

天弘基金管理有限公司关于天弘MSCI中国A50互联互通指数证券投资

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，增强天弘MSCI中国A50互联互通指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，天弘基金管理有限公司（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《天弘MSCI中国A50互联互通指数证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人国信证券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。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易模式转换

自2022年3月17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《天弘MSCI中国A50互联互通指数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：

所在部分	修订前	修订后
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（三）本基金参与交易所债券质押式融资回购交易前，需事先与基金托管人协商一致，并签署托管人结算模式债券质押式回购委托协议等基金托管人要求的协议文本后方可开展。	
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、基金托管人的固有财产。	（一）基金财产保管的原则 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和证券经纪机构的固有财产。
五、基金	（五）基金证券账户、结算备	（五）基金证券账户、证券资

<p>财产的保管</p>	<p>付金账户及其他投资账户的开设和管理</p> <p>1、基金托管人应当代表本基金，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设证券账户。</p> <p>2、本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。</p> <p>3、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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金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>金账户及其他投资账户的开设和管理</p> <p>1、基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。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的资金全额存放在基金管理人为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公司负责。</p> <p>2、基金证券账户与证券资金账户的开立和使用，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或证券资金账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。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</p>
---------------------	---	--

		结算。
<p>五、基金财产的保管</p>	<p>(五) 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理</p> <p>7、基金管理人在不违反法律法规规定和基金合同约定的前提下，可以根据本基金实际情况，决定本基金的证券交易结算模式，无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金采用券商结算模式，则相关账户的开设和管理按照以下规定执行：</p> <p>(1) 基金管理人为基金财产在证券经纪商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基金托管账户建立第三方存管关系。证券经纪商根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照该证券经纪商开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</p> <p>(2) 交易所证券交易资金采用</p>	

	<p>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所选择的证券经纪商负责。</p> <p>(3) 券商结算模式下不涉及的相关账户（如结算备付金账户等）无需开立。</p>	
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>(九) 基金管理人在不违反法律法规规定和基金合同约定的前提下，可以根据本基金实际情况，决定本基金的证券交易结算模式，无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金采用券商结算模式，则本章节涉及的上述规定仅针对场外交易部分。针对场内交易部分按照以下规定执行：</p> <p>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交易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交易资金账户之间划款，即银证互转；或由基金托管人根据基金管理人的划款指</p>	

	令执行银证互转。	
七、交易及清算交收安排		基金管理人在运用基金财产时，开展场内证券交易前，由基金托管人根据基金管理人的划款指令通过基金托管账户与证券交易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交易资金账户之间划款，即银证互转。
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 基金管理人负责选择代理本基金证券/期货买卖的证券/期货经营机构。</p> <p>1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：</p> <p>(1) 资金雄厚，信誉良好。</p> <p>(2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。</p> <p>(3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。</p> <p>(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。</p>	<p>(一) 基金管理人负责选择代理本基金证券/期货买卖的证券/期货经营机构。</p> <p>1、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，并与基金托管人、证券经营机构签订证券经纪服务协议，明确三方在本基金参与场内证券买卖中各类证券交易、证券交收及相关资金交收、交易数据传输及接收过程中的职责和义务。</p> <p>2、相关信息的通知</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以书面形式通知基金托管人，以便基金托管人估值核算使用。</p>

	<p>(5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。</p> <p>2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p> <p>基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议，并按照法律法规的规定向中国证监会报告。基金管理人应将交易单元租用协议的扫描件及时送交基金托管人。</p> <p>3、相关信息的通知</p> <p>基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人基金专用交易单元的代码、券商名称、佣金费率等基金基本信息以及变更情况，其中交易单元租用应至少在首次进行交易3个工作日前通知基金托管人，交易单元退租应在次日内通知到基金托管</p>	
--	--	--

	人。	
七、交易及清算交收安排	<p>(二) 基金的清算交收安排</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《托管人证券资金结算协议》, 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>1、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》, 在每月前3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, 在资金调节表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>2、基金托管人负责基金场内交</p>	<p>(二) 基金的清算交收安排</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; 本基金其它证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。</p> <p>基金托管人、基金管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定, 该等规则 and 规定自动成为本条款约定内容。</p> <p>基金管理人在投资前, 应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定的结算业务规则 and 规定。证券经纪机构代理本基金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; 若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成, 责任由基金管理人承担。对于任何原因发生的证券资金交收违约事件, 相关各方应当及时协商解决。</p>

