

鑫元基金管理有限公司关于鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金转换证券交易结算模式有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，增强鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，鑫元基金管理有限公司（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》《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金基金合同》和《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金托管协议》的有关规定，经与基金托管人中国光大银行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2023年4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《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式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，修订内容详见附件。

三、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，按规定更新《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金招募说明书》等资料，并在规定媒介披露。

本公告未尽事宜，敬请投资者参见《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金基金合同》《托管协议》《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新、《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要》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：

(1) 本公司客户服务电话：400-606-6188

(2) 本公司网站：www.xyamc.com

投资者也可前往本基金有关销售机构进行咨询，本基金的销售机构详见基金管理人网站，基金管理人可根据情况变更或调整本基金的销售机构，并在基金管理人网站公示。

风险提示：基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资者申购基金份额时应认真阅读基金招募说明书、基金产品资料概要等文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力。

鑫元基金管理有限公司

2023年4月26日

附件

《鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

章节	原版本	修订后版本
	内容	内容
五、基金财产的保管	<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；</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>证券经纪机构</u>的固有财产；</p>
	<p>(三) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>2、基金证券账户的开立和使用，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>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、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。</p> <p>5、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。</p>	<p>(三) 基金证券账户、<u>证券资金账户</u>的开立和管理</p> <p>2、基金证券账户和<u>证券资金账户</u>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和<u>证券资金账户</u>，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><u>4、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结算资金的存管、场内证券交易的结算，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></p> <p><u>5、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></p> <p><u>6、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关</u></p>

六、指令的发送、确认及执行	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。	规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。 <u>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> 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 <u>收付</u> 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。
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的<u>证券经营机构</u></p> <p>基金管理人应设计选择代理证券买卖的<u>证券经营机构</u>的标准和程序。<u>基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为基金的交易单元。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，基金管理人应提前通知基金托管人，并将被选中证券经营机构提供的《基金用户交易单位变更申请书》及时送达基金托管人，确保基金托管人申请接收结算数据。交易单元保证金由被选中的证券经营机构交付。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，并将该等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。</u></p>	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的<u>证券、期货经纪机构</u></p> <p><u>基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，由基金管理人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></p> <p>基金管理人应<u>制定</u>选择的标准和程序，并负责根据相关标准以及内部管理制度对有关<u>证券经纪机构</u>进行考察后确定代理本基金证券买卖<u>证券经纪机构</u>，并承担相应责任。</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》，在每月前2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当日，在资金流量表中反映最低备付金调整的情况。管理人应预留最低备付金，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数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。</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>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；本基金通过期货经纪机构进行的交易由期货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。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结算业务中的责任。</u></p> <p><u>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</u></p>

<p>根据《中国证券登记结算有限责任公司证券结算保证金管理办法》，在每月前2个营业日内，中国证券登记结算有限责任公司对结算参与人的结算保证金进行调整，基金托管人在调整当日，在资金流量表中反映结算保证金的调整情况，基金管理人应预留足够头寸。</p> <p>根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券资金结算业务规则，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于季度初，调整互保基金基数，基金托管人在调整当日，在资金流量表中反映互保基金调整情况，基金管理人应预留足够头寸。若基金管理人参与权证交易，应按中国证券登记结算有限责任公司要求缴纳权证交收履约保证金，中国证券登记结算有限责任公司于每月第一个交易日调整交收履约保证金，基金管理人应预留足够头寸。</p> <p>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。</p> <p>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，并确保于交收日11点前完成融资，用以完成清算交收。基金托管人应给予必要的配合，由此给基金托管人、本基金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措施，确保在T+1日上午10:00前有足够的资金头寸用于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的资金结算。</p> <p>通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让，中国证券</p>	<p>负责办理。证券经纪机构代理本基金财产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。</p>
---	--

<p>登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算 (RTGS)。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:30 分, 为保证 RTGS 交易成功, 管理人应于交易 T 日的 15:00 之前, 将买入私募债券的指令传真至托管人。</p> <p>通过深圳综合协议平台的公司债、私募债, 结算方式为逐笔全额非担保交收, 最终交收时点为 T 日 16:00, 因此管理人应于 T 日 15:30 分之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。</p> <p>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, 基金托管专户或资金交收账户 (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基金管理人发送的划款指令, 但应及时通知基金管理人。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 (该必需的时间不长于正常情况下基金托管人日常处理该指令所用的平均时间)。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>若由于结算机构的交收规则发生变化, 基金托管人和基金管理人应根据新的交收规则作出相应变动, 基金管理人应配合基金托管人为完成交收提供必要的帮助。</p>	
---	--