

国金基金管理有限公司

关于国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金 证券交易模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求,增强国金核心资产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,国金基金管理有限公司(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》和《国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,经与基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,决定转换本基金证券交易模式并修订《国金核心资产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》”)。现将具体事项公告如下:

一、证券交易模式转换

自2022年1月21日起,本基金将启动证券交易模式的转换工作。转换后,本基金的证券交易所交易将委托证券公司办理,由证券公司履行交易管理职责。

本次证券交易模式转换及《托管协议》的修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响,根据《基金合同》的约定无需召开基金份额持有人大会审议。

二、因转换证券交易模式等内容,拟对《托管协议》相关条款进行修订,修订内容如下:

五、基金财产的保管	<p>(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</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>(四) 基金证券账户和资金交收账户的开立和管理</p> <p>4. 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资产托管专户(即基金银行账户)建立第三方存管关系。</p> <p>新增以下内容并调整后续序号:</p> <p>5. 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>
六、指令的发送、确认及执行	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>1. 指令的发送</p> <p>.....</p> <p>对新股申购网下发行业务,基金管理人应在网下申购缴款日(T日)的前一工作日下班前将指令发送给基金托管人,指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00。</p>	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>1. 指令的发送</p> <p>.....</p> <p>对新股申购网下发行业务,基金管理人应在网下申购缴款日(T日)的前一工作日下班前将指令发送给基金托管人,指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00。对于银证转账指令,指令发送时间最迟不应晚于T日下午14:00时。</p>
七、交易清算安排	<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。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>	<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纪机构签订本基金的证券经纪服务协议。</p> <p>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证券经纪机构,并承担相应责任。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、基金通过该证券经纪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。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>

	修订前表述	修订后表述
七、交易及清算安排	<p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</p> <p>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和结算保证金进行重新核算、调整，基金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。</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，基金托管人不承担垫款义务。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承担。</p> <p>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，基金托管人有拒绝对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。</p> <p>2、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。</p>	<p>(二)基金投资证券/期货后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</p> <p>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/期货经纪机构应根据有关法律法规及相关业务规则，签订证券/期货经纪服务协议，用以具体明确三方在交易资金结算业务中的责任。</p> <p>本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金汇划，全部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登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。</p>
七、交易及清算安排	<p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p>	<p>(二)基金投资证券/期货后的清算交收安排</p> <p>新增以下内容：</p> <p>4. 沪、深交易所数据传输和接收</p> <p>基金管理人和基金托管人从证券经纪机构处接收本基金的场内交易电子清算数据，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构之间的场内交易电子清算数据的传输采用专线(深证通)或各方认可的其他方式。关于沪、深交易所数据传输和接收的具体相关条款，各方当事人权利、责任及义务的具体约定以三方签署的经纪服务协议为准。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>(2)由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易场所或登记结算公司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，但是未能发现该错误的，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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>(2)由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易场所、登记结算公司、证券经营机构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，但是未能发现该错误的，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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>

三、本基金证券交易模式转换完成的时间以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。本公司将根据上述《托管协议》修订情况，在《国金核心资产一年持有期混合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订，并将更新后的文件在本公司官网上披露。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关文件。

四、投资者可登录本公司网站(www.gfund.com)查阅修订后的《托管协议》全文或拨打本公司客户服务热线(4000-2000-18)咨询相关信息。

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。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。