

安信基金管理有限责任公司关于安信量化优选股票型发起式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，提升安信量化优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，安信基金管理有限责任公司（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《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与基金托管人中国工商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，由银行结算模式改为券商结算模式，并相应修改《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）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3月18日起，本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换后，本基金参与证券交易所交易的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并相应修改《托管协议》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	修订前表述	修订后表述
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 证券经营机构 的固有财产。
五、基金财	（四）基金证券账户与 证券交	（四）基金证券账户与 证券资金

<p>产保管</p>	<p>易资金账户的开设和管理</p> <p>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算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。</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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。</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>账户的开设和管理</p> <p>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算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。</p> <p>基金证券账户和证券资金账户的开立和使用，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同意擅自转让基金的任何证券账户和证券资金账户；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>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。基金管理人以本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。证券资金账户用于本基金证券交易的结算以及证券交易结算资金的记录，并与本基金银行存款账户之间建立银证转账对应关系。</p> <p>交易所证券交易资金采用第三</p>
------------	--	---

		<p><u>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立的证券资金账户中,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。</u></p>
六、指令的发送、确认和执行	<p>(三) 指令的发送、确认和执行的时间和程序</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应将同业市场国债交易通知单加盖印章后传真给基金托管人。</p>	<p>(三) 指令的发送、确认和执行的时间和程序</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应将同业市场国债交易通知单加盖印章后传真给基金托管人。</p>
六、指令的发送、确认和执行	<p>(七) 更换被授权人的程序</p> <p>基金管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限,必须提前至少一个交易日,使用传真或其他基金托管人和基金管理人书面确认过的方式向基金托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知,同时电话通知基金托管人。变更通知应载明生效时间,并提供新的被授权人的签字样本。基金托管人收到变更通知当日将回函书面传真基</p>	<p>(七) 更换被授权人的程序</p> <p>基金管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限,必须提前至少一个交易日,使用传真或其他基金托管人和基金管理人书面确认过的方式向基金托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知,同时电话通知基金托管人。变更通知应载明生效时间,并提供新的被授权人的签字样本。授权变更于变更通知载明的生效时间生效。.....</p>

	<p>金管理人或通过电话向基金管理人确认。授权变更于变更通知载明的生效时间生效。……</p>	
七、交易及清算交收安排	<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</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。选择的标准是： ……</p> <p>基金管理人负责根据以上标准以及内部管理制度对有关证券经营机构进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经营机构，并承担相应责任。基金管理人和被选择的证券经营机构签订席位使用协议，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。</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</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。证券经营机构选择的标准是： ……</p> <p>基金管理人负责根据以上标准以及内部管理制度对有关证券经营机构进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经营机构，并承担相应责任。基金管理人、基金托管人及证券经营机构签订本基金的证券经纪服务协议，就基金参与场内证券交易、结算等具体事项另行签订协议。……</p>
七、交易及清算交收安排	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、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</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>本基金的证券交易所证券交易资金结算模式为券商结算模式。</p> <p>证券经营机构负责根据中国证券登记结算有限责任公司的相关规则，作为结算参与人与中国证券登记结算有限责任公司办</p>

<p>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>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>如果因基金托管人原因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，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，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序</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</p>	<p>理本基金投资于证券交易所证券交易及非交易涉及的证券资金的清算交收。基金管理人应遵守有关登记结算机构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>基金管理人应采取合理、必要措施，确保有足够的资金头寸完成投资交易资金结算。本基金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通过登记结算机构办理。</p> <p>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所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证券交易所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>
--	--

程中出现超买或超卖现象，应立即提醒基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。如果因非因基金管理托管人或证券经营机构等原因发生超买行为，基金管理人必须于 T+1 日上午 10 时之前划拨资金，用以完成清算交收。

3、基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

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基金管理人发送的划款指令。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，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。

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

	<p>延或拒绝执行。如由于基金托管人的原因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> <p>(四) 申购、赎回、转换开放式基金的资金清算、数据传递及托管协议当事人的责任</p> <p>2、开放式基金的数据传递</p> <p>基金管理人应于每个开放日 14:00 之前将前一个开放日经确认的基金申购金额和赎回份额以书面形式并加盖业务专用章通知基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回数据的真实性、准确性和完整性负责。</p> <p>3、开放式基金的资金清算</p> <p>基金申购、赎回等款项采用轧差交收的结算方式，净额在最晚不迟于 T+3日 上午 11:00 前在基金管理人总清算账户和资产托管专户之间交收。</p> <p>... ..</p> <p>如果当日基金为净应付款，基金托管人应根据基金管理人的指令及时进行划付。对于未准时划付的资金，基金管理人应及时通知基金托管人划付，</p>	<p>(四) 申购、赎回、转换开放式基金的资金清算、数据传递及托管协议当事人的责任</p> <p>2、开放式基金的数据传递</p> <p>基金管理人应于每个开放日 14:00 之前将前一个开放日经确认的基金申购金额和赎回份额数据发送给基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回数据的真实性、准确性和完整性负责。</p> <p>3、开放式基金的资金清算</p> <p>基金申购、赎回等款项采用轧差交收的结算方式，净额在最晚不迟于交收日 17:00 前在基金管理人总清算账户和资产托管专户之间交收。</p> <p>... ..</p> <p>如果当日基金为净应付款，基金托管人应根据基金管理人的指令及时进行划付。对于未准时划付的资金，基金管理人应及时通知基金托管人划付，由此产生的责任应由基金托管人承担。后果严重的基金管理人应向中国证</p>
--	---	---

	由此产生的责任应由基金托管人承担。后果严重的基金管理人应向中国证监会报告。	监会报告。 <u>如遇异常情况由管理人与托管人协商处理。</u>
--	---------------------------------------	----------------------------------

三、重要提示

1、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，在《安信量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书》中，对相关内容进行相应修改，并将更新后的文件依照《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披露。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《基金合同》、《托管协议》、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

2、投资者可通过以下途径了解或咨询详情。

公司网址：www.essencefund.com

安信基金客户服务热线：4008-088-088（免长途固话费）

3、本公告的解释权归安信基金管理有限责任公司。

四、风险提示

本基金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，但不保证本基金一定盈利，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，投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

安信基金管理有限责任公司

2024年3月15日