

申万菱信基金管理有限公司

关于申万菱信中证 500 指数优选增强型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，提升申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，申万菱信基金管理有限公司（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》等有关规定和《申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，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，更新基金管理人及基金托管人信息，并相应修改《申万菱信中证 500 指数优选增强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 2023 年 11 月 28 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。

本次因证券交易结算模式的转换及基金管理人、基金托管人信息更新相应修改《托管协议》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审议。

二、因转换证券交易结算模式及基金管理人、基金托管人信息更新，拟对《托管协议》的相关条款进行修改，同时修订《基金合同》基金管理人、基金托管人信息，修改前后对照表如下：

1、《托管协议》修订对照表

修改章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 名称：申万菱信基金管理有 限公司 注册地址：上海市中山南路 100号11层 办公地址：上海市中山南路 100号11层 邮政编码：200010 法定代表人：<u>刘郎</u> 成立日期：2004年1月15日 批准设立机关及批准设立文 号：中国证监会证监基金字 【2003】144号文 组织形式：有限责任公司 注册资本：壹亿伍仟万元人 民币 存续期间：持续经营 经营范围：基金管理业务、 发起设立基金及中国证券监督管 理委员会批准的其他业务。</p> <p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有 限公司 注册地址：北京市东城区建 国门内大街69号 办公地址：北京市西城区复 兴门内大街28号凯晨世贸中心东 座九层 邮政编码：100031 法定代表人：<u>周慕冰</u> 成立时间：2009年1月15日 基金托管资格批准文号：中 国证监会证监基字【1998】23号 注册资本：32,479,411.7万 元人民币</p>	<p>(一) 基金管理人 名称：申万菱信基金管理有 限公司 注册地址：上海市中山南路 100号11层 办公地址：上海市中山南路 100号11层 邮政编码：200010 法定代表人：<u>陈晓升</u> 成立日期：2004年1月15日 批准设立机关及批准设立文 号：中国证监会证监基金字 【2003】144号文 组织形式：有限责任公司 注册资本：壹亿伍仟万元人 民币 存续期间：持续经营 经营范围：基金管理业务、 发起设立基金及中国证券监督管 理委员会批准的其他业务。</p> <p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有 限公司 注册地址：北京市东城区建 国门内大街69号 办公地址：北京市西城区复 兴门内大街28号凯晨世贸中心东 座九层 邮政编码：100031 法定代表人：<u>谷澍</u> 成立时间：2009年1月15日 基金托管资格批<u>文及</u>文号： 中国证监会证监基字【1998】23 号 注册资本：<u>34998303.3873万</u></p>

	<p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</p>	<p><u>元人民币</u></p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；<u>保险兼业代理业务</u>；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</p>
<p>五、基金财产的保管</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、基金托管人的固有财产。</p> <p>(三) 基金托管资金账户和<u>结算备付金账户</u>的开立和管理</p> <p>1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。</p> <p>2、基金托管人应以本基金的名义在其营业机构开设本基金</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、基金托管人和<u>证券/期货经纪机构</u>的固有财产。</p> <p>(三) 基金托管资金账户的开立和管理</p> <p>1、基金托管人应负责本基金的资金账户<u>(也可称为“托管账户”)</u>的开设和管理。</p>

的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

（四）基金证券账户的开立和管理

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基金联名的证券账户。

2、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或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。

~~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，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。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。~~

4、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。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

2、基金托管人应以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金除证券交易所场内交易以外的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

（四）基金证券账户和证券资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基金联名的证券账户。

2、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。

3、基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券资金账户，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。

4、基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的证券账户、证券资金账户，亦不得使用基金的证券账户或证券资金账户进行本基金业务以外的活动。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。

5、基金管理人承诺证券资金账户为证券交易主资金账户，不开立任何辅助资金账户；不为证券资金账户另行开立银行托管账户以外的其他银行账户。

6、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

		<p>责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>7、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。</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>	<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账户与证券资金账户之间划款，即银证互转；或由基金托管人根据基金管理人的划款指令执行银证互转。</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>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(一) 选择代理证券/期货买卖的证券/期货经营机构</p> <p>基金管理人应设计选择代理本基金证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的交易单元。</p> <p>基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，由基金管理人提前通知基金托管人。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，并将上述情况及基金专用交易单元号、佣金费率等基金基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人。因相关法律法规或交易规则</p>	<p>(一) 选择代理证券/期货买卖的证券/期货经纪机构</p> <p>基金管理人应设计选择代理本基金证券、期货买卖的证券、期货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，使用其交易单元作为基金的交易单元。<u>基金管理人、基金托管人和证券经纪机构签订本基金的证券经纪服务协议。</u></p>

的修改带来的变化以届时有效的法律法规和相关交易规则为准。

(二) 基金投资证券后的清算交收安排

1、清算与交割

基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。资金汇划由基金托管人根据基金管理人的交易成交结果具体办理。

如果因为基金托管人自身原因在清算上造成基金资产的损失，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未事先通知基金托管人增加交易单元，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，造成基金财产损失的由基金管理人承担；如果由于基金管理人违反法律法规、交易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，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，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。

基金管理人应采取合理措施，确保在 T+1 日 12:00 之前有足够的资金头寸用于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。

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，基金托管资金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。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

(二) 基金投资证券后的清算交收安排

1、清算与交割

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。

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。

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。

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。

	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。	
--	--------------------------------	--

2、《基金合同》修订对照表

修改章节	修改前	修改后
第七部分 基金合同当 事人及权利 义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 名称：申万菱信基金管理有 限公司 住所：上海市中山南路 100 号 11 层 法定代表人：刘郎 设立日期：2004 年 1 月 15 日 批准设立机关及批准设立文 号：中国证券监督管理委员会， 中国证监会证监基金字【2003】 144 号文 组织形式：有限责任公司 注册资本：壹亿伍仟万元人 民币 存续期限：持续经营 联系电话：+86-21-23261188</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有 限公司 住所：北京市东城区建国门 内大街 69 号（100031） 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文 号：中国银监会银监复【2009】 13 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：32,479,411.7 万 人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号： 中国证监会证监基字【1998】23 号</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 名称：申万菱信基金管理有 限公司 住所：上海市中山南路 100 号 11 层 法定代表人：陈晓升 设立日期：2004 年 1 月 15 日 批准设立机关及批准设立文 号：中国证券监督管理委员会， 中国证监会证监基金字【2003】 144 号文 组织形式：有限责任公司 注册资本：壹亿伍仟万元人 民币 存续期限：持续经营 联系电话：+86-21-23261188</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有 限公司 住所：北京市东城区建国门 内大街 69 号（100031） 法定代表人：谷澍 成立时间：2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文 号：中国银监会银监复【2009】 13 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：<u>34998303.3873 万</u> <u>元人民币</u> 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号： 中国证监会证监基字【1998】23 号</p>

三、重要提示

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。本公司将根据相关法律法规，更新本基金的招募说明书并在规定媒介上披露。

投资者可通过以下途径了解或咨询详情：

申万菱信基金管理有限公司

客服电话：400-880-8588（免长途话费）或 021-962299

官方网站：www.swsmu.com

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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2023年11月27日