

关于鹏扬红利优选混合型证券投资基金 证券交易结算模式转换有关事项的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求,提升鹏扬红利优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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》的有关规定和《鹏扬红利优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)的约定,经与本基金的基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,鹏扬基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定转换本基金的证券交易结算模式,由托管人结算模式改为券商结算模式,同时更新基金托管人信息,并相应修订《鹏扬红利优选混合型证券投资基金托管协议》(以下简称《托管协议》)及《鹏扬红利优选混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称《招募说明书》)。现将相关事项公告如下:

一、证券交易结算模式转换

自2022年7月26日起,本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换后,本基金的证券交易所交易结算将委托证券经纪机构办理,由证券经纪机构履行场内证券交易结算管理职责。同时,也对相关法律文件中涉及的基金托管人信息进行了更新。

二、修订《托管协议》的相关说明

章节	修订前	修订后
	内容	内容
一、基金托管协议当事人	<p>（二）基金托管人 注册地址：福建省福州市湖东路154号 法定代表人：陶以平 代为履行法定代表人职权)</p>	<p>（二）基金托管人 注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦 法定代表人：吕家进</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。 （六）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</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、证券经纪机构的固有财产。 （六）基金证券账户的开立和管理 删除： 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。 增加： （七）证券资金账户的开立与管理 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。 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，只能通过银证转账方式将资金划转至托管资金账户，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。</p>
六、指令的发送、确认及执行	<p>基金管理人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。 （三）指令的发送、确认及执行的时间和程序 1.指令的发送 ……基金管理人应在每个工作日的15:00以后发送的要求当日支付的划款指令，基金托管人保证当天能够执行。…… 3.指令的时间和执行 基金托管人对指令验证后，应及时办理。指令执行完毕后，基金托管人应及时通知基金管理人。</p>	<p>基金管理人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管账户与证券资金账户之间的资金划转，即银证互转。 基金管理人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。 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。 （三）指令的发送、确认及执行的时间和程序 1.指令的发送 ……基金管理人应在每个工作日的15:00以后发送的要求当日支付的划款指令，基金托管人保证当天能够执行。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。…… 3.指令的时间和执行 基金托管人对指令验证后，应及时办理。</p>

<p>七、交易及清算 清算安排</p>	<p>(一) 选择证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <ol style="list-style-type: none"> 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。 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。 基金管理人应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确认相关合并清算事宜已办结。 <p>二、基金投资证券后的清算交收安排</p> <ol style="list-style-type: none"> 关于基金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清算要求的证券交易以及新股业务: <ol style="list-style-type: none"> 基金托管人、基金管理人应共同遵守双方签订的《托管银行证券资金清算协议》。 基金托管人遵照中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定, 确定和调整该委托财产最低清算备付金、证券清算保证金限额, 基金管理人应存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金、清算保证金日本余额不得低于基金托管人根据中国证券登记结算有限责任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, 基金托管人根据中国证券登记结算有限责任公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。 根据中国证券登记结算有限责任公司托管行集中清算规则, 如委托财产T日进行了中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司T+1DVP卖出交易, 基金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日不可用也不可提, 该笔资金在T+2日才能划拨至托管专户。 基金管理人应在发送深圳新股网下申购划款指令时(指令的发送应及时且最晚于12:00之前), 应配合提供“配售对象ID号码”、“委托序号”、“证券代码”、“申请数量”、“申请价格”等新股申购要素信息, 以便基金托管人及时准确向中登深圳分公司上报配售对象名单。 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定, 清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中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金、交易保证金以及中国证券登记结算有限责任公司尚未支付的利息等款项。对上述款项, 基金托管人将于中国证券登记结算有限责任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, 中国证券登记结算有限责任公司根据清算规则, 调增计划的清算备付金以及交易保证金, 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。 基金管理人签署本协议, 即视为同意基金管理人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中国证券登记结算有限责任公司申请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。 关于基金资产在证券交易所市场达成的符合中国证券登记结算有限责任公司T+0非担保清算要求的证券交易: <ol style="list-style-type: none"> 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14:00向基金托管人发送交易应付资金划款指令, 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, 以保证当日交易资金交收的顺利进行, 中登业务规则允许采用RTGS交收的, 在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下, 托管人将进行勾单处理。对于基金管理人在14:00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。 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, 基金管理人应向基金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。 若基金管理人未及时出具交易应付资金划款指令, 或基金管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易, 基金托管人有权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, 所有损失由基金管理人承担。 对于根据清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(但并不确保)根据中国结算公司的清算交收数据, 主动将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。 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: <ol style="list-style-type: none"> 基金管理人所托管的基金资金不足导致交收失败, 由基金管理人承担交易失败的风险, 基金托管人无义务为基金垫付交收款项; 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交收失败的, 由基金管理人自行承担交易失败的风险; 因基金管理人所托管的基金资金不足, 且占用托管行最低备付金交收成功, 造成托管行损失, 则应对造成的直接损失承担赔偿责任, 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; 因基金管理人所托管的基金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基金托管人托管的其他产品交收失败和损失的, 基金管理人应对造成的直接损失承担赔偿责任。 基金管理人已充分了解托管行清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基金交收失败的, 则基金托管人将配合基金管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿; 如基金托管人存在过错的, 同时应在过错范围内对基金管理人承担赔偿责任。 对于基金采用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14:00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划回至基金资金托管账户。 <p>3、关于基金资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司T+N非担保清算要求的证券交易</p> <p>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, 基金管理人应于交收日前一工作日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。</p>	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构的程序</p> <p>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, 由基金管理人及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、清算等具体事项进行协议约定。</p> <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p>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清算规则办理。</p> <p>基金托管人负责基金场外买卖证券的清算交割, 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。</p> <p>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。</p> <p>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清算。</p>
-------------------------	--	--

本次《托管协议》修订的内容不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化, 不需召开基金份额持有人大会。本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序, 符合法律法规及《基金合同》的相关规定。

三、重要提示

1. 本基金证券交易结算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》。投资者可通过本公司网站(www.pyamc.com)或中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)查阅本基金修订后的法律文件。

2. 本公告仅对本基金证券交易结算模式转换等有关事项予以说明。欲了解本基金的详细情况, 投资人可登录本公司网站(www.pyamc.com)或拨打本公司客户服务热线(400-968-6688)获得相关详情。

四、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分, 并提出适当性匹配意见。投资者投资本公司管理的基金时, 应认真阅读基金合同、招募说明书(更新)、产品资料概要(更新)等法律文件, 全面认识基金的风险收益特征和产品特性, 在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上, 充分考虑自身的风险承受能力、投资期限和投资目标, 理性判断市场, 谨慎做出投资决策。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。请投资者严格遵守反洗钱相关法律法规的规定, 切实履行反洗钱义务。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司
2022年7月26日