

# 关于创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，提升创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，创金合信基金管理有限公司（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》等法律法规的有关规定和《创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与基金托管人北京银行股份有限公司协商一致，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证券公司交易结算模式，并相应修改《创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）及《创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）的相关内容，现将具体事宜公告如下：

## 一、证券交易结算模式转换

自 2024 年 1 月 3 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	原托管协议内容	修订后托管协议内容
五、基金财产保管	（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 <u>证券经纪机构</u> 的固有财产。
	（四）基金证券账户、 <u>结算备付金账户</u> 与期货账户的开设和管理 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	（四）基金证券账户、 <u>证券交易资金账户</u> 与期货账户的开设和管理 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

	<p>算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司开设证券账户。</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书面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证券账户进行本基金业务以外的活动。</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,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、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。</p>	<p>算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司开设证券账户。</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书面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证券账户进行本基金业务以外的活动。</p> <p><u>基金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。证券账户开立后,基金管理人以本基金的名义在代理证券买卖的证券经纪商处开立证券交易资金账户,用于本基金交易所场内证券交易的结算以及现金资产的记录。本基金参与交易所证券交易的交易结算资金应由第三方存管银行存管,本基金在证券经纪商开立的证券交易资金账户、基金管理人以本基金名义在第三方存管银行开立的银行结算账户以及第三方存管银行为本基金建立的交易结算资金管理账户应当一一对应。基金管理人代表本基金与证券经纪商和第三方存管银行签署第三方存管协议及相关协议。本协议生效期间,银证转账密码由基金托管人负责保管和使用。如需开立期货账户,基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开立和管理期货账户。</u></p>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>如需开立期货账户,基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开立和管理期货账户。</p>	
<p>六、指令的发送、确认和执行</p>	<p>基金管理人发送的指令包括电子指令、纸质指令或双方认可的其他形式。对发送指令人员的授权方式、指令内容、指令发送和确认方式及其他相关事项应当按照本协议约定或基金管理人和基金托管人双方书面共同确认的方式执行。</p>	<p><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。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。基金管理人发送的指令包括电子指令、纸质指令或双方认可的其他形式。对发送指令人员的授权方式、指令内容、指令发送和确认方式及其他相关事项应当按照本协议约定或基金管理人和基金托管人双方书面共同确认的方式执行。</u></p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序 基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券、期货经营机构。 基金管理人负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券、期货经营机构进行考察后确定代理本基金证券、期货买卖的证券、期货经营机构,并承担相应责任。基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券、期货经营机构和被选择的证券、期货经营</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构的标准和程序 基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪商,由基金管理人与基金托管人及证券经纪商签订本基金的证券经纪服务协议,基金管理人、基金托管人和证券经纪商可就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。 基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构,并与其</p>

	<p>机构签订交易单元使用协议,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专用交易单元号、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。</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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割,全部由基金托管人负责办理。</p> <p>本基金</p> <p>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经济损失;如果因为基金管理人违反法律法规的规定进行证券投资</p>	<p>签订期货经纪合同,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、证券经纪商选择的规则执行。</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>本基金通过</p> <p>证券经纪商进行的交易所场内交易由证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算;本基金其他场外证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。</p> <p>本基金</p> <p>场外证券投资的清算交割,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。如因基金托管人的自身原因在清算上造成基金资产的损失,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的投资运作行为而造成基金投资清算困难和风险的,基金托管人发现后应及时通知基金管理人,由基金管理人负责处理,基金托管人应给予必要的配合。</p> <p>基金托管人、基金管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司制定的相关业务规则 and 规定,该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。</p> <p>基金管理人</p> <p>在投资前,应充分知晓与理解中国证券登记结算有限责任公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>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,基金托管人发现后有权立即通知基金管理人,由基金管理人负责解决,基金托管人应给予必要的配合,由此给基金资产、基金托管人及基金托管人托管的其他资产造成的直接经济损失由基金管理人承担。</p> <p>2、<u>基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序</u></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,应当立即书面提醒基金管理人,由基金管理人负责解决,由此给基金造成的损失由基金管理人承担。如果因基金管理人原因发生超买行为,必须于 T+1 日上午 10:00 时之前完成融资,用以完成清算交收。</p> <p>3、<u>基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序</u></p> <p>基金管理人应确保基金托管人在执行基金管理人发送的指令时,有足够的头寸进行交收。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。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所需的合理时间。如由于基金管理人的原因导致无法按时支付证券清算款,由此给基金资产、基金托管人及基金托管人托管的其他资产造成的直</p>	<p><u>证券经纪商代理本基金财产与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务,并承担由证券经纪商原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任;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</u>的直接经济损失。</p>
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>接损失由基金管理人承担。</p> <p>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》、基金托管协议的指令不得拖延或拒绝执行。如由于基金托管人的过错导致基金无法按时支付证券清算款,由此给基金造成的损失由基金托管人承担。</p>	
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--

### 三、重要提示

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,本公司将依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介公告修订后的《托管协议》及《招募说明书》。

投资者可通过本公司的客服热线或网站咨询有关详情:

创金合信基金管理有限公司

客服电话: 400-868-0666

网址: [www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

创金合信基金管理有限公司

2024年1月3日