

中银基金管理有限公司关于 中银MSCI中国A50互联互通指数 增强型证券投资基金转换证券交易模式 有关事项的公告

一、公告基本信息

基金名称	中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金
基金简称	中银MSCI中国A50互联互通指数增强
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年11月22日
基金管理人名称	中银基金管理有限公司
基金托管人名称	上海银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中银基金管理有限公司
公告依据	《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》《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金基金合同》《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金托管协议》《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金招募说明书》等

二、时间安排

为了更好地满足投资者投资理财需求、进一步提高产品的竞争力,本基金管理人根据相关法律法规、基金合同、托管协议和招募说明书约定,经与本基金的基金托管人上海银行股份有限公司协商一致,中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)自2023年12月14日起启动证券交易模式的转换工作。转换完成后,本基金的证券交易所场内交易将委托证券公司办理,由证券公司履行交易管理、清算等职责。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。

因转换证券交易模式,相应修改《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金托管协议》(以下简称“《托管协议》”)。

三、《托管协议》的修订内容

本公司已就修订内容与基金托管人上海银行股份有限公司协商一致。

《托管协议》的修订内容具体如下:

原托管协议涉及及修改章节	原托管协议表述	修改后表述
五、基金财产的保管 (一)基金财产保管的原则	“1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的固有财产。”	“1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经营机构和基金销售机构的固有财产。”
五、基金财产的保管 (一)基金财产保管的原则	“5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用)。”	“5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用)。”
五、基金财产的保管	“(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。 证券账户开户费由本基金基金财产承担,若因基金银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收,由基金管理人先行垫付。 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、结算互保基金、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。”	“(四)第三方存管账户的开立和管理 基金管理人指定基金托管人为本基金的第三方存管银行,本基金第三方存管账户即托管账户,基金管理人按照基金托管人要求提供开户所需资料。 (五)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本基金的证券账户,账户名称以实际开立为准。 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. 基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。 (六)基金证券资金账户(证券资金台账账户)的开立和管理 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账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)加盖公章专用章后交基金托管人留存。基金管理人不对证券资金账户不设逐笔逐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拔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拔的指令),基金托管人按照基金管理人的有效银证转账指令完成资金划拔。 本基金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开办的证券交易资金清算中,场内的证券交易资金清算由基金管理人选择选择的证券经营机构负责。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,并调整后续序号。”
六、指令的发送、确认及执行 (二)指令的内容	“2. 基金管理人发给基金托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等,加盖预留印鉴并由被授权人签字。 基金管理人同意基金托管人根据其收到的中国证券登记结算有限责任公司或深、沪证券交易所的交易数据与中国证券登记结算有限责任公司进行交收。基金财产投资发生的所有场内交易的清算交收,由基金托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理,基金管理人不需要另出具指令。 遵循中登上海预交收制度,中登深圳结算互保金制度,中登上海深圳备付金管理办法等有关规定所做的结算备付金、保证金及最低结算备付金的调整也视为基金管理人向基金托管人发出的有效指令,无须基金管理人向基金托管人另行出具指令,基金托管人应予以执行。 本基金银行账户发生的银行结算费用等银行费用,由基金托管人直接从银行账户中扣划,无须基金管理人出具指令。”	“2. 基金管理人发给基金托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等,加盖预留印鉴并由被授权人签字。 基金管理人同意基金托管人根据其收到的中国证券登记结算有限责任公司或深、沪证券交易所的交易数据与中国证券登记结算有限责任公司进行交收。 本基金银行账户发生的银行结算费用等银行费用,由基金托管人直接从银行账户中扣划,无须基金管理人出具指令。”
六、指令的发送、确认及执行 (三)指令的发送、确认及执行的时间和程序	“1. 指令的发送 基金管理人发送指令应采用加密传真方式或双方协商一致的其他方式。”	“1. 指令的发送 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。 基金管理人运用基金财产时,向基金托管人发送场外交易资金划款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。基金管理人发送指令应采用加密传真方式或双方协商一致的其他方式。”

七、交易及清算 交收安排 (一) 选择证 券、期货买卖 的证券、期货经纪 机构	<p>“基金管理人应设计选择证券、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证券、期货经纪机构,租用其交易单元作为基金的专用交易单元。基金管理人和被选中的证券、期货经纪机构签订委托协议,基金管理人应提前通知基金托管人,并依据基金托管人要求提供相关资料,以便基金托管人申请办理接收结算数据手续。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、期货经纪机构的有关情况以及交易信息予以披露,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>“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代理本基金证券买卖的证券经营机构,由基金管理人及基金托管人及证券经营机构签订本基金的证券经纪服务协议,明确三方在本基金参与场内证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收、交易数据传输与接收过程中的职责和义务。</p> <p>基金管理人应及时将本基金财产的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>基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构,并与其签订期货经纪合同,其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行,若无明确规定的,可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。</p> <p>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。”</p>
七、交易及清算 交收安排 (二) 基金投 资证券后的清算 交收安排	<p>“1. 清算与交割</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《托管银行证券资金结算协议》,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>根据中国证券登记结算有限责任公司规定,在每月前2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、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、结算保证金当日,在账户资金报告中反映调整后的最低备付金和结算保证金。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最低备付金、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。</p> <p>基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。场内资金清算由基金托管人根据中国证券登记结算有限责任公司清算数据办理;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。</p> <p>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;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、超卖及质押券欠库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、本基金和基金托管人托管的其他资产造成的直接损失由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人应采取合理、必要措施,确保T日日终有足够的资金头寸完成T+1日的投资交易资金清算;如因基金管理人原因导致资金头寸不足,基金管理人应在T+1日上午10:00前补足透支款项,确保资金清算。如果未遵循上述规定补足资金头寸,影响基金资产的清算交收及基金托管人与中国证券登记结算有限责任公司之间的一级清算,由此给基金托管人、基金资产和基金托管人托管的其他资产造成的直接损失由基金管理人负责。</p> <p>根据中国证券登记结算有限责任公司结算规定,基金管理人在进行融资回购业务时,用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期回购款的质押券。如因基金管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库,导致中国证券登记结算有限责任公司欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由基金管理人承担。</p> <p>实行场内T+0交收的资金清算按照基金托管人的相关规定流程执行。”</p>	<p>“1. 清算与交收</p> <p>本基金财产所有场内证券交易的清算交收由基金管理人选择的证券经营机构作为结算参与人负责办理,由该证券经营机构直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。证券经营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清算业务,并承担由证券经营机构原因造成的正常清算、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清算业务无法完成,责任由基金管理人承担。</p> <p>本基金财产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。</p> <p>根据中国证券登记结算有限责任公司结算规定,基金管理人在进行融资回购业务时,用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期回购款的质押券。如因基金管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库,导致中国证券登记结算有限责任公司欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由基金管理人承担。”</p>

四、重要提示

1. 本基金证券交易模式转换完成时间以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。公司将根据上述修订情况,在《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)》中,对上述内容进行相应修改,并将更新后的文件在公司官网上披露。本公告未尽事宜,敬请投资者参见《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)、《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

2. 《托管协议》的修订已经履行了规定的程序,符合相关法律法规及《基金合同》和《托管协议》的规定,对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响,无需召开基金份额持有人大会。

3. 本基金管理人承诺依照诚实信用、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,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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。投资者投资基金时应认真阅读基金的《基金合同》、《托管协议》以及更新的《中银MSCI中国A50互联互通指数增强型证券投资基金招募说明书》等文件。

4. 投资者亦可拨打本公司的客户服务电话:021-38834788 / 400-888-5566或登陆本公司网站www.bocim.com了解相关情况。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2023年12月13日