可以根据相关业务规则受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请。具体由基金管理人提前发布公告。”

2、对基金合同“第十二部分 基金的投资”的修订

(1) 将“二、投资范围”第一段修订为：

“本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括：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金融工具。”

(2) 将“四、投资限制”中第 1 点、第 2 点修订为：

华夏薪金宝货币市场基金：

“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) 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。

(4) 信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具。

(5) 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，本基金不受上述规定的限制。

2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法参照《货币市场基金监督管理办法》及相关法律法规的规定执行。如法律法规或监管机构对剩余期限或剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。

(2) 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。

(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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 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、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

(4) 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%；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%。

(5) 本基金投资的短期融资券及其他非金融企业债务融资工具、债券的信用评级在国内信用评级机构评定的 AA+ 级及以上，或者相当于 AA+ 级及以上的信用级别。

(6) 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%。

(7) 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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。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。

(8) 中国证监会规定的其他比例限制。

本基金在《管理办法》规定的时间内使基金投资比例符合上述（1）-（5）

的规定。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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。

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。”

华夏财富宝货币市场基金：

“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) 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。

(4) 信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具。

(5) 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，本基金不受上述规定的限制。

2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法参照《货币市场基金监督管理办法》及相关法律法规的规定执行。如法律法规或监管机构对剩余期限或剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。

(2) 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。

(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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 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、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

(4) 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%；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%。

(5) 本基金投资的短期融资券及其他非金融企业债务融资工具、债券的信用评级在国内信用评级机构评定的 AA+ 级及以上，或者相当于 AA+ 级及以上的信用级别。

(6) 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%。

(7) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。

(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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。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。

(9) 中国证监会规定的其他比例限制。

本基金在《管理办法》规定的时间内使基金投资比例符合上述（1）-（5）的规定。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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。

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。”

华夏收益宝货币市场基金：

“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）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。

（4）信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具。

（5）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，本基金不受上述规定的限制。

2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天。

基金投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法参照《货币市场基金监督管理办法》及相关法律法规的规定执行。如法律法规或监管机构对剩余期限或剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。

（2）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。

（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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 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、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

（4）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%；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%。

（5）本基金投资的短期融资券及其他非金融企业债务融资工具、债券的信用评级在国内信用评级机构评定的 AA+ 级及以上，或者相当于 AA+ 级及以上的信用级别。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%。

（7）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。

（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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。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。

（9）中国证监会规定的其他比例限制。

本基金在《管理办法》规定的时间内使基金投资比例符合上述（1）-（5）的规定。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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。

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、对基金合同“第十四部分 基金资产估值”的修订

将“三、估值方法”中第2点修订为：

“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。”

本公司将根据修订的基金合同，相应修订上述货币市场基金的托管协议并更新其招募说明书。上述修订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，符合相关法律法规及基金合同的规定。上述修订自公告发布之日起生效。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇一六年八月二十七日