

# 长信基金管理有限责任公司

## 关于长信量化价值驱动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

为更好的满足投资者的需求，提升长信量化价值驱动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《长信量化价值驱动混合型证券投资基金基金合同》及《长信量化价值驱动混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的约定，经与本基金的基金托管人中国民生银行股份有限公司（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 12 月 23 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《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   |
|-------------|--|---|
| 一、基金托管协议当事人 | （二）基金托管人<br><del>组织形式：股份有限公司</del><br><del>注册资本：28,365,585,227 元人民币</del><br><del>存续期间：1996 年 02 月 07 日至长期</del> | （二）基金托管人<br><u>组织形式：其他股份有限公司（上市）</u><br><u>注册资本：43,782,418,502 元人民币</u><br><u>存续期间：1996 年 02 月 07 日至长</u> |

|                  |  |   |
|------------------|--|---|
|                  | <p><del>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；保险兼业代理业务以及依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）</del></p> | <p>期</p> <p><u>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务；证券投资基金销售、证券投资基金托管。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；保险兼业代理业务、证券投资基金销售、证券投资基金托管以及依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）</u></p> |
| <p>五、基金财产的保管</p> | <p>（一）基金财产保管的原则</p> <p>1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权</p>   | <p>（一）基金财产保管的原则</p> <p>1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人<u>和证券经纪机构</u>的固有财产。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担</p>  |

|              |   |  |
|--------------|---|--|
|              | <p>人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。</p>  | <p>法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。</p>   |
|              | <p>(三) 基金证券账户和<b>结算备付金账户</b>的开立和管理</p> <p><b>2.基金证券账户</b>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。</p> <p><b>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<b>结算备付金账户</b>，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。—<b>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。</b>—</b></p> | <p>(三) 基金证券账户、<b>证券交易资金账户</b>的开立和管理</p> <p><b>2. 基金管理人为基金财产在<b>证券经纪机构开立<b>证券交易资金账户</b></b>，用于基金财产<b>证券交易结算资金</b>的存管、记载交易<b>结算资金的变动明细以及场内<b>证券交易清算</b></b>，并与<b>基金托管人开立的<b>托管账户</b>建立<b>第三方存管关系</b>。</b></b></p> <p><b>3. 基金管理人承诺<b>证券交易资金账户</b>为主<b>资金账户</b>，不开立任何<b>辅助资金账户</b>；不为<b>证券交易资金账户</b>另行开立<b>银行托管账户</b>以外的其他<b>银行账户</b>。</b></p> <p><b>4. 基金证券账户和<b>证券交易资金账户</b>的开立和使用</b>，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<b>证券账户和<b>证券交易资金账户</b></b>，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。<b>本基金通过<b>证券经纪机构</b>进行的交易由<b>证券经纪机构</b>作为<b>结算参与人</b>代理<b>本基金</b>进行<b>结算</b>。</b></p> |
| <p>六、指令的</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</p>   | <p><b>基金管理人在运用基金财产开展场内<b>证券交易</b>前，基金管理人通过</b></p>   |

|  |   |  |
|--|---|--|
| <p>发送、<br/>确 认<br/>及 执<br/>行</p>       | <p>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。</u></p> <p>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送<u>场外</u>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>(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>基金管理人发送指令应采用加密传真方式或其他基金管理人和基金托管人双方书面共同确认的方式。</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>基金管理人发送指令应采用<u>包括电子指令和纸质指令</u>加密传真方式或其他基金管理人和基金托管人双方书面共同确认的方式。</p>   |
| <p>七、交<br/>易及<br/>清算<br/>交收<br/>安排</p> | <p>(一) 选择代理证券买卖、期货交易的<u>证券经营机构</u>、期货经纪机构<br/>基金管理人应设计选择代理证券买卖的<u>证券经营机构的标准和程序</u>。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的<u>证券经营机构</u>，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<u>证券经营机构签订委托协议</u>，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</p> | <p>(一) 选择代理证券买卖、期货交易的<u>证券经纪机构</u>、期货经纪机构<br/>基金管理人负责选择代理本基金<u>证券买卖的证券经纪机构</u>，由基金管理人<u>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</u>，就基金参与场内证券交易、<u>结算等具体事项进行约定</u>。</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金期货/期权交易的<u>经纪机构</u>，并与其签订经纪合同，其他事宜根据法</p> |

|   |   |
|---|---|
| <p>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。基金管理人负责选择代理本基金期货/期权交易的经纪机构，并与其签订经纪合同，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、证券经纪机构选择的规则执行。基金管理人选择的经纪公司负责办理委托资产的期货/期权交易的清算交割。</p> | <p>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、证券经纪机构选择的规则执行。基金管理人选择的经纪公司负责办理委托资产的期货/期权交易的清算交割。<u>基金管理人</u>对选择符合法律法规、监管规范要求的<u>证券经纪机构及期货经纪机构</u>负有责任。</p>       |
| <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><u>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或结算保证金进行重新核算、调整，基金管理</u></p>  | <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><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> |

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，以保证正常交易。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。

基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。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。

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

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。

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。



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、本基金资产造成的实际损失由基金管理人承担。

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 10:00 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、基金资产造成的实际损失由基金管理人负责。

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，基金托管人有权拒绝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

|                        |   |  |
|------------------------|---|--|
|                        | <p>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>八、基金资产净值计算和会计核算</p> | <p>（三）基金份额净值错误的处理方式</p> <p>3. 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算机构发送的数据错误或国家会计政策变更、市场规则变更等，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、基金托管人可免除赔偿责任。但基金管理人、基</p>  | <p>（三）基金份额净值错误的处理方式</p> <p>3. 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、<u>证券经纪机构</u>及登记结算机构发送的数据错误或国家会计政策变更、市场规则变更等，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、基金托管人可免除赔偿责任。</p> |



|  |                             |                                     |
|--|-----------------------------|-------------------------------------|
|  | 金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 | 但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 |
|--|-----------------------------|-------------------------------------|

### 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《长信量化价值驱动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《长信量化价值驱动混合型证券投资基金基金合同》、《长信量化价值驱动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。

长信基金管理有限责任公司

二〇二二年十二月二十一日