易等的清算交收。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。基金托管人、基金管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

3、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直接损失的赔偿；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

	<p>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12:00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。基金管理人应知晓并同意下列事项：</p> <p>(1) 基金托管人有权向登记公司申报冻结其证券账户内与违约资金等额的证券，申报冻结证券的证券品种、数量可由基金托管人确定。登记公司根据</p>	
--	---	--

	<p>基金托管人申报的证券品种、数量办理相应冻结。基金管理人在规定时间内补足违约交收资金的，基金托管人向登记公司申报解除证券冻结。</p> <p>(2) 如因基金管理人原因造成债券质押式回购交收违约、但托管人未对登记公司交收违约的情况下，基金托管人有权向登记公司申报将基金管理人的回购质押券划转至基金托管人的证券处置账户，申报划转的质押券品种、数量可由基金托管人确定。登记公司根据基金托管人的申报办理相关质押券的划转。基金管理人在规定时间内补足违约交收资金的，基金托管人向登记公司申报将基金托管人证券处置账户内的相关证券划回至基金管理人的证券账户。</p> <p>(3) 基金管理人资金不能足额完成非担保交收业务品种资金交收的，按照登记公司相关规定执行。</p> <p>(4) 基金托管人有权以基金管理人的违约交收资金为基数，</p>	
--	---	--

	<p>按照有关规定计收违约金。</p> <p>4、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，基金托管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，由此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。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。对于要求当天到账的指令，应在当天15:00前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前2个工作小时发送（工作时间：9：00-17：00），且相关付款条件已经具备。管理人在上述截止时间之后发送的划款指令，托管人配合执行。</p> <p>5、对于在上海证券交易所固定收益平台和在深圳证券交易所综合协议交易平台交易的、实行“实时逐笔全额结算”和“T+0逐笔全额非担保交收”的业务，基金管理人应在交易日14:00前将划款指令发送至基金</p>	
--	---	--

	<p>托管人，14:00之后发送的，基金托管人尽力执行但不保证执行成功。因基金管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国证券登记结算有限责任公司所造成的责任按照中登相关业务规则及托管人与管理人签署的资金结算协议处理。</p> <p>6、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》、本协议的指令不得不合理拖延或拒绝执行。如由于基金托管人的过错导致基金无法按时支付证券清算款，由此给基金造成的损失由基金托管人承担。</p>	
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(三) 交易资金最高额度</p> <p>1、根据《上海证券交易所 深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》(以下简称“《业务规则》”)的规定，基金管理人应当依据在基金托管人处托管的产品合计资产总额以双方认可的方式向基金托管人提供资金前端控制最高额度(以下简称“最高额度”)相</p>	

	<p>关信息，基金管理人应确保提供的最高额度相关信息完整、真实有效且符合相关规定。因基金管理人未及时向基金托管人提供最高额度信息或所提交最高额度信息有误或不完整而导致最高额度申报失败，由此造成的责任及损失由基金管理人承担。</p> <p>2、基金托管人应对基金管理人申报信息的真实、完整性进行事后稽核。基金托管人发现基金管理人提供的最高额度相关信息违反法律法规规定或相关业务规定时，不予申报，并及时以双方认可的形式通知基金管理人纠正。在正常业务受理渠道和申报规定的时间内，因基金托管人原因未能及时提交或正确申报基金管理人提交的符合业务规定且真实有效的信息导致对基金管理人最高额度控制造成影响的，基金托管人应承担相应的责任，因不可抗力、意外事件等非基金托管人原因造成的情形，基金托管人不承担责任。</p>	
--	---	--

