

# 东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告

为了更好地满足广大投资者的理财需求，东兴基金管理有限公司（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》的有关规定、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的约定，并与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，决定转换东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的证券交易模式并修改《托管协议》。现将具体事宜公告如下：

一、自 2024 年 3 月 12 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经营机构办理，由证券经营机构履行交易管理职责。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等，拟对《托管协议》相关条款进行修订，具体修订内容请见本公告附件。

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《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（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《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《托管协议》、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

本公司网址：[www.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)

客户服务电话：400-670-1800

四、本公告的解释权归东兴基金管理有限公司。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。投资者购买证券投资基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自

身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

东兴基金管理有限公司

2024年3月12日

附件：《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修订前后对照表

章节	修订前	修订后
<p><b>一、基金托管协议当事人</b></p>	<p>(一) 基金管理人 法定代表人：银国宏</p> <p>(二) 基金托管人 注册地址：福建省福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 邮政编码：350013 法定代表人：高建平</p>	<p>(一) 基金管理人 法定代表人：<u>牛南洁</u></p> <p>(二) 基金托管人 注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦 办公地址：上海市银城路167号 邮政编码：<u>200120</u> 法定代表人：<u>吕家进</u></p>
<p><b>五、基金财产的保管</b></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、基金托管人的固有财产。</p> <p>3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户。</p> <p>5.基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。</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/期货经营机构</u>的固有财产。</p> <p>3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金<u>托管</u>账户、证券账户及投资所需的其他账户。</p> <p>5.基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。</p>
<p><b>五、基金财产的保管</b></p>	<p>(三) 基金银行账户的开立和管理</p> <p>1-基金托管人以基金托管人的名义开设本基金的基金托管专户，<del>也称为资金账户</del>，保管基金财产的银行存款。<del>该基金托管专户同时也是基金托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本基金财产在内的所有托管资产与中登公司进行一级结算的专用账</del></p>	<p>(三) 基金<u>托管资金</u>账户的开立和管理</p> <p>1、基金托管人以<u>本基金</u>的名义在其营业机构<u>开立基金的托管资金账户</u>（也称“<u>托管账户</u>”），保管基金的银行存款，并根据<u>基金管理人的指令</u>办理资金收付。托管账户名称应为“东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金”，预留印鉴为基金托管人印章。</p>

	<p>户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。</p> <p>2. 基金托管人可根据实际情况需要，为本基金开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。</p> <p>3. 基金托管专户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；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. 基金托管专户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。</p> <p>5. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管专户办理基金资产的支付。</p>	<p>2、<u>基金托管资金账户</u>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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何<u>其他银行账户</u>进行本基金业务以外的活动。</p> <p>3、<u>基金托管资金账户</u>的开立和管理应符合<u>法律法规及银行业监督管理机构</u>的有关规定。</p>
<p><b>五、基金财产的保管</b></p>	<p>(六) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>3. 基金证券账户的开立和<u>证券账户卡</u>的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>4. 基金托管人以基金托管人的名义在中登公司开立<u>结算备付金账户</u>，并代表所托管的基金完成与中登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、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中登公司的规定执行。</p>	<p>(六) 基金证券账户和<u>证券资金账户</u>的开立和管理</p> <p>3. 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。</p> <p>4. <u>基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构营业网点开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</u></p> <p>5. <u>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的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经营机构负责。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。</u></p>
<p><b>六、指令的发送、确认及执行</b></p>		<p><u>基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易时，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</u></p>

	<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><u>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></p> <p>基金管理人在运用基金财产开展场外证券交易时，向基金托管人发送<u>场外资金划拨及其他款项收付指令</u>，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><u>基金管理人发送的指令包括电子指令和纸质指令。</u></p> <p><u>电子指令包括基金管理人发送的电子指令（采用深证通金融数据交换平台发送的电子指令、通过托管网银发送的电子指令）、自动产生的电子指令（托管业务系统通过预先设定的业务规则自动产生的电子指令）。电子指令一经发出即被视为合法有效指令，纸质指令作为应急方式备用。基金管理人通过深证通金融数据交换平台和托管网银发送的电子指令，基金托管人根据 User ID 唯一识别基金管理人身份，基金管理人应妥善保管 User ID，基金托管人身份识别后对于执行该电子指令造成的相应损失基金托管人不承担责任。</u></p>
<p><b>六、指令的发送、确认及执行</b></p>	<p>（八）其他事项</p> <p>基金管理人同意基金托管人根据其收到的中登公司或深、沪证券交易所的交易数据与中登公司进行交收。基金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>（八）其他事项</p>
<p><b>七、交易及清算</b></p>	<p>（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p>	<p>（一）选择代理证券买卖、期货交易的证券、期货经营机构的程序</p>

