

关于嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金

证券交易结算模式转换并修改托管协议的公告

为更好地满足投资者需求，提升嘉实品质蓝筹一年持有期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信息披露管理办法》等法律法规以及《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的有关规定，嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并履行适当程序，决定转换本基金的证券交易结算模式，由托管人交易结算模式改为证券经纪商交易结算模式，并相应修改《托管协议》、更新部分条款。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自2023年12月1日起，本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换完成后，本基金参与证券交易所交易结算将委托证券经纪商办理，由证券经纪商履行场内证券交易结算管理职责。

本次证券交易结算模式的转换以及对《托管协议》的修改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、托管协议的修改

因转换证券交易结算模式，本基金拟对《托管协议》相关条款进行修改，修改内容详见附件《<嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金托管协议>修改前后文对照表》。

基金管理人将对本基金招募说明书及基金产品资料概要进行更新。

三、重要提示

1、本基金证券交易结算模式转换完成时间及修改后的《托管协议》生效时间将另行公告。

2、基金管理人已就本次转换证券交易结算模式并修改《托管协议》事宜履行了规定程序，符合法律法规、监管机构和《基金合同》的规定。

3、投资者欲了解基金信息请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）及相关法律文件。投资者可登录本基金管理人网站（www.jsfund.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-600-8800）获取相关信息。

四、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资产，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。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。投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的产品资料概要（更新）、招募说明书（更新）和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年11月30日

附件：《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

| 章节 | 原文条款 | 修改后条款 |
|----------------------|--|---|
| 五、 基金 财产 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、期货交易账户及其他投资所需账户。</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本基金的托管银行账户、第三方存管账户、证券账户、期货交易账户及其他投资所需账户。<u>基金管理人、基金托管人、证券经纪机构三方签订三方存管协议。证券经纪机构根据相关法律法规规定及相关协议约定为本基金开立相关证券资金账户。</u></p> |
| | <p>(三) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理</p> <p>基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。</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>(三) 基金证券账户与证券资金账户的开设和管理</p> <p><u>1、基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>3、基金管理人以本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，并按照该营业网点开户的流程和要求，签订相关的协议，并办理第三方存管。</u></p> <p><u>4、基金管理人根据相关法律法规及协议约定在选定的证券经纪机构处为本基金开立证券资金账户，用于办理本基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金和交易保证金的收取按照代理证券买卖的证券经营机构的规定执行。</u></p> <p><u>5、证券资金账户与基金托管账户及第三方存管账户建立绑定关系。</u></p> <p><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</u></p> |

| | | |
|--|---|---|
| | 无 | <p>行。</p> <p><u>(六) 存款投资账户的开立和管理</u> <u>基金财产开展定期存款等银行存款投资前应按基金名义完成银行存款投资账户开立手续，配合向基金托管人提供开户、变更等办理人员身份证明信息。开户资料须预留基金托管人印鉴，基金管理人与基金托管人各自妥善保管预留印鉴，当发生预留印鉴变更时，及时通知对方完成变更。如银行存款账户停止使用，投资管理人应联系基金托管人应及时办理销户手续。</u></p> |
| | <p><u>(六) 基金财产投资的有关银行存款证实书等实物证券的保管</u> 基金财产投资的有关实物证券根据实际需要，存放于基金托管人<u>或其他机构</u>的保管库；属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。</p> | <p><u>(七) 基金财产投资的有关银行存款证实书等实物证券的保管</u> 基金财产投资的有关实物证券根据实际需要，存放于基金托管人的保管库；属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。 <u>如非基金托管人原因导致存款证实书遗失、灭失、污损或被盗，晚于兑付日到达存款行导致无法兑付或延迟兑付的，基金管理人应推进后续处理，基金托管人积极配合完成相关事项。存款证实书不得进行担保、质押、背书、转让或用于可能导致存款资金损失的其他用途。</u> <u>基金管理人应在相关投资协议中明确存款本息资金回款路径为基金资产托管专户。在疫情等不可抗力影响下，如无法正常办理存款证实书出入库手续，存款本息资金到期应按协议约定返回基金资产托管专户，避免资金回款风险，疫情缓解后及时补办出入库手续。</u> <u>基金管理人应及时与基金托管人办理存款证实书入库保管。如存款证实书要素与存款协议不符，基金托管人拒绝办理入库，基金管理人应更正。发生疫情或自然灾害等不可抗力延误的，基金管理人应及时向基金托管人书面说明，并采取措施积极推动存款证实书入库事宜。</u> <u>存款到期前，基金管理人应及时与基金托管人办理存款证实书出库。如需提前支</u></p> |

