

关于嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金 证券交易结算模式转换并修改托管协议的公告

为更好地满足投资者需求，提升嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的有关规定，嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人中信建投证券股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定转换本基金的证券交易结算模式，由托管人交易结算模式改为证券经纪商交易结算模式，并相应修改《托管协议》。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自 2023 年 10 月 12 日起，本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换完成后，本基金参与证券交易所交易结算将委托证券经纪商办理，由证券经纪商履行场内证券交易结算管理职责。

本次证券交易结算模式的转换以及对《托管协议》的修改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审议。

二、托管协议的修改

因转换证券交易结算模式，本基金拟对《托管协议》相关条款进行修改，修改内容详见附件《<嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议>修改前后文对照表》。

基金管理人将对本基金招募说明书及基金产品资料概要进行更新。

三、重要提示

1、 本基金证券交易结算模式转换完成时间及修改后的《托管协议》生效时间将另行公告。

2、 基金管理人已就本次转换证券交易结算模式并修改《托管协议》事宜履行了适当程序，符合法律法规、监管机构和《基金合同》的规定。

3、投资者欲了解基金信息请仔细阅读本基金的《基金合同》、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）及相关法律文件。投资者可登录本基金管理人网站（www.jsfund.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-600-8800）获取相关信息。

四、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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。投资者在投资基金之前，请仔细阅读《基金合同》和基金产品资料概要（更新）、招募说明书（更新），全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年10月11日

附件：《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
一、 托管 协议 当事 人	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 名称：嘉实基金管理有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区世 纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 名称：嘉实基金管理有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区陆 家嘴环路 1318 号 1806A 单元
二、 托管 协议 的依 据、 目 的、 原 则 和 解 释	（一）依据 本协议依据《中华人民共和国 合同法 》、 《中华人民共和国证券投资基金法》（以 下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投 资基金运作管理办法》（以下简称“《运 作办法》”）、《公开募集证券投资基金信 息披露管理办法》（以下简称“《信息披 露办法》”）、《公开募集开放式证券投资 基金流动性风险管理规定》及其他有关 法律法规与《嘉实中证 500 指数增强型 证券投资基金基金合同》（以下简称“《基 金合同》”）订立。	（一）依据 本协议依据《中华人民共和国 民法典 》、 《中华人民共和国证券投资基金法》（以 下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投 资基金运作管理办法》（以下简称“《运 作办法》”）、《公开募集证券投资基金信 息披露管理办法》（以下简称“《信息披 露办法》”）、《公开募集开放式证券投资 基金流动性风险管理规定》及其他有关 法律法规与《嘉实中证 500 指数增强型 证券投资基金基金合同》（以下简称“《基 金合同》”）订立。
五、 基金 财产 的保 管	（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。	（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 托管人和 证券经纪机构 的固有财产。
	（五） 基金 证券账户、 结算备付金 账户 及其他投资账户的开设和管理 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。 2、 本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或转让本 基金的证券账户，亦不得使用本基金的 证券账户进行本基金业务以外的活动。 3、 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结算 备付金账户，用于办理基金托管人所托 管的包括本基金在内的全部基金在证 券交易所进行证券投资所涉及的资金 结算业务。结算备付金的收取按照中国 证券登记结算有限责任公司的规定执 行。	（五） <u>证券账户、证券交易资金账户</u> 及 其他投资账户的开设和管理 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。 2、 <u>证券账户的开立由基金托管人负责， 账户资产的管理和运用由基金管理人 负责。</u> 3、 <u>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，用于场内 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本基金托 管账户建立第三方存管关系。</u> 4、 <u>交易所证券交易资金采用第三方存 管模式，即用于场内证券交易结算的资 金全额存放在基金管理人所选择的证 券公司为基金开设的证券交易资金账 户中，场内的证券交易资金清算由基金 管理人所选择的证券公司负责。基金托</u>

		<p>管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券交易资金账户内存放的资金。</p> <p>基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户、证券交易资金账户，亦不得使用证券账户或证券交易资金账户进行本基金业务以外的活动。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。</p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>无</p>	<p>对于场内业务，基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易前，通过基金托管人建立基金托管账户与证券交易资金账户的第三方存管关系，由基金托管人根据基金管理人发送的指令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。</p> <p>对于场外业务，基金管理人在运用基金财产时，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。</p>
<p>七、交易及清算安排</p>	<p>(一) 基金管理人负责选择代理本基金证券、期货、期权买卖的证券、期货、期权经营机构。</p> <p>1、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p> <p>基金管理人根据相关标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议，并按照法律法规的规定向中国证监会报告。基金管理人应将交易单元租用协议的原件及时送交基金托管人。</p> <p>2、相关信息的通知</p> <p>基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人基金专用交易单元的号码、券商名称、佣金费率等基金基本信息以及变更情况，其中交易单元租用应在至少在首次进行交易的 10 个工作日前通知基金托管人，交易单元退租应在次日内通知到基金托管人。</p>	<p>(一) 基金管理人负责选择代理本基金证券、期货、期权买卖的证券、期货、期权经营机构。</p> <p>1、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</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，明确三方在本基金进行证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。</p> <p>基金管理人应制定选择的标准和程序，并负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经纪机构进行考察后确定代理本基金证券买卖的证券经纪机构。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纪机构的有关情况、支付的佣金等予以披露，并将该等情况及佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形</p>

<p>(二) 基金清算交收</p> <p>1、因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交收，由基金托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。</p> <p>2、由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的，由责任方承担相应的责任。基金管理人同意在发生以上情形时，基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。</p> <p>3、由于基金管理人或基金托管人原因导致基金无法按时支付清算款时，责任方应对由此给基金财产造成的损失承担相应的赔偿责任。</p> <p>4、基金管理人应保证在交收日(T+1日)12:00前基金托管账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如基金的资金头寸不足则基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。</p> <p>5、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，基金托管账户或资金交收账户上有充足的资金。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，由此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。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。对于要求当天到账的指令，应在当天15:00前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前2个工作小时发送，并相关付款条件已经具备。对于新股申购网下公开发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T日)的前一日下班前将新股申购指令发送给托管人，指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00时。</p> <p>对于中国证券登记结算有限责任公司实行T+0非担保交收的业务，基金管理人应在交易日14:00将划款指令发送至基金托管人。</p> <p>因基金管理人指令传输不及时，致使资</p>	<p><u>式通知基金托管人。</u></p> <p>(二) 基金清算交收</p> <p><u>本基金所有场外买卖证券的清算交收，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。本基金所有场内交易的清算交收，由基金管理人负责委托代理证券买卖的证券经营机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。</u></p>
--	--

	<p>金未能及时划入中国证券登记结算有限责任公司所造成的责任按照中登相关业务规则及托管人与管理人签署的资金结算协议处理。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》、本协议的指令不得以不合理拖延或拒绝执行。</p>	
--	---	--