<p><b>交收安排</b></p>	<p><del>1、基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易单元使用协议。</del></p> <p><del>2、基金管理人应及时将本基金财产证券交易单元号、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。</del></p> <p><del>3、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。</del></p> <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p><del>1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：—</del></p> <p><del>—(1)、基金托管人、基金管理人应共同遵守双方签订的《托管银行证券资金结算协议》。—</del></p> <p><del>—(2)、基金托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，基金管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于基金托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。基金托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。—</del></p> <p><del>—(3)、根据中登公司托管行集中清算规则，如委托财产 T 日进行</del></p>	<p>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，并与其签订<u>证券经纪合同</u>，<u>基金管理人、基金托管人和证券经营机构就本基金参与证券交易的具体事项另行签订协议，明确三方在本基金参与场内证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收、交易数据传输与接收过程中的职责和义务。</u>基金管理人应及时将本基金财产的<u>佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知基金托管人，以便基金托管人估值核算使用。</u></p> <p><u>本基金投资期货相关事宜，需基金管理人、基金托管人、期货经营机构另行签署相关操作协议，并遵照协议中的约定执行。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、证券经营机构选择的规则执行。基金管理人选择的期货经营机构负责办理委托资产的期货交易的清算交割。</u></p> <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p><u>本基金通过证券经营机构进行的交易由证券经营机构作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金通过期货经营机构进行的交易由期货经营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营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>
--------------------	---	---

子中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易,基金管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸,即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提,该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管专户。

—(4)、根据中国证券登记结算有限责任公司的规定,结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息,因此,基金合同终止时,基金可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项,基金托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至基金清算报告中指定的收款账户。基金合同终止后,中登根据结算规则,调整基金的结算备付以及交易保证金,基金管理人应配合基金托管人,向基金托管人及时划付调增款项,以便基金托管人履行交收职责。

—(5)、基金管理人签署本合同/协议,即视为同意基金管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时,基金托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结基金管理人证券账户内相应证券,无需基金管理人另行出具书面确认文件。

2、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+0 非担保结算要求的证券交易:

—(1)、对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种(如中小企业私募债、股票质押式回购、深圳公司债大宗交易、资产支持证券等,根据中登公司业务规则适时调整),基金管理人需在交易当日不晚于 14:00 向基金托管人发送交易应付资金划款指令(对于中登业务规则规定不是必须要勾单的,若基金管理人希望基金托管人进行勾单处理,则需在指令上备注需要托管行勾单),同时将相关交易证明文件传真至基金托管人,并与基金

	<p>托管人进行电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行。对于基金管理人在 14:00 后出具的划款指令，特别是需要基金托管人进行“勾单”确认的交易，基金托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。</p> <p>—(2)、基金管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知基金托管人。对于中国结算公司允许基金托管人指定不履约的交易品种，基金管理人应向基金托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，基金托管人有权在电话通知基金管理人后，先行完成取消交收操作，基金管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。</p> <p>—(3)、若基金管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或基金管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，基金托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半小时主动对该笔交易进行取消交收申报，所有损失由基金管理人承担。</p> <p>—(4)、对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第 2、3 项所述情形的，基金管理人知悉并同意基金托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，基金管理人承诺在日终前向基金托管人补出具资金划款指令。</p> <p>—(5)、发生以下因基金管理人原因所造成的情形，基金管理人应承担相应责任：—</p> <p>1) 基金管理人所托管的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由基金管理人承担交易失败的风险，基金托管人无义务为该产品垫付交收款项；—</p> <p>2) 因基金管理人未在合同约定的时间前向基金托管人提交有效划</p>	
--	--	--



	<p>款指令，导致基金托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由基金管理人自行承担交易失败的风险；—</p> <p>3)因基金管理人所托管的产品资金不足，且占用托管行最低备付金交收成功，造成托管行损失，则应承担赔偿责任，且基金托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向基金管理人追索利息的权利；—</p> <p>4)因基金管理人所托管的产品资金不足或基金管理人未在规定时间内向基金托管人提交划款指令，且有证据证明其直接造成基金托管人托管的其他产品交收失败和损失的，基金管理人应负赔偿责任。—</p> <p>—(6)、基金管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如基金托管人托管的其他产品资金不足或过错，进而导致基金管理人管理的产品交收失败的，则基金托管人将配合基金管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。—</p> <p>—(7)、对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务，基金管理人可根据需要在交易交收后且不晚于交收当日 14:00 向基金托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至基金托管人，并与基金托管人进行电话确认，以便基金托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。—</p> <p>3、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易</p> <p>基金管理人知悉并同意基金托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若基金管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许基金托管人对相关交易可以取消交收的，基金管理人应于交收日前一工作</p>	
--	--	--

	日向基金托管人出具书面的取消交收指令，并与基金托管人进行电话确认。	
--	-----------------------------------	--