

德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)

证券交易模式转换有关事项的公告

为更好地满足广大投资者的投资理财需求,增强德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)的市场竞争力,德邦基金管理有限公司(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《德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,经与基金托管人国泰君安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2023年2月20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《德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)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	《托管协议》修改后条款
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 住所: 上海市虹口区吴淞路 218 号 3501B 室 办公地址: 上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元(公司运营与数据中心相关人员仍在上海市虹口区吴淞路 218 号 3501B 室办公)	(一) 基金管理人 住所: <u>上海市虹口区东大名路 501 号 503B 单元</u> 办公地址: 上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元
	(二) 基金托管人 法定代表人: 王松 联系人: 王健	(二) 基金托管人 法定代表人: <u>贺青</u> 联系人: <u>丛艳</u>
五、基金财产的	(一) 基金财产保管的原则	(一) 基金财产保管的原则

<p>保管</p>	<p>2、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>3、基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户、期货账户和债券托管账户等投资所需账户。</p>	<p>2、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和<u>证券经纪机构</u>的固有财产。</p> <p><u>3、基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，基金管理人</u>和基金托管人按照规定开立<u>期货资金账户</u>。</p> <p><u>5、证券经纪商根据相关法律法规规定及相关协议约定为本基金开立证券资金账户。基金管理人、基金托管人、证券经纪商三方应签订<u>证券经纪服务协议</u>。</u></p>
	<p>(二) 基金合同生效时募集资产的验证</p> <p>基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金募集金额符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效，且会计师事务所提交的验资报告需对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。</p>	<p>(二) 基金合同生效时募集资产的验证</p> <p>基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金募集金额符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效，且会计师事务所提交的验资报告需对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户<u>（即托管账户）</u>中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。</p>
	<p>(三) 基金的银行存款账户的开立和管理</p> <p>2、基金托管人以本基金的名义在商业银行开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。</p>	<p>(三) 基金的银行存款账户的开立和管理</p> <p>2、基金托管人以本基金的名义在商业银行开立基金的银行存款账户<u>（即托管账户）</u>，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金除<u>证券交易所场内交易以外的</u>货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通</p>

	<p>(四)基金的证券交收账户和资金交收账户的开立和管理</p> <p>基金托管人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立证券账户。</p> <p>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和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>基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。</p> <p>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即资金交收账户,用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。</p>	<p>过本基金的银行存款账户进行。</p> <p>(四)基金的证券账户和<u>证券资金账户</u>的开立和管理</p> <ol style="list-style-type: none"> <u>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。</u> <u>2.基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</u> <u>3.证券账户开立后,基金管理人以本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对应的证券资金账户,并通知基金托管人。证券资金账户用于本基金证券交易的结算以及证券交易结算资金的记录,并与本基金银行存款账户之间建立唯一银证转账对应关系,证券经纪机构对开立的证券资金账户内存放的资金的安全承担责任,基金托管人不负责保管证券资金账户内存放的资金。</u> <u>4.由基金托管人持基金管理人与证券经纪机构签订的三方存管相关协议办理证券资金账户与本基金银行存款账户的银证签约手续,未经基金托管人书面同意,基金管理人不得将银证签约的指定银行结算账户(即本基金银行存款账户)变更为其他账户,否则,因此引起的法律后果及给本基金造成的损失全部由基金管理人承担。</u> <u>5.本基金证券账户和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或未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户和证券资金账户;亦不得使用本基金的证券账户和证券资金账户进行</u>
--	--	---

