

中银基金管理有限公司关于中银中证 500 指数增强型发起式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	中银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金
基金简称	中银中证 500 指数增强型发起
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 26 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	中国民生银行股份有限公司
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》《中银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》《中银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》《中银中证 500 指数增强型发起式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中国民生银行股份有限公司协商一致，中银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）自 2024 年 1 月 15 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等，相应修改《中银中证 500 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》”）。

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中国民生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：

原托管协议要 涉及修改章节	原托管协议表述	修改后表述
<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。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。”</p>	<p>“1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、<u>证券经营机构</u>的固有财产。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。”</p>
<p>五、基金财产的保管</p> <p>(二) 基金募集期间及募集资金的验资</p>	<p>“2. 基金募集期满或基金停止募集时，发起资金的认购金额、发起资金提供方及其承诺的持有期限符合符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有的基金份额进行专门说明。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字并加盖会计师事务所公章方为有效。”</p>	<p>“2. 基金募集期满或基金停止募集时，发起资金的认购金额、发起资金提供方及其承诺的持有期限符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有的基金份额进行专门说明。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字并加盖会计师事务所公章方为有效。”</p>
<p>五、基金财产的保管</p>	<p>“(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>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、深圳分公司为本基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。</p>	<p><u>“(四) 第三方存管账户的开立和管理</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(五) 基金证券账户的开立和管理</u></p>

	<p>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书面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>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。</p> <p>4. 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、证券结算保证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。</p> <p>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。”</p>	<p>1. 基金管理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。</p> <p>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。</p> <p>3. 基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p><u>(六) 基金证券资金账户（证券资金台账账户）的开立和管理</u></p> <p>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），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拨。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为本基金开设的证券资金账户中，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。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</u></p>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

		<u>“证券资金账户内存放的资金。”</u> 并调整后续序号。
六、指令的发送、确认及执行	“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。”
六、指令的发送、确认及执行 (二) 指令的内容	“3. 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。”	无
七、交易及清算交收安排 (一) 选择证券、期货买卖的证券、期货经营机构	“ <u>基金管理人应设计选择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，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经营机构签订委托协议，基金管理人应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> 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>基金管理人负责选择代理本基金期货交易期货经纪机构，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</u>	“ <u>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，由基金管理人与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。</u> <u>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。</u> <u>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。</u> 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>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>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>	<p>“1. 清算与交割 根据《中国证券登记结算有限责任公司 结算备付金管理办法》、《证券结算 保证金管理办法》，在每月第二个工 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 金限额或结算保证金进行重新核算， 调整，管理人应提前一个交易日匡算 最低备付金和证券结算保证金调整 金额，留出足够资金头寸，以保证正 常交收。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 付金和证券结算保证金当日，在资金 调节表中反映调整后的最低备付金 和证券结算保证金。基金管理人应预 留最低备付金和证券结算保证金，并 根据中国证券登记结算有限责任公 司确定的实际下月最低备付金和证 券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。 基金托管人负责基金买卖证券的清 算交收。场内资金结算由基金托管人 根据中国证券登记结算有限责任公 司结算数据办理；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。 如果因为基金托管人自身原因在清 算上造成基金财产的损失，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</p>	<p>“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。 ”并调整后续序号。</p>

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。

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日的投资交易资金结算；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备足资金头寸，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、基金资产及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。

本基金参与T+0交易所非担保交收债券交易的，基金管理人应确保有足额头寸用于上述交易，并必须于T+0日14:00之前出具有效划款指令（含不履约申报申请），并确保指令要素（包括但不限于交收金额、成交编号）与实际交收信息一致。如由非基金托管人的原因导致T+0非担保交收失败，给基金托管人造成损失的，基金管理人应承担赔偿责任。

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(除登记公司收保或冻结资金外)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执行基金管理人发送的划款指令并同时通知基金管理人，并视账户余额充足时为指令送达时间。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，一般为2个工作小时。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。

2、港股通交易清算

基金份额持有人和基金管理人认可中国结算按照香港结算的业务规则，与香港结算完成港股通交易的证券和资金的交收。港股通交易的境内结算由基金托管人通过中国结算根据相关业务规则组织完成。香港结算因无法交付证券对中国结算实施现金结算的，中国结算参照香港结算的处理原则进行相应业务处理；香港结算发生破产而导致其未全部履行对中国结算的交收义务的，由中国结算协助向香港结算追索，中国结算和基金托管人不承担由此产生的相关损失。港股通交易各项业务的收付款时点按如下约定：

(1) 交易资金

基金托管人于港股通交易日(T日)，根据中国结算计算的资金清算数据，

分别用以计算托管资产的应收或应付净额，形成托管资产当日交易清算结果。基金管理人原则上应保证在港股通交易日（T日）下一工作日（T+1日）9:00前托管账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算。对于T日港股通交易清算结果为净应付的，基金托管人于T+1日扣收应付资金。对于T日港股通交易的清算结果为净应收的，基金托管人于T+3日返还应收资金。

~~（2）风控、红利/公司收购、证券组合费~~

~~基金管理人应保证在T+1日上午9:00前托管账户有足够的资金，基金托管人于T+1日上午9:00扣收委托人的净应付资金，14:00前返还基金管理人的净应收资金。~~

~~基金托管人负责差额缴款、按金等风控资金的合并计算，基金管理人应按照基金托管人的计算结果按时缴纳风控资金。~~

~~（3）延迟交收~~

~~对于遇恶劣天气等原因导致延迟交收时，若托管资产为净应付的，则仍按前述约定的时间进行扣收；若托管资产为净应收的，则交收时间视中国结算向基金托管人的支付情况确定。基金管理人应做好头寸管理，避免因延迟交收而导致的透支。~~

~~（4）违约处置~~

~~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~~

	<p>金管理人同意在发生以上情形时，基金托管人有权按照中国结算的有关规定办理。</p> <p>由于基金管理人出现资金交收违约并造成基金托管人对中国结算违约的，基金管理人应将相当于交收违约金额的应收证券指定为暂不交付证券并由中国结算按其业务规则进行处理，基金管理人未指定或指定不足的，中国结算和基金托管人有权以违约金额为限自行扣划，由此造成的风险、损失和责任，由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人出现证券交收违约的，中国结算和基金托管人有权将相当于证券交收违约金额的资金暂不划付给基金管理人。</p> <p>基金管理人知晓并认可，出于降低全市场资金成本的原因，中国结算可以依照香港结算相关业务规则，将每日净卖出证券向香港结算提交作为交收担保品。</p> <p>（5）风险管理</p> <p>根据中国结算公司要求，港股通业务上线的首三个交易日，因证券尚未完成交收或处于交收冻结状态，不能作为担保证券减免相应的风控资金，因此本基金需缴纳的风控资金金额可能较大。请基金管理人做好资金头寸安排，确保按时完成资金交收义务。人民币对港币的汇率应当以交易所或中国结算公告的价格为准。”</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《中银中证 500 指数增强型发起式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网站（www.bocim.com）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）披露。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《中银中证 500 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》”）、《中银中证 500 指数增强型发起式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《中银中证500指数增强型发起式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

2024年1月13日