

招商基金管理有限公司关于招商创业板指数增强型证券投资基金 证券交易模式转换有关事项的公告

为了更好地为投资者提供服务，招商基金管理有限公司（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》《招商创业板指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人中国银河证券股份有限公司协商一致，决定对本基金转换证券交易模式，同时对基金托管人信息进行更新。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易模式转换

自 2023 年 11 月 2 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《招商创业板指数增强型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的相关条款进行修订，具体修订内容请见本公告附件。

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。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《招商创业板指数增强型证券投资基金基金合同》《招商创业板指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、重要提示

此次转换证券交易模式及《托管协议》的修订，已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定及《基金合同》的约定。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

招商基金全国统一客户服务热线：400-887-9555（免长途话费）

网址：www.cmfchina.com

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、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件，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。

招商基金管理有限公司

2023年10月31日

附件：《招商创业板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	原文条款内容	修改后条款内容
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>.....</p> <p>注册地址：中国北京市西城区金融大街35号2-6层 通讯地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦 法定代表人：陈共炎</p> <p>.....</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25号</p> <p>.....</p> <p>经营范围：证券经纪，证券投资咨询，与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问，证券承销与保荐，证券自营，融资融券，证券投资基金代销，为期货公司提供中间介绍业务，代销金融产品，证券投资基金托管业务，保险兼业代理业务，销售贵金属制品</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>.....</p> <p>注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101 法定代表人：陈亮</p> <p>.....</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2006]322号</p> <p>.....</p> <p>经营范围：证券业务；公募证券投资基金销售；保险兼业代理业务；证券公司为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）一般项目：金银制品销售。（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）（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。）</p>
五、基金财产的保管	<p>(四) 基金证券账户及结算备付金账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>基金托管人以基金托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立托管人结算备付金账户，用手所托管产品的证券资金清算。结算备付金、结算互保基金、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。基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户，亦不得使用证券账户进行本基金业务以外的活动。</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>.....</p> <p>基金管理人以基金名义在证券经纪机构营业网点开立证券资金账户，并按照该营业网点的流程和要求，签订相关的协议，并办理三方存管。 交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开设证券资金账户中，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，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。 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。</p>
六、指令的发送、	<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。</p>	<p>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</p>

<p>确 认 和 执 行</p>	<p>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。</p>	<p>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。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。</p>
	<p>(二) 指令的内容 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（T+0 非担保交收除外）。 遵照中国结算上海预交收制度、中国结算深圳结算互保金制度、中国结算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。</p>	<p>(二) 指令的内容 删除</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/期货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证券经纪机构，并与其签订证券交易单元使用协议。 基金管理人与基金托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，基金管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若基金管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由基金管理人承担。</p> <p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排 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>(一) 代理证券、期货买卖的证券/期货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证券经纪机构，并与其签订证券经纪合同，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议，明确三方在本基金进行证券买卖的中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。</p> <p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排 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>基金管理人与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《证券交易资金结算协议》，用以具体明确基金管理人与基金托管人在证券交易资金结算业务中的责任。</p> <p>对基金管理人的资金划拨指令，基金托管人在对印鉴和签名表面一致性复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。</p> <p>本基金证券投资的清算交割，由基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、其他相关登记结算机构及清算代理银行办理。</p> <p>如果因基金托管人过错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直接损失；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《证券交易资金结算协议》而造成基金投资清算困难和风险的，基金托管人发现后有权立即书面通知基金管理人，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>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。基金托管人、基金管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则和规定，该等规则和规定自动成为本条款约定的内容。</p> <p>基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定的结算业务规则和规定。</p> <p>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；若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由基金管理人承担。对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。</p>
<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>.....</p> <p>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3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、结算保证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、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结算保证金。基金管理人应预留最低备付金和结算保证金，并根据中国证券登记结算有限责任公司确定的实际最低备付金、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过错在清算上</p>	<p>删除</p>

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、超卖及质押券欠库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、本基金和基金托管人托管的其他资产造成的直接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、基金资产及基金托管人托管的其他资产造成的直接损失由基金管理人负责。

根据中国证券登记结算有限责任公司结算规定，基金管理人在进行融资回购业务时，用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因基金管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库，导致中国证券登记结算有限责任公司欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由基金管理人承担。

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，基金托管资金专门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，并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。在基金资金头寸充足的情况下，

	<p>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>实行场内 T+0 非担保交收的资金清算按照基金托管人的相关规定流程执行。</p>	
--	--	--