

银河基金管理有限公司

关于银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金证券交易 结算模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，增强银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，银河基金管理有限公司（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《银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定转换本基金证券交易结算模式并修订《托管协议》等法律文件。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

1、证券交易结算模式转换

自2023年10月20日起，本基金将启动证券交易结算模式的转换工作，由托管人结算模式改为券商结算模式。证券交易结算模式转换后，本基金的证券交易所交易将委托证券公司办理，由证券公司履行场内证券交易结算职责。

2、证券交易结算模式转换的生效时间

本公司将视证券交易结算模式转换情况，就证券交易结算模式转换完成并生效的时间另行公告，敬请投资者关注本公司届时发布的相关公告。

二、其他调整事项

本基金除转换证券交易结算模式事项外，还将根据实际情况更新相关法律文件中基金管理人、基金托管人基本信息。

三、《托管协议》等法律文件的修订

本公司根据前述调整事项对本基金的《基金合同》、《托管协议》进行了必要的修订，其中，《基金合同》仅涉及基金管理人、基金托管人基本信息的更新，其他内容不涉及修订，《托管协议》的具体修订内容请详见本公告附件；同时，本公司将按规定更新《银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，

并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定进行披露。

本基金前述调整事项及对法律文件相应内容的修订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。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《基金合同》、《托管协议》、《银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》、《银河沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）》等相关文件。

四、其他事项

1、本公司将依照《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公告本基金修订后的基金合同、托管协议、招募说明书（更新）及基金产品资料概要（更新）。投资者可通过本公司网站（www.cgf.cn）或中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅本基金修订后的法律文件。

2、投资者可通过以下途径咨询有关详情

客户服务电话：400-820-0860

网址：www.cgf.cn

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者做出投资决策之前，请仔细阅读基金合同、托管协议、基金招募说明书和基金产品资料概要等产品法律文件，充分认识基金的风险收益特征和产品特性，认真考虑基金存在的各项风险因素，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售适当性意见的基础上，理性判断并谨慎做出投资决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金管理人、基金托管人、基金销售机构及相关机构不对基金投资收益做出任何承诺或保证。

本公告的解释权归银河基金管理有限公司。

特此公告。

银河基金管理有限公司

2023年10月20日

附件 1：银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议修订对照表

修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	
(一) 基金管理人 法定代表人： 刘立达	(一) 基金管理人 法定代表人： 宋卫刚
(二) 基金托管人 法定代表人： 易会满	(二) 基金托管人 法定代表人： 陈四清
五、基金财产保管	
(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。	(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、 <u>证券/期货经纪机构</u> 的固有财产。
<p>(四) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理</p> <p>.....</p> <p>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/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。</p> <p>基金证券账户的开立和使用，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和未经对方同意擅自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。</p>	<p>(四) 基金证券账户与证券资金账户的开设和管理</p> <p>.....</p> <p><u>基金管理人负责开立本基金的证券资金账户，并配合基金托管人办理客户交易结算签约手续。证券资金账户开立后，基金管理人将证券资金账户的开户资料（复印件）加盖业务专用章后交基金托管人留存。基金管理人<u>对证券资金账户不设置每笔汇划资金上限和当日累计汇划资金上限。证券资金账户与托管账户之间的资金划拨由基金管理人向基金托管人发送银证转账指令（托管账户与证券资金账户之间资金往来划拨的指令），托管人按照管理人的有效银证转账指令完成资金划拨。</u></u></p> <p>基金证券账户、<u>证券资金账户</u>的<u>开立和使用</u>，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和未经对方同意擅自转让基金的任何<u>证券账户、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。</p> <p><u>本基金场内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本基金开设的<u>证券资金账户</u>中，场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的<u>证券经营机构</u>负责。基金托管人不负责办理场内的<u>证券交易资金清算</u>，也不负责保管<u>证券资金账户</u>内存放的资金。</u></p>

六、指令的发送、确认和执行	
无	<p>基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易前，基金管理人通过托管账户与证券资金账户已建立的第三方存管系统在托管账户与证券资金账户之间划款，即银证转账。基金管理人通过基金托管人进行银证转账，由基金管理人向基金托管人发送指令，基金托管人操作。</p> <p>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送场外资金划拨及其他款项收付指令，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>
七、交易及清算交收安排	
<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构。选择的标准是：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、资历雄厚，信誉良好。 2、财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。 3、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。 4、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。 5、研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。 <p>基金管理人负责根据以上标准以及内部管理制度对有关证券经营机构进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经营机构，并承担相应责任。基金管理人和被选择的证券经营机构签订交易单元使用协议，由基金管理人通知基金托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序</p> <p>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被选择的证券经纪商签订本基金的证券经纪服务协议，明确三方在本基金进行证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。</p>

<p>基金管理人应及时将基金专用交易单元号、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</p> <p>1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任</p> <p>基金管理人与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则,签订《证券交易资金结算协议》,用以具体明确基金管理人与基金托管人在证券交易资金结算业务中的责任。</p> <p>本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割,全部由基金托管人负责办理。</p> <p>本基金证券投资的清算交割,由基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、其他相关登记结算机构及清算代理银行办理。如果因基金托管人原因在清算和交收中造成基金财产的损失,应由基金托管人负责赔偿基金的损失;如果因为基金管理人违反法律法规的规定进行证券投资或违反双方签订的《证券交易资金结算协议》而造成基金投资清算困难和风险的,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,由此给基金造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序</p> <p>基金托管人在履行监督职能时,如果发现基金投资证券过程中出现超买或超卖现象,应立即提醒基金管理人,由基金管理人负责解决,由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。如果非因基金托管人原因发生超买行为,基金管理人必须于 T+1 日上午 10 时之前划拨资金,用以完成清算交收。</p> <p>3、基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序</p> <p>基金管理人应确保基金托管人在执行基金管理人发送的指令时,有足够的头寸进行交收。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</p>	<p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <p><u>本基金涉及的交易所场内证券交易由证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算;本基金其他场外证券交易由基金托管人负责结算。基金托管人、基金管理人及证券经纪商应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司制定的相关业务规则 and 规定。</u></p> <p><u>证券经纪商代理本基金与中国证券登记结算有限责任公司完成场内证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务,并承担由证券经纪商原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任;由于基金管理人的原因导致无法按时支付证券清算款,由此造成的损失由基金管理人承担。如果因基金托管人原因在清算和交收中造成基金财产的损失,应由基金托管人负责赔偿基金的直接经济损失。</u></p> <p><u>本基金涉及的所有场外交易的资金清算交割全部由基金托管人负责办理。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>本基金涉及的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。基金场外交易用于交收的资金头寸不足时,基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令,但应及时通知基金管理人。</u></p> <p><u>本基金投资于期货发生的资金交割清算由基金管理人选定的期货经纪公司负责办理,基金托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责和交收职责,基金管理人应在期货经纪协议或其它协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任和交收责任。</u></p> <p><u>基金管理人和基金托管人从证券经纪商处接收本基金的场内交易电子清算</u></p>

令时应充分考虑基金托管人的划款处理所需的合理时间。如由于基金管理人的原因导致无法按时支付证券清算款，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。

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》、基金托管协议的指令不得拖延或拒绝执行。如由于基金托管人的原因导致基金无法按时支付证券清算款，由此给基金造成的损失由基金托管人承担。

数据，基金管理人、基金托管人和证券经纪商之间的场内交易电子清算数据的传输采用专线（深证通）或双方认可的其他方式。关于交易所数据传输和接收的具体相关条款、各方当事人权利、责任及义务的具体约定以三方签署的经纪服务协议为准。