

大成基金管理有限公司关于大成策略回报混合型证券投资基金 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，大成基金管理有限公司（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《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，决定对大成策略回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）转换证券交易模式。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易模式转换

自 2023 年 11 月 9 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《大成策略回报混合型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，修订内容如下：

章节	修订前表述	修订后表述
五 基金财产的保管	（一）基金财产保管的原则 2、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、基金托管人和 <u>证券经营机构</u> 的固有财产。
	（五）基金证券账户和 <u>结算备付金</u> 账户的开立和管理 3. 基金托管人以自身法人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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的相关基金在交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。 4. 基金证券账户和基金托管人结算备付金账户的开立和管理可以根据当时市场的通行做法办理或变更，而 <u>不限于上述关于账户开设、使用的规定。</u>	（五）基金证券账户和 <u>证券资金</u> 账户的开立和管理 <u>4. 证券资金账户的开立和管理</u> <u>基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构营业网点开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立证券资金账户，并按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易的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选择的证券经营机构负责。证券资金账户内的资金，只能通过证</u>

		<p><u>转账方式将资金划转至基金托管资金账户，不得将资金划转至任何其他银行账户。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></p>
六、指令的发送、确认及执行	<p>(二) 指令的内容</p> <p>指令是基金管理人在运作基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及投资指令。相关登记结算公司向基金托管人发送的结算通知视为基金管理人向基金托管人发出的指令。</p>	<p>(二) 指令的内容</p> <p><u>基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易时，应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实现基金托管账户与证券资金账户之间的资金划转，即银证互转。基金管理人在运用基金财产开展场外交易时，应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。</u>相关登记结算公司向基金托管人发送的结算通知视为基金管理人向基金托管人发出的指令。</p>
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 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</p> <p>2. 选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p> <p>基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议，并按照法律法规的规定向中国证监会报告。基金管理人应将委托协议（或席位租用协议）的原件按本协议约定的时间送交基金托管人。</p>	<p>(一) 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</p> <p>2. 选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p> <p>基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。<u>由基金管理人与基金托管人及被选择的证券经营机构签订本基金的证券经纪服务协议，就基金参与场内证券交易、结算等具体事项另行签订协议，并由基金管理人提前通知基金托管人，并按法律法规要求在法定信息披露报告中披露有关内容。</u></p>

<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割，由基金托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。</p> <p>2. 对于本基金投资于证券所发生的场内交易，由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的，由责任方承担相应的责任。基金管理人同意在发生以上情形时，基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理；对于场外交易，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。</p> <p>3. 由于基金管理人或基金托管人原因导致基金无法按时支付清算款时，责任方应对由此给基金财产造成的损失承担相应的赔偿责任。</p> <p>4. 基金管理人应保证在交收日(T+1日)10:00前基金银行账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如基金的资金头寸不足，则基金托管人有权按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理，并应及时通知基金管理人。</p> <p>5. 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上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人应及时通知基金管理人，并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>	<p>(二) 证券交易的资金清算与交割</p> <p><u>基金托管人负责基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交收；基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交收，由基金管理人负责委托代理证券买卖的证券经营机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的场外交易成交结果具体办理。</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并在执行完毕后回函确认，不得延误。证券经纪商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，并承担由证券经纪商原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由基金管理人承担。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损失。</u></p> <p><u>对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。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>场外资金对外投资划款由基金托管人凭基金管理人符合本托管协议约定的有效资金划拨指令和相关投资合同（如有）进行资金划拨；场外投资本金及收益的划回，由基金管理人负责协调相关资金划拨回基金托管专户事宜。</u></p>
--	--

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，对《大成策略回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）》进行相应修订，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《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》、《大成策略回报混合型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

公司网址：www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

五、本公告的解释权归大成基金管理有限公司。

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、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

大成基金管理有限公司

2023年11月8日