

关于民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 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需求，提升民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《民生加银中证 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》”）的有关规定，民生加银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人交通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，由托管人交易结算模式改为证券公司交易结算模式，并相应修改《托管协议》。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自 2024 年 2 月 5 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《<民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议>修改前后文对照表》。

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、本公司将依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介公告修订后的《托管协议》及《招募说明书》。

3、投资者可到本基金各销售机构网点或通过本公司客户服务中心咨询有关详情。

民生加银基金管理有限公司 网站：www.msjyfund.com.cn

民生加银基金管理有限公司 客户服务热线：400-8888-388（免长途通话费用）

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，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书等资料，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

民生加银基金管理有限公司

2024年2月2日

附件：《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

章节	修订前	修订后
<p>五、基金财产的保管</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>2.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>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>2.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和证券经纪机构的固有财产。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>(四) 基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理</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开立证券账户。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>基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</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开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。</p>	<p>(四) 基金证券交收账户、证券交易资金账户的开立和管理</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开立证券账户。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>基金管理人不得对基金证券交收账户进行证券的超卖或超买。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券交易资金账户，用于场内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本基金托管账户建立第三方存管关系。</p> <p>交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于场内证券交易结算的资金全额存放在基金管理人选择的证券公司为基金开设的证券交易资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的证券公司负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券交易资金账户内存放的资金。</p> <p>基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户、证券交易资金账户，亦不得使用证券账户或</p>

		<p>证券交易资金账户进行本基金业务以外的活动。基金管理人承诺证券交易资金账户为主资金账户，不开立任何辅助资金账户；不为证券交易资金账户另行开立银行托管账户以外的其他银行账户。</p>
<p>六、指令的发送、确认和执行</p>	<p>(一) 基金管理人发送指令人员的书面授权</p>	<p>(一) 基金管理人发送指令人员的书面授权 新增:对于场内业务,基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易前,通过基金托管人建立基金托管账户与证券交易资金账户的第三方存管关系,由基金托管人根据基金管理人发送的指令在基金托管账户与证券交易资金账户之间划款,即银证互转。 对于场外业务,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。</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,并代表基金与被选择的证券经纪机构签订交易单元租用协议。基金管理人应及时将基金交易单元号、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,并在法定信息披露公告中披露</p>	<p>(一) 选择代理证券、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,由基金管理人与基金托管人及证券经纪机构签订本基金的证券经纪服务协议,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。 基金管理人应制定选择的标准和程序,并负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经纪机构进行考察后确定代理本基金证券买卖的证券经纪机构。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纪机构的有关情况、支付的佣金等予以披露,并将该等情况及佣金费率等基本信息以及变更情况及时通知基金托管人。</p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排 1.资金划拨</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排 1.资金划拨</p>

	<p>对于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。基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的资金划拨指令时，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和在途时间。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。对超头寸的划款指令，基金托管人有权止付但应及时电话通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。</p>	<p>对于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。基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的资金划拨指令时，基金银行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。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和在途时间。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。对超头寸的划款指令，基金托管人有权止付但应及时电话通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。</p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>3. 证券交易资金的清算</p> <p>本基金投资于证券而发生的场内、场外交易的清算交割，由基金托管人负责办理。</p> <p>本基金场外证券投资的清算交割，由基金托管人根据基金管理人的指令通过登记结算机构办理。本基金场内证券投资的清算交割，由基金托管人根据双方签订的《托管银行证券资金结算协议》约定，由基金托管人负责办理。但本基金场内证券投资涉及T+0日非担保、RTGS交收的业务，基金管理人应在T+0日15:00前书面通知基金托管人办理交收，否则基金托管人不能保证相关清算交割成功。如因基金托管人的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的投资运作行为而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，基金托管人应给予必要的配合，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损失由基金管理人承担。</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>3. 证券交易资金的清算</p> <p>本基金所有场外买卖证券的清算交收，由基金托管人根据基金管理人的场外交易划款指令具体办理。本基金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纪机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。</p>

	<p>基金托管人在完成相关登记结算公司通知的事项后应通知基金管理人。</p> <p>由于基金管理人的原因造成基金无法按时支付证券清算款，按照登记结算机构的有关规定办理。</p> <p>本基金参与港股通交易时，基金管理人应事先书面通知基金托管人，明确交易单元、佣金费率等相关信息，在托管人完成相关设置后方可开展交易。若涉及需基金管理人做出选择的港股通公司行为，基金托管人根据基金管理人提供的数据将基金管理人的选择结果提交给中国结算。</p>	
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二) 净值差错处理</p> <p>3.基金管理人、基金托管人按估值方法的第 13 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司、存款银行等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>	<p>(二) 净值差错处理</p> <p>3.基金管理人、基金托管人按估值方法的第 13 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司、证券经纪机构、存款银行等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>