

中融基金管理有限公司

关于中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金 基金证券交易模式转换有关事项的公告

为了更好地满足广大投资者的理财需求，中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）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》的有关规定、《中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》的约定，并与基金托管人兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）协商一致，决定转换中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的证券交易模式并修改托管协议。现将具体事宜公告如下：

一、 证券交易模式转换

自2022年2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。

二、 因转换证券交易模式，拟对《中融鑫锐研究精选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》”) 相关条款进行修订，修订内容如下：

| 章节 | 修订前表述 | 修订后表述 |
|---------------------|--|--|
| 一、基金 托管协议 当事人 | <p>(一) 基金管理人 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2号中航资本大厦17楼</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）</p> | <p>(一) 基金管理人 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 <u>2号楼17层1701号01室</u></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<u>吕家进</u></p> |
| 五、基金 财产的保 管 | <p>(一) 基金财产保管的原则 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。 ……</p> <p>(六) 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基金托管人与基金联名的证券账户。 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和证券账户卡的保管由基金托管人负责，</p> | <p>(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、<u>证券经纪机构</u>的固有财产。 ……</p> <p>(六) 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基金托管人与基金联名的证券账户。 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和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账</p> |

| | | |
|----------------------|--|--|
| | <p>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。</p> | <p>户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>.....</p> <p><u>(七) 证券资金账户的开立与管理</u></p> <p><u>基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立证券资金账户，并按照该证券经纪机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</u></p> <p><u>交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易的结算资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经纪机构负责。证券资金账户内的资金，只能通过证银转账方式将资金划转至基金托管资金账户，不得将资金划转至任何其他银行账户。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。</u></p> |
| <p>六、指令的发送、确认及执行</p> | <p>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。</p> | <p><u>基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易时，应向基金托管人发送银证转账指令，由基金托管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实现基金托</u></p> |

| | | |
|--------------------|---|---|
| | | <p><u>管账户与证券资金账户之间的资金划转，即银证互转。</u></p> <p><u>基金管理人在运用基金财产开展场外交易时，应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></p> <p><u>基金管理人发送的指令包括电子指令、纸质指令或双方认可的其他形式。</u></p> <p>.....</p> <p><u>对于银证转账和证银转账的指令，基金管理人应在当日下午 14:00 点前将相关指令发送至基金托管人。</u></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、期货经营机构的程序</p> <p><u>1、基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易单元使用协议。</u></p> <p><u>2、基金管理人应及时将本基金财产证券交易单元号、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></p> <p><u>3、基金管理人与基金托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，基金管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若基金管</u></p> | <p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的程序</p> <p><u>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，就基金参与场内证券交易、结算等具体事项另行签订协议。</u></p> <p>.....</p> |

| | |
|--|--|
| <p>理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由基金管理人承担。</p> <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>(1) 基金托管人、基金管理人应共同遵守双方签订的《托管银行证券资金结算协议》。</p> <p>(2) 基金托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，基金管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日未余额不得低于托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。基金托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。</p> <p>(3) 根据中登公司基金托管人集中清算规则，如委托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易，管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸，即该笔资金在 T+1 日不可用也不可</p> | <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p><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纪机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。</u></p> <p><u>基金托管人负责基金场外买卖证券的清算交收，场外资金汇划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。</u></p> <p><u>如果因为基金托管人故意或重大过失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。</u></p> <p><u>基金管理人应采取合理、必要措施，确保有足够的资金头寸完成投资交易资金结算。</u></p> |
|--|--|

~~提，该笔资金在T+2日才能划拨至托管专户。~~

~~(4) 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息，因此，基金合同终止时，基金可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，基金托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至基金清算报告中指定的收款账户。基金合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，基金管理人应配合基金托管人，向基金托管人及时划付调增款项，以便基金托管人履行交收职责。~~

~~(5) 基金管理人签署本合同/协议，即视为同意基金管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，基金托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结基金管理人证券账户内相应证券，无需基金管理人另行出具书面确认文件。~~

~~2、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司T+0非担保结算要求的证券交易：-~~

~~(1) 对于在沪深交易所交易的采用T+0非担保交收的交易品种（如股票质押式回购、深圳公司债大宗交易、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整），基金管理人需在交易当日不晚于14:30向基金托管人发送交易应付资金划款指令（对于中登业务规则规定不是必须要勾单的，若基金管理人希望基金托管人进行勾单处理，则需在指令上备注需要基金托管人勾单，应急情况下允许基金管理人电话要求基金托管人进行勾单），同时将相关交易证明文件传真至基金托管人，并与基金托管人进行电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行。对于基金管理人在14:30后出具的划款指令，特别是需要基金托管人进行“勾单”确认的交易，基金托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。~~

~~(2) 基金管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知基金托管人。对于中国结算公司允许基金托管人指定不履约~~

~~的交易品种，基金管理人应向托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，基金托管人有权在电话通知基金管理人后，先行完成取消交收操作，基金管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令；~~

~~（3）若基金管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或基金管理人在本基金资金托管账户头寸不足的情况下交易，基金托管人有权在通知基金管理人后在中登公司取消交收截止时点前半小时主动对该笔交易进行取消交收申报，相应损失由基金管理人承担；~~

~~（4）对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第2、3项所述情形的，基金管理人知悉并同意基金托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将本基金资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日T+0非担保交收交易品种的交收，基金管理人承诺在日终前向基金托管人补出具资金划款指令。~~

~~(5) 发生以下因基金管理人原因所造成的情形，基金管理人应承担相应责任：—~~

~~①基金管理人 在基金托管人处所托管的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由基金管理人承担交易失败的风险，基金托管人无义务为该产品垫付交收款项；—~~

~~②因基金管理人未在合同约定的时间前向基金托管人提交有效划款指令，导致基金托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由基金管理人自行承担交易失败的风险；—~~

~~③因基金管理人 在基金托管人处所托管的产品资金不足，且占用基金托管人最低备付金交收成功，造成基金托管人损失，则应承担赔偿责任，且基金托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向基金管理人追索利息的权利；—~~

~~④因基金管理人 在基金托管人处所托管的产品资金不足或基金管理人未在规定时间内向基金托管人提交划款指令，且有证据证明其直接造成相应损失的，基金管理人应在过错范围内负赔偿责任。—~~

~~(6) 管理人已充分了解基金托管人结算模式下可能存在的交~~

收风险。如基金托管人托管的其他产品资金不足或过错，进而导致基金管理人管理的产品交收失败的，则基金托管人会配合基金管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。

~~(7)对于本基金采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务，基金管理人可根据需要在交易交收后且不晚于交收当日 14:30 向基金托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至基金托管人，并与基金托管人进行电话确认，以便基金托管人将交收金额提回至本基金资金托管账户。若基金管理人未出指令，则基金托管人于 T+1 日提款。~~

3、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易

基金管理人知悉并同意基金托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成本基金资金清算交收。若基金管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许基金托管人对相关交易可以取消交收的，基金管理人应向基金托管人出具书面

| | | |
|--|--|--|
| | 的取消交收指令，并与基金托管人进行电话确认，且给基金托管人留出合理的处理时间。 | |
|--|--|--|

三、本基金证券交易模式转换完成以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。本公司将根据上述修订情况，在《中融鑫锐研究精选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改，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《中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》《中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

公司网址：www.zrfunds.com.cn

客户服务电话：400-160-6000，010-56517299

五、本公告的解释权归中融基金管理有限公司

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于上述基金前应认真阅读上述基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2022年2月19日