| | | |
|---------------|--|--|
| | | 取，基金管理人应出具提前支取说明函。 <u>如需部分提前支取，应办理存款证实书置换，置换后新存款证实书除金额、编号外，其他要素与原存款证实书一致。</u> |
| 六、指令的发送、确认和执行 | 无 | <u>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。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> <u>基金管理人在运用基金财产时，向基金托管人发送场外交易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> |
| | （三）指令的发送、确认和执行的程序和程序 …… 基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金银行账户有足够的资金余额，对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人应当不予执行，并立即通知基金管理人，基金托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。 …… | （三）指令的发送、确认和执行的程序和程序 …… 基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金银行账户 <u>或证券资金账户</u> 有足够的资金余额，对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人应当不予执行，并立即通知基金管理人，基金托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。 …… |
| 七、交易及清算交收安排 | （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 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。 基金管理人 <u>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。</u> 基金管理人 <u>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。</u> …… | （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 基金管理人负责选择代理本基金 <u>财产</u> 证券买卖的 <u>证券经纪机构</u> ， <u>由基金管理人、基金托管人和证券经纪机构就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议，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。因相关法律法规或交易规则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。</u> …… |
| | （二）基金投资证券后的清算交收安排 <u>1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任</u> <u>基金管理人</u> <u>与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《托管银行</u> | （二）基金投资证券后的清算交收安排 <u>1、清算与交割</u> <u>（1）基金投资证券后的清算交收安排</u> <u>基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交割，由基金托管人负责根据相关登</u> |

| | |
|--|---|
| <p>证券资金结算协议》，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>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。</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《托管银行证券资金结算协议》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，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>基金参与港股通交易的，基金管理人应保证在 T+1 日 9:30 之前在托管的托管专户或结算备付金账户上有足够的头寸用于港股通 T+1 日公司行动、证券组合费和风控资金的交收，在 T+1 日 14:00 之前在托管的托管专户或结算备付金账户上有足够的头寸用于港股通 T+2 日交易资金的交收。如由于基金管理人的原因导致港股通交收失败，由此给托管人、托管人托管的其他资产组合造成的损失，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，由此给基金财产或基金托管人造成的损失由基金管理人承担。因非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 10:00 时之前划拨资金，用以完成清算交收，但不可抗力造成的除外。</p> <p>3、基金无法按时支付证券清算款的责任</p> | <p>记结算公司的结算规则办理；基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交割，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。</p> <p>(2) 证券交易所证券资金结算</p> <p>证券经纪机构负责本基金场内证券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；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。</p> <p>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。</p> <p>(3) 期货（股指期货、国债期货）的清算交收安排</p> <p>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。</p> <p>(4) 其它场外交易资金结算</p> <p>场外交易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本基金托管户事宜。</p> <p>2、本基金参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的，通过证券经纪机构代理进行交易，由证券经纪机构直接从资金账户中进行资金清算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。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。</p> |
|--|---|

| | |
|---|--|
| <p>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,基金托管人应当拒绝基金管理人发送的划款指令并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,由此给基金财产或基金托管人造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>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,由此给基金财产或基金管理人造成的损失由基金托管人承担。</p> | |
|---|--|