

# 长信基金管理有限责任公司

## 关于长信金利趋势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

为了更好地满足投资者的需求,提升长信金利趋势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的市场竞争力,长信基金管理有限责任公司(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》的有关规定和《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》的约定,经与本基金的基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)协商一致,并报中国证监会备案,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,现将具体事宜公告如下:

### 一、证券交易结算模式转换

自2022年7月28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、因转换证券交易结算模式,拟对《长信金利趋势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	原条款	修订后条款
四、基金资产保管	(一)基金资产保管的原则 2.本基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的资产。本基金资产与基金托管人的其它资产或其它业务以及其它基金的资产实行严格的分账管理。	(一)基金资产保管的原则 2.本基金资产应独立于基金管理人、基金托管人和证券经纪机构的资产。本基金资产与基金托管人的其它资产或其它业务以及其它基金的资产实行严格的分账管理。
	(四)基金证券账户的开立和管理 1.本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司以本基金和基金托管人联名的名义开立证券账户,该账户用于本基金证券投资的交割和存管。基金托管人负责办理证券账户的开立事宜,并对证券账户业务发生情况根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司发送数据进行如实记录。 2.基金证券账户的开立和使用,限于满足开展该基金业务的需要。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本基金的任何证券账户,亦不得使用本基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。	(四)基金证券账户和证券交易资金账户的开立和管理 1.本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司以本基金和基金托管人联名的名义开立证券账户,该账户用于本基金证券投资的交割和存管。 2.基金证券账户和证券交易资金账户的开立和使用,限于满足开展该基金业务的需要。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本基金的任何证券账户,亦不得使用本基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。 3.基金托管人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。 …… 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托管账户建立第三方存管关系。 5.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。
	(五)债券托管专户的开设和管理 1.基金合同生效后,由基金管理人负责为基金向中国证监和中国人民银行申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据主管机关、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户,并代基金进行银行间市场债券的结算。在上述手续办理完毕后,由基金托管人负责向中国人民银行进行报备。	(五)债券托管专户的开设和管理 1.基金合同生效后,由基金管理人负责为基金向中国证监和中国人民银行申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据主管机关、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的开户,在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户,并代基金进行银行间市场债券的结算。在上述手续办理完毕后,由基金托管人负责向中国人民银行进行报备。
	(七)清算备付金账户的开立和管理 1.基金托管人应根据中国证券登记结算有限责任公司的有关规定,负责办理本基金资金清算的相关工作,基金管理人应予积极协助。 2.清算备付金账户按规定开立、管理和使用。 (八)证券账户卡保管 证券账户卡由基金托管人保管原件。	删除
五、投资指令的发送、确认与执行	无	基金管理人运用基金财产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令执行银证互转。 基金管理人运用基金财产时向基金托管人发送场外资金划拨及其他款项收付指令,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)投资指令发送、确认及执行的程序 1.投资指令的发送 基金管理人发送投资指令应采用加密传真方式。在特殊情况下,可采用双方协商一致的方式解决。	(三)投资指令发送、确认及执行的程序 1.投资指令的发送 基金管理人发送投资指令包括电子指令和纸质指令。
六、交易安排	(一)交易席位选用与变更 基金管理人负责选择证券经营机构,使用其席位作为基金的专用交易席位。基金管理人应选用资质雄厚、信誉良好、经营行为规范、内部管理健全并符合代理本基金进行证券交易其他条件的证券经营机构,签订书面的席位使用协议,并按照有关规定报中国证监会备案,并及时以书面形式通知基金托管人基金专用席位号、佣金费率等基金基本信息以及变更情况。 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基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。	(一)选择代理证券买卖的证券经纪机构 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,并承担相应责任。基金管理人和被选择的证券经纪机构签订证券经纪合同或其他约定的形式,由基金管理人通知基金托管人,并按法律法规要求在法定信息披露报告中披露有关内容。基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可就本基金参与证券交易的具体事项另行签订证券经纪服务协议。
	(二)基金投资证券后的清算、交割及账目核对 1.清算与交割 (1)证券交易资金清算 基金托管人负责办理基金买卖证券的清算交割。资金汇划由基金托管人根据基金的交易结果具体办理。 如果因为托管人故意或过失在清算上造成基金资产的损失,应由托管人负责赔偿基金的损失;如果因为基金管理人买空、卖空等行为造成基金投资清算困难和风险的,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,由此给基金造成的损失由基金管理人承担。 (2)结算方式 支付结算按主管机关和中国证券登记结算公司的有关规定办理。 (3)资金划拨 基金管理人有关资金划拨的投资指令,经基金托管人审核无误后按规定及时执行,不得延误。 如基金管理人的投资指令被发现违法、违规的,基金托管人不予执行,应通知基金管理人改正,同时报告中国证监会。 本基金证券投资的清算交割,由基金托管人通过证券登记结算公司、清算银行等办理。	(二)基金投资证券后的清算、交割及账目核对 1.清算与交割 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;本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责清算,基金管理人、基金托管人以及被选择的证券经纪机构应根据有关法律法规及相关业务规则,签订证券经纪服务协议,用以具体明确三方在证券交易资金清算业务中的责任。 本基金投资于所有场外交易的资金汇划,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清算业务,并承担由证券经纪机构原因造成的正常清算、交收业务无法完成的责任。 基金管理人负责选择代理本基金证券交易的证券经纪机构。本基金证券交易数据传输及清算交收相关约定,管理人、托管人将与证券经纪机构另行签署证券经纪服务协议。

