

金鹰基金管理有限公司关于金鹰恒润债券型发起式证券投资基金证 券交易模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，增强金鹰恒润债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，金鹰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《金鹰恒润债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致，决定转换本基金证券交易模式。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易模式转换

自 2023 年 10 月 20 日起，本基金将启动证券交易模式的转换工作。转换后，本基金的证券交易所交易结算将委托证券公司办理，由证券公司履行交易管理职责。

本次证券交易模式转换对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。

二、因转换证券交易模式，拟对《金鹰恒润债券型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）相关条款进行修订，修订内容详见附件。

三、本基金证券交易模式转换完成以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。本公司将根据上述修订情况，在《金鹰恒润债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》中，对上述内容进行相应修改，并将更新后的文件在本公司官网上披露。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《金鹰恒润债券型发起式证券投资基金基金合同》、《金鹰恒润债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

本公司网站：www.gefund.com.cn

本公司客服电话：400-6135-888

五、本公告的解释权归金鹰基金管理有限公司。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司

2023年10月19日

附件：《金鹰恒润债券型发起式证券投资基金托管协议》修订对照表

章节	修订前表述	修订后表述
五、基金财产的保管	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。</p> <p>3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货交易<u>期货</u>账户及其他投资所需账户。</p> <p>5. 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收，托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、<u>证券经纪机构</u>的固有财产。</p> <p>3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户及其他投资所需账户。</p> <p>5. 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。</p>
	<p>(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的本基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。</p>	<p>(四) 基金证券账户和<u>证券交易资金账户</u>的开立和管理</p> <p>4. <u>基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算，并与基金托管人开立的托管账户建立第三方存管关系。第三方存管对应关系一经确定，不得更改，如果必须更改，应由基金管理人发起，经过基金托管人书面确认后，重新建立第三方存管对应关系。</u> <u>基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户、证券交易资金账户，亦不得使用证券账户或证券交易资金账户进行本基金业务以外的活动。</u> <u>本基金通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算。</u></p>

章节	修订前表述	修订后表述
		<p><u>基金管理人承诺证券交易资金账户为主资金账户，不开立任何辅助资金账户；不为证券交易资金账户另行开立银行托管账户以外的其他银行账户。</u></p>
六、指令的发送、确认及执行	<p><u>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送资金划拨及其他款项付款指令，基金托管人执行基金管理人的指令，办理基金名下的资金往来等有关事项。</u></p>	<p><u>基金管理人在运用基金财产时，开展场内证券交易前，基金管理人通过基金托管账户与证券资金账户已建立的第三方存管系统在基金托管户与证券资金账户之间划款，即银证互转。基金管理人向基金托管人发送场外资金划拨及其他款项付款指令，基金托管人执行基金管理人的指令，办理基金名下的资金往来等有关事项。</u></p>
	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1. 指令的发送</p> <p>.....</p> <p><u>对手场内业务，首次进行场内交易前基金管理人应与基金托管人确认已完成交易单元和相关代码设置后方可进行。</u></p> <p>.....</p>	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1. 指令的发送</p>
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 选择证券买卖的证券经营机构</p> <p>基金管理人应设计选择证券买卖的证券经营机构的标准和程序。基金管理人负责选择证券经营机构，<u>租用其交易单元作为基金的专用交易单元。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，基金管理人应提前通知基金托管人，并将被选中证券经营机构提供的《基金用户交易单元变更申请书》及时送达基金托管人，确保基金托管人申请接收结算数据。交易单元保证金由被选中的证券经营机构交付。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、回购成交量和支付的佣金等予以披露，并将该等情况及基金交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人。</u></p>	<p>(一) 选择证券买卖的证券经纪机构、期货经纪机构</p> <p>基金管理人应设计选择代理基金证券买卖的证券经纪机构的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经纪机构，<u>并与其签订证券经纪协议，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可就本基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。基金管理人应将佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人。</u></p> <p><u>基金管理人负责选择代理本基金国债期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、基金合同的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。</u></p>