		<p><u>本基金业务以外的活动。</u></p>
<p>六、指令的发送、确认和执行</p>	<p>新增</p>	<p><u>基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易时，应通过托管账户与证券资金账户已建立的第三方存管系统实现托管账户与证券资金账户之间的资金划转，即银证转账，基金托管人应当根据基金管理人的指令办理划款。</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。基金管理人发送指令应采用电子指令或传真或其它双方共同确认的方式。</u></p>
	<p>(二) 指令的内容</p> <p>指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令。指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收款人户名、收款人帐号、收款人开户行账户、大额支付号等执行支付所需内容，加盖预留印鉴。</p> <p>基金管理人同意基金托管人根据其收到的中国证券登记结算有限责任公司或深、沪证券交易所的交易数据与中国证券登记结算有限责任公司进行交收。基金财产投资发生的所有场内交易的清算交收，由基金托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理，基金管理人不需要另行出具指令。</p> <p>遵照中登上海预交收制度、中登深圳结算互保金制度、中登上海深圳备付金管理办法等有关规定所做的结算备付金、保证金及最低结算备付金的</p>	<p>(二) 指令的内容</p> <p>指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令。指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收款人户名、收款人帐号、收款人开户行账户、大额支付号等执行支付所需内容，加盖预留印鉴。</p>

	<p>调整也视为基金管理人向基金托管人发出的有效指令,无须基金管理人向基金托管人另行出具指令,基金托管人应予以执行,但应及时通知基金管理人。</p>	
	<p>(三) 指令的发送、确认和执行的时间和程序指令由“授权通知”确定的被授权人代表基金管理人用传真的方式向基金托管人发送。.....如基金管理人要求当天某一时点到账,必须至少提前 2 小时向基金托管人发送付款指令并与基金托管人电话确认。.....基金管理人向基金托管人下达指令时,应确保基金银行存款账户有足够的资金余额,对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令,基金托管人可不予执行,并立即通知基金管理人,基金托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。基金管理人应将银行间市场成交单加盖预留印鉴后传真给基金托管人。.....</p>	<p>(三) 指令的发送、确认和执行的时间和程序指令由“授权通知”确定的被授权人代表基金管理人用传真或双方协商一致的方式向基金托管人发送。.....如基金管理人要求当天某一时点到账,必须至少提前 2 工作小时向基金托管人发送付款指令并与基金托管人电话确认。.....基金管理人向基金托管人下达指令时,应确保基金银行存款账户有足够的资金余额,对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令,基金托管人可不予执行,并立即通知基金管理人,基金托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。.....</p>
<p>七、交易及清算 交收安排</p>	<p>(一) 代理证券、期货买卖的证券经营机构和期货经纪机构 基金管理人应制定选择的标准和程序,并根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经营机构进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经营机构,并承担相应责任。基金管理人和被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议,由基金管理人通知基金托管人,并在法定信息披露公告中披露有关内容。 基金管理人应及时将基金交易单元、佣金费率等</p>	<p>(一) 代理证券、期货买卖的证券经纪机构和期货经纪机构 基金管理人应制定选择的标准和程序,并根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经纪机构进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经纪机构,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<u>证券经纪合同</u>,由基金管理人通知基金托管人,并在法定信息披露公告中披露有关内容。<u>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。</u> <u>基金管理人应及时将基金专用交易单元号、佣金</u></p>

	<p><u>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>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>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任</p> <p><u>基金管理人</u>与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《<u>证券交易资金结算协议</u>》，用以具体明确基金管理人<u>与基金托管人</u>在<u>证券交易资金结算业务</u>中的责任。</p> <p><u>对基金管理人的资金划拨指令</u>，基金托管人在复核无误后应在规定期限内执行并在执行完毕后回函确认，不得延误。</p> <p><u>本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割</u>，全部由基金托管人负责办理。</p> <p><u>本基金</u>证券投资的清算交割，由基金托管人通过<u>中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行</u>办理。</p> <p>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，应由基金托管人负责赔偿基金的损失；如果因为基金管理人违反法律法规的规定进行证券投资或违反双方签订的《<u>证券交易资金结算协议</u>》而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，基金托管人应给予合理必要的配合，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序</p> <p>基金托管人在履行监督职能时，如果发现基金投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任</p> <p><u>本基金</u>通过<u>证券经纪机构</u>进行的交易由<u>证券经纪机构</u>作为<u>结算参与人</u>代理本基金进行结算；<u>本基金</u>其他<u>证券交易</u>由<u>基金托管人</u>或<u>相关机构</u>负责结算。基金管理人、基金托管人以及被选择的<u>证券经纪机构</u>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<u>证券交易资金结算业务</u>中的责任。</p> <p><u>对基金管理人的资金划拨指令</u>，基金托管人在复核无误后应在规定期限内执行并在执行完毕后回函确认，不得延误。</p> <p><u>本基金</u>投资于<u>证券</u>发生的所有<u>场外交易</u>的<u>资金汇划</u>，全部由基金托管人负责办理。</p> <p><u>证券经纪机构</u>代理本基金财产与<u>中国证券登记结算有限责任公司</u>完成<u>证券交易</u>及<u>非交易</u>涉及的<u>证券资金结算业务</u>，并承担由<u>证券经纪机构</u>原因造成的<u>正常结算、交收业务无法完成</u>的责任；若由于基金管理人原因造成的<u>正常结算业务无法完成</u>，责任由基金管理人承担。</p> <p>2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序</p> <p>基金托管人在履行监督职能时，如果发现基金投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基</p>