	<p>3、基金管理人应根据业务实际情况和自身风控需要向沪、深交易所申报自设额度。基金管理人应定期对自设额度进行评估、优化并对全天净买入申报金额及额度使用情况进行监测，出现接近最高或自设额度情形的，应当及时进行核查，采取相关措施保障后续交易的正常进行。因基金管理人自设额度与最高额度产生冲突而造成的损失，基金托管人不承担相应责任。</p> <p>4、基金管理人向基金托管人提供最高额度相关信息或盘中紧急申报信息时，应确保托管人有足够的处理时间（至少为2个工作小时）。在每个交易日13:00（盘中紧急申报为10:00）以后收到的最高额度相关信息或盘中紧急申报信息，基金托管人不保证当日完成申报流程。基金管理人因最高额度信息有误或发生重大变化需进行盘中紧急申报时，需按照中国结算相关规定提交相应材料，并在事后联合基金托管人</p>	
--	--	--

	<p>(如需要)向沪、深交易所提交书面说明。</p> <p>5、基金管理人、基金托管人应建立健全资金前端控制内部控制制度和应急预案,制定完备的资金前端控制业务流程,定期对资金前端控制相关工作进行合规审查;因任何一方未按照《业务规则》规定而导致的后果,由该方承担。</p> <p>6、基金管理人根据《业务规则》及本协议应承担的义务及责任不因授权他人代为办理而免除。</p>	
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(五)基金管理人在不违反法律法规规定和基金合同约定的前提下,可以根据本基金实际情况,决定本基金的证券交易结算模式,无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金采用券商结算模式,则本章节涉及的上述规定仅适用于基金托管人结算模式。券商结算模式的交易及清算交收安排按照以下规定执行:</p> <p>1、基金管理人负责选择代理本基金证券/期货买卖的证券/期</p>	

	<p>货经纪商。</p> <p>基金管理人负责选择证券经纪商，由基金管理人与基金托管人及证券经纪商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过程中的职责和义务。</p> <p>基金管理人应及时将基金佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式或双方认可的方式通知基金托管人，以便基金托管人估值核算使用。</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商，并与其签订期货经纪合同。基金管理人、基金托管人和期货经纪商可就本基金参与期货交易的具体事项另行签订协议。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、证券经纪商选择的规则执行。</p> <p>2、基金的清算交收安排</p> <p>本基金通过证券经纪商进行的</p>	
--	--	--

	<p>交易由证券经纪商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商应根据有关法律法规及相关业务规则，签订相关协议，用以具体明确三方在证券交易资金结算业务中的责任。</p> <p>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。</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。</p> <p>证券经纪商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，并承担由证券经纪商原因造成的正常结算、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结算业务无法完成，责任由基金管理人承担。如果因基金托管人原因在清算和交收中造成基金财产的损失，应</p>	
--	---	--

	<p>由基金托管人负责赔偿基金的损失。</p> <p>对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。</p> <p>本基金投资于期货发生的资金交割清算由基金管理人选定的期货经纪商负责办理。基金托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪商的资金不行使保管职责和交收职责，基金管理人应在期货经纪协议或其它协议中约定由选定的期货经纪商承担资金安全保管责任和交收责任。</p> <p>场外资金对外投资划款由基金托管人凭基金管理人符合本托管协议约定的有效资金划拨指令和相关投资合同（如有）进行资金划拨；场外投资本金及收益的划回，由基金管理人负责协调相关资金划拨回基金托管账户事宜。</p> <p>3、资金、证券账目和交易记录核对</p> <p>对基金的交易记录，由基金管</p>	
--	---	--

	<p>理人和基金托管人按日进行核对。对外披露各类基金份额净值之前，必须保证当天所有实际交易记录与基金会计账簿上的交易记录完全一致。</p> <p>基金管理人和基金托管人每个交易日结束后核对基金证券账目，确保双方账目相符。</p> <p>对于基金的资金账目，由相关各方每日对账一次，确保账账相符、账实相符。</p> <p>实物券账目，每月月末相关各方进行账实核对。</p> <p>相关各方可协商采用电子对账方式进行账目核对。</p>	
--	---	--

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《天弘MSCI中国A50互联互通指数证券投资基金招募说明书》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《天弘MSCI中国A50互联互通指数证券投资基金基金合同》、《天弘MSCI中国A50互联互通指数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

本公司网站：www.thfund.com.cn

本公司客服电话：95046

风险提示：

本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。敬请投资者注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇二二年三月十六日