章节	修订前表述	修订后表述
	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</p> <p>根据《中国证券登记结算有限责任公司结算备付金管理办法》，在每月前3个工作日内，中国证券登记结算有限责任公司对结算参与人的最低结算备付金限额、结算保证金进行重新核算、调整。基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司调整最低结算备付金、结算保证金当日，在资金调节表中反映调整后的最低备付金、结算保证金。基金管理人应预留最低备付金、结算保证金，并根据中国证券登记结算有限责任公司确定的实际下月最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。基金财产清算时有关备付金及保证金划回的事项，应遵循中国证券登记结算有限责任公司有关规定。</p> <p>本基金采用托管人结算模式，基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。场内资金结算由基金托管人根据中国证券登记结算有限责任公司结算数据办理；场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的交易划款指令具体办理。产品销户时备付金、保证金资金划回事宜应遵守中国证券登记结算有限责任公司有关规定。</p> <p>基金托管人正确执行基金管理人发送的有效指令，基金财产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人原因未能及时或正确执行合法合规的有效指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但因不可抗力原因的情况除外。</p> <p>如果因为基金管理人未事先通知基金托管人增加交易单元等事宜，致使基金托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由基金管理人承担；如果因为基金管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成基金资产损失的由基金管理人承担；如果由于基金管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成基金投资清算困难和风险的，基金托管人发现后应立即通知基金管理人，由基金管理人负责解决，由</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p><u>本基金通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金通过期货经纪机构进行的交易由期货经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。基金管理人、基金托管人以及被选择的证券经纪机构应根据有关法律法规及相关业务规则，签订证券经纪服务协议，用以具体明确三方在证券交易资金结算业务中的责任。</u></p> <p><u>对基金管理人的资金划拨指令，基金托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。</u></p> <p><u>采用券商结算模式。本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金汇划，由基金托管人负责办理。</u></p> <p><u>证券经纪机构代理本基金财产与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。</u></p>

章节	修订前表述	修订后表述
	<p>此给基金托管人、基金资产造成的直接损失由基金管理人承担。基金管理人应采取合理、必要措施，确保T日日终有足够的资金头寸完成T+1日的投资交易资金结算；如因基金管理人原因导致资金头寸不足，基金管理人应在T+1日上午12:00前补足透支款项，确保资金清算。如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响基金资产的清算交收及基金托管人与中国证券登记结算有限责任公司之间的一级清算，由此给基金托管人、基金资产造成的直接损失由基金管理人负责。基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时，基金银行账户或资金交收账户（除登记公司收保或冻结资金外）上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间，一般为2个工作小时。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。基金管理人向基金托管人发送要求当日支付的划款指令的最晚时间为每个工作日的15:00。15:00以后收到的指令，托管人应尽力支付，但不保证支付成功。未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>根据中国证券登记结算有限责任公司结算规定，基金管理人在进行融资回购业务时，用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因基金管理人原因造成债券回购交收违约，导致中国证券登记结算有限责任公司对质押券进行处置造成的投资风险和损失由基金管理人承担。</p> <p>2. 交易记录、资金和证券账目核对的时间和方式</p> <p>（1）交易记录的核对</p> <p>基金管理人按日进行交易记录的核对。对外披露基金份额净值之前，必须保证当天所有实际交易记录与基金会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成基金会计核算不完整或</p>	

章节	修订前表述	修订后表述
	<p>不真实，由此导致的损失由基金管理人承担。</p> <p>（2）资金账目的核对</p> <p>基金管理人和基金托管人每个交易日核对资金账目。</p> <p>（3）证券账目的核对</p> <p>基金管理人和基金托管人每个交易日结束后核对基金证券账目，确保双方账目相符。基金管理人和基金托管人每月月末核对实物证券账目。</p>	