七、基金认购、申购、赎回、分红及证券交易等资金的清算	<p>(六) 登记结算公司结算备付金账户的清算</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、若结算备付金账户发生透支,按登记结算公司有关规定计收违约金(含透支款利息,下同),该违约金最终由透支基金的基金管理人承担,但由于基金托管人的原因造成该账户透支的情形除外。</li> <li>2、基金托管人应在交收日(T+1)15:00之前向登记结算公司提交透支扣券申请书,指定其所托管的透支基金相关证券账户及透支金额。登记结算公司按其指定的透支基金相关证券账户买入证券成交的先后顺序,自后向前依次扣券,直至扣券总市值达到透支金额的120%为止。(证券市值按当日收盘价计算,下同)。如该基金证券账户内所有证券价值不足透支金额的120%,则扣该基金的全部证券。</li> <li>3、对于结算备付金账户因计收违约金形成的透支部分,可不采取本条第1.2款规定的措施。</li> <li>4、基金管理人应在T+2日前补足透支款及违约金,基金管理人按规定补足透支款及违约金后,这样登记结算公司应交付暂扣的证券。如果登记结算公司未及交付,基金托管人应根据《证券资金结算协议》的规定向登记结算公司追索。如基金管理人未及补足透支款及违约金,登记结算公司将卖出暂扣的证券,卖出款记入结算备付金账户以弥补其上述透支款项及违约金,不足部分仍向基金托管人追索,由此产生的相关损失赔偿和其它责任由基金管理人承担。</li> <li>5、若基金银行存款账户有足够资金余额,因基金托管人未及核对结算备付金是否有足额结余头寸或未及及时划拨以补足结算备付金等自身原因造成的结算备付金账户出现透支,相关损失赔偿和其它责任由基金托管人承担。</li> <li>6、如结算备付金账户未发生透支,但基金托管人所托管的基金发生透支,应基金托管人的申请,登记结算公司可协助基金托管人暂扣其指定的透支基金相关证券账户内相当于基金托管人所申报透支金额的120%的证券,并按照登记结算公司的相关规定,对透支基金采取按申报透支金额计收违约金等处罚措施。由此产生的最终责任由基金管理人承担,基金管理人应赔偿基金托管人因此而遭受的相关损失。如果由于基金托管人的指定发生错误等原因发生错误暂扣的,相关损失赔偿和其它责任由基金托管人承担。</li> <li>7、对于任何原因发生的证券资金结算透支事件,基金托管人可协助登记结算公司采取以下风险管理措施: <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 报告证监会。</li> <li>(2) 提请证券交易所限制或暂停基金托管人所托管的透支基金的证券买入等。</li> </ol> </li> <li>8、如基金托管人所托管的基金发生债券超额卖出或卖出回购质押债券而导致债券卖空行为的,登记结算公司在T+1日暂不交付卖空价款对应的资金。同时,以卖空价款为基数,按登记结算公司有关规定计收违约金,该违约金最终由基金管理人承担。如基金管理人在两个工作日内补足卖空债券,登记结算公司交付相应价款。否则,登记结算公司以暂扣资金买入与其卖空等量的证券,由此产生的损益由基金管理人承担。</li> <li>9、如基金托管人所托管的基金进行债券回购业务,基金管理人应确保有足额质押债券,如因质押债券不足导致债券融资回购未到期量超过标准券数量的,则登记结算公司在T+1日暂不交付超额融资回购款项,直至标准券数量足够符合质押要求,登记结算公司才交付相应款项。</li> <li>10、如基金托管人所托管基金发生大宗交易买入,基金管理人应在大宗交易发生前保证银行存款账户具有足额资金以满足基金托管人及时划拨用于当日交易结算。对资金不足部分,登记结算公司按买入大宗交易成交顺序,自后向前并以一笔为最小冻结单位冻结相关证券,待资金补足后再予解冻。</li> </ol>	<p>(六) 证券交易资金的清算</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;本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。</p> <p>本基金投资于所有场外证券交易的资金汇划,由基金托管人负责办理。</p>
八、基金资产估值、基金资产净值计算与复核	<p>(一) 基金资产估值</p> <p>6、特殊情形的处理</p> <p>基金管理人按照本条第2款第(4)项及第4款第(5)项进行估值时,所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理;由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或由于不可抗力原因,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而造成的基金资产估值错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>	<p>(一) 基金资产估值</p> <p>6、特殊情形的处理</p> <p>基金管理人按照本条第2款第(4)项及第4款第(5)项进行估值时,所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理;由于证券交易所、证券经纪机构及登记结算公司发送的数据错误,或由于不可抗力原因,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而造成的基金资产估值错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>
十九、净值差错处理	<p>(二) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,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而造成的基金资产净值计算错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。基金管理人、基金托管人因此承担赔偿责任的,有权向证券交易所及登记结算公司追偿。</p>	<p>(二) 由于证券交易所及登记结算公司、证券经纪机构发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,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而造成的基金资产净值计算错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。基金管理人、基金托管人因此承担赔偿责任的,有权向证券交易所及登记结算公司、证券经纪机构追偿。</p>

### 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。本公司将根据上述修订情况,在《长信金利趋势混合型证券投资基金招募说明书(更新)》中,对相关内容进行相应修改,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《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》、《长信金利趋势混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

2、投资者可通过本公司客户服务中心或官方网站咨询有关详情。

联系机构:长信基金管理有限责任公司

联系电话:400-700-5566

电子信箱:service@cxfund.com.cn

网站:https://www.cxfund.com.cn

### 四、风险提示

本基金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,但不保证本基金一定盈利,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,投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。