

中海基金管理有限公司

关于中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金证券交易结算 模式转换有关事项的公告

公告送出日期：2023年10月13日

为更好地满足广大投资者的投资需求，提升中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的市场竞争力，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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等相关法律法规的规定及《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的约定，中海基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与基金托管人平安银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)协商一致并报中国证监会备案，决定转换本基金的证券交易结算模式，由托管人结算模式改为券商结算模式，并相应修改《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》(以下简称“《托管协议》”)的相关内容，现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自公告之日起，本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换后，本基金参与证券交易所交易的结算将委托证券公司办理，由证券公司履行场内证券交易结算管理职责。

本基金转换证券交易结算模式并相应修改托管协议的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，且符合相关法律法规及《基金合同》的约定，并已报中国证监会备案。

二、《托管协议》的修订内容

章节	原条款内容	修改后条款内容
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人：杨皓鹏 (二) 基金托管人 办公地址：广东省深圳市深南东路	(一) 基金管理人 法定代表人： <u>曾杰</u> (二) 基金托管人 办公地址： <u>广东省深圳市福田区益</u>

	<p>5047号 注册资本：17,170,411,366元</p>	<p>田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼 注册资本：19,405,918,198 元</p>
<p>五、基金财产的保管</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则 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>(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理 1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。 2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。 3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。 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上海分公司、深圳分公司开立结算备付金账户，并代表所托管的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、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。 5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则 1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和<u>证券经纪机构</u>的固有财产；</p> <p>(四) 基金证券账户和<u>证券资金账户</u>的开立和管理 1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。 2. 基金证券账户和<u>证券资金账户</u>的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让基金的任何证券账户和<u>证券资金账户</u>，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。<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> 3. 基金证券账户的开立由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。 4. <u>基金管理人以本基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户，并通知基金托管人。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户，并按照该证券经纪机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</u> 5. <u>交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券公司负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。</u> 6. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从</p>

	<p>事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。</p>	<p>事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。</p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>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。</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交易资金账户已建立的第三方存管系统在基金托管账户与证券交易资金账户之间划款，即银证互转。基金管理人通过基金托管人进行银证互转，由基金管理人向基金托管人发送指令，基金托管人操作。</u></p> <p>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送<u>场外</u>资金划拨及其他款项<u>收付</u>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。</p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(一)选择代理证券买卖的证券经营机构 基金管理人应设计选择代理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，租用其交易单元作为基金的交易单元。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《基金用户交易单位变更申请书》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。</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排 1. 清算与交割 根据《中国证券登记结算有限责任</p>	<p>(一)选择代理证券买卖的<u>证券经纪机构</u> <u>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，由基金管理人与基金托管人及证券经纪机构签订本基金的证券经纪服务协议。基金管理人应制定选择的标准和程序，并负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经纪机构进行考察后确定代理本基金证券买卖的证券经纪机构，并承担相应责任。</u></p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排 1. 清算与交割 <u>本基金通过证券经纪机构进行的交</u></p>

公司《结算备付金管理办法》和《证券结算保证金管理办法》等相关规定，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和结算保证金限额进行重新核算、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和结算保证金当日，在资金流量表中反映最低备付金和结算保证金调整的情况。基金管理人应预留最低备付金和结算保证金，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和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。

如果因为基金托管人自身原因在清算上造成基金财产的损失，应由基金托管人负责赔偿；但因中国人民银行、中国证券登记结算有限责任公司和中央国债登记结算有限责任公司资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非基金托管人的原因造成清算资金无法按时到账的情形，基金托管人可免责；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，由此给基金托管人、本基金造成的直接损失由基金管理人承担。

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。本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金汇划，全部由基金托管人负责办理。如果因为基金托管人自身原因在清算上造成基金财产的直接损失，应由基金托管人负责赔偿。证券经纪机构代理本基金财产与中登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。

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司日前对固定收益平台全部债券品种实行 T+0 预交收制度，因此基金管理人须于 T 日 15:30 之前备足当日上海固定收益平台交易担保交收需支付的资金头寸，以便基金托管人履行 T+0 预交收职责；若有大宗交易，基金管理人还需于 T 日 15:30 之前通知基金托管人交易金额。由于基金管理人的原因导致预交收失败，由此引起的后果由基金管理人承担。基金管理人应采取合理措施，确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于 T+1 日中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的资金结算。若由于基金管理人的原因导致基金托管人交收失败，由此引起的后果由基金管理人承担。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的行权交收日为 T 日，为避免交收失败，基金管理人须在 T 日通知基金托管人并将划款指令传真给基金托管人。对中国证券登记结算有限责任公司实行非担保交收的品种，由于非基金托管人的原因导致交收失败，基金托管人不承担责任。若结算机构的交收规则发生变化，基金托管人和基金管理人应根据新的交收规则作出相应变动，基金管理人应配合基金托管人为完成交收提供必要的帮助。

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，基金托管专户或资金交收账户（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。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。

基金管理人应保证基金托管人、证券经纪机构在执行基金管理人发送的划款指令时，基金托管专户或证券资金账户（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。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。

<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>由于不可抗力原因, 或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等原因, 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错误, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>由于不可抗力原因, 或由于证券交易所、<u>登记结算公司</u>及证券经纪机构发送的数据错误等原因, 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错误, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
-------------------------------	--	---

三、其他需要提示的事项

1、本基金证券交易结算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《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》中, 对相关内容进行相应修改, 并对基金托管人相关信息进行了更新, 并将更新后的文件依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介披露。

本公告未尽事宜, 敬请投资者参见《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

2、投资者可通过本公司客服电话 400-888-9788 或 021-38789788 咨询有关详情, 也可登陆本公司网站 (www.zhfund.com) 获取相关信息。

风险提示:

本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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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。

中海基金管理有限公司

2023年10月13日