	<p>金造成的损失由基金管理人承担。如果基金管理人发生超买行为，必须于 T+1 日上午 12 时之前备足头寸，用以完成清算交收。</p>	<p>金造成的损失由基金管理人承担。</p>
	<p>(三) 基金管理人与基金托管人进行资金、证券账目、期货账目和交易记录的核对</p> <p>对基金的交易记录，由基金管理人按日进行核对。每日对外披露各类基金份额的基金份额净值之前，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。如果交易记录与会计账簿记录不一致，造成基金会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由基金的会计责任方承担。基金管理人每一交易日以双方认可的方式在当日全部交易结束后，将编制的基金资金、证券账目、期货账目传送给基金托管人，基金托管人按日进行账目核对。</p>	<p>(三) 基金管理人与基金托管人进行资金、证券账目、期货<u>账</u>目和交易记录的核对</p> <p>对基金的交易记录，由基金管理人按日进行核对。每日对外披露各类基金份额的基金份额净值之前，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。如果交易记录与会计账簿记录不一致，造成基金会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由基金的会计责任方承担。基金管理人每一交易日以双方认可的方式在当日全部交易结束后，将编制的基金资金、证券账目、期货<u>账</u>目传送给基金托管人，基金托管人按日进行账目核对。</p>
	<p>(四) 申购、赎回、转换开放式基金的资金清算和数据传递的时间、程序及托管协议当事人的责任界定</p> <p>.....</p> <p>3、本基金的资金清算</p> <p>基金申购、赎回等款项采用轧差交收的结算方式，净额在最晚不迟于交收当日 15:00 前在基金管理人总清算账户和资产托管专户之间交收。申购资金交割时间最晚不迟于 T+2 日 (T 日为申请日，下同)，赎回资金交割时间最晚不迟于 T+3 日。如果当日基金为净应收款，基金管理人应在 15:00 时之前从基金管理人总清算账户划往资产托管专户。基金托管人应及时查收资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管</p>	<p>(四) 申购、赎回、转换开放式基金的资金清算和数据传递的时间、程序及托管协议当事人的责任界定</p> <p>.....</p> <p>3、本基金的资金清算</p> <p>基金申购、赎回等款项采用轧差交收的结算方式，净额在最晚不迟于交收当日 15:00 前在基金管理人总清算账户和资产托管专户之间交收。申购资金交割时间最晚不迟于 T+2 日 (T 日为申请日，下同)，赎回资金交割时间最晚不迟于 T+3 日。</p>

	<p>理人划付。对于未准时划付的资金，基金托管人应及时通知基金管理人划付，由此产生的责任应由责任方承担。基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。</p> <p>如果当日基金为净应付款，基金托管人应根据基金管理人的指令将净应付额在 12:00 前划往基金管理人总清算账户。对于未准时划付的资金，基金管理人应及时通知基金托管人划付，由此产生的责任应由责任方承担。基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。</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《德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)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《德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《托管协议》、《德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、重要提示

投资者可通过以下途径咨询有关详情：客户服务电话 400-821-7788、021-26010928 咨询，网址：www.dbfund.com.cn。

风险提示：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。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。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同和招募说明书等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

德邦基金管理有限公司

2023年2月16日