

中海基金管理有限公司

关于中海能源策略混合型证券投资基金证券交易结算模式转换 有关事项的公告

公告送出日期：2024年3月30日

为更好地满足广大投资者的投资需求，提升中海能源策略混合型证券投资基金（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销售机构监督管理办法》等相关法律法规的规定及《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，中海基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）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券商结算模式，并相应修改《中海能源策略混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的相关内容，同时更新基金管理人、基金托管人基本信息，根据实际情况更新基金清算交收有关规则，现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自公告之日起，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。

本基金转换证券交易结算模式并相应修改托管协议的事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会，且符合相关法律法规及《基金合同》的约定。

二、《托管协议》的修订内容

章节	原条款 内容	修改后条款 内容
一、基金 托管协 议当事 人	(一) 基金管理人 住所：上海市浦东新区陆家嘴东路 166号中国保险大厦34楼（邮编 200120）	(一) 基金管理人 住所： <u>上海市浦东新区银城中路68 号2905-2908室及30层</u> 法定代表人： <u>曾杰</u>

	<p>法定代表人：华伟荣 注册资本：壹亿叁千万元人民币 联系人：夏立峰</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：姜建清 电话：(010)66106912 传真：(010)66106904 联系人：蒋松云 注册资本：贰仟捌佰陆拾伍亿零玖佰壹拾叁万零贰拾陆元人民币 经营范围：办理人民币存款、贷款、国内外结算、办理票据承兑、贴现、转贴现、国内会计业务、代理资金清算、提供信用证服务，代理销售业务，代理发行、代理承销、代理承兑债券，代收代付业务，代理证券资金清算业务，保险业代理业务，代理外国银行和国际金融机构贷款业务，证券投资基金、企业年金托管业务、企业年金账户管理服务、认购申购业务，咨询调查业务，贷款承诺、企业个人财务顾问服务、组织或参加银行贷款外汇存款，外汇贷款，外币兑换，出口托收及进口代收，外汇票据承兑和贴现，外汇借款、外汇担保、发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外汇有价证券。自营代外汇买卖，外汇金融衍生业务，银行卡业务，电话银行、网上银行，手机银行业务，办理结汇售汇业务，经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。</p>	<p>注册资本：<u>1.466667 亿元人民币</u> 联系人：<u>稽辰</u></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<u>陈四清</u> 电话：(010) <u>66105799</u> 传真：(010) <u>66105798</u> 联系人：<u>郭明</u> 注册资本：<u>人民币 35,640,625.71 万元</u> 经营范围：办理人民币存款、贷款、<u>同业拆借业务</u>；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、<u>各类汇兑业务</u>；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、<u>代理兑付政府债券</u>；代收代付业务；代理证券资金清算业务（<u>银证转账</u>）；<u>保险兼业代理业务</u>；代理<u>政策性银行</u>、外国政府和国际金融机构贷款业务；<u>保管箱服务</u>；<u>发行金融债券</u>；<u>买卖政府债券、金融债券</u>；证券投资基金、企业年金托管业务；<u>企业年金受托管理服务</u>；年金账户管理服务；<u>开放式基金的注册登记</u>、认购、申购和赎回业务；<u>资信调查、咨询、见证业务</u>；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加<u>银团贷款</u>；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、<u>代客</u>外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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</p>	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）《<u>公开募集</u>证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《<u>公开募集</u>证券投资基金销售<u>机构</u>监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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</p>

	<p>投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。</p> <p>本协议约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</p>	<p>办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督与核查</p>	<p>（一） 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>……</p> <p>本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p>	<p>（一） 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>……</p> <p>本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或国务院证券监督管理机构允许基金投资的其他金融工具。</p>
<p>五、基金财产的保管</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和证券账户。</p> <p>（四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理</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>（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、基金托管人和证券经纪机构的固有财产。</p> <p>3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。</p> <p>（四）基金证券账户与证券资金账户的开设和管理</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资金账户，用于证券清算。</p> <p>基金管理人以本基金的名义在证券经纪机构开立证券资金账户，用于本基金场内证券交易的结算、证券交易结算资金的存管和交易结算资金的变动明细的记录。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，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。本基金在证券经纪机构开立的证券资金账户、基金托管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</p>

		<p>当一一对应。基金管理人代表本基金与证券经纪机构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。</p>
	<p>(五) 债券托管账户的开立和管理 1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。</p>	<p>(五) 债券托管账户的开立和管理 1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管自营账户和资金结算专户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。</p>
	<p>(八) 与基金财产有关的重大合同的保管 基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。</p>	<p>(八) 与基金财产有关的重大合同的保管 基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门，保管期限不少于法律法规规定的最低年限。</p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>(二) 指令的内容 指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。</p>	<p>(二) 指令的内容 基金管理人运用基金财产时，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款，即银证互转。基金管理人通过基金托管人进行银证互转，由基金管理人向基金托管人发送指令，基金托管人操作。 指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的场外资金划拨及其他款项收付的指令。</p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(一) 选择代理证券买卖的证券经营机构的标准和程序 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</p>	<p>(一) 选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准和程序 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，并承担相应责任。基金管理人与基金托管人和被选</p>

<p>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>择的<u>证券经纪机构签订本基金的证券经纪服务协议,明确三方在本基金参与场内证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。</u></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《<u>证券交易资金结算协议</u>》,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。对基金管理人的资金划拨指令,基金托管人在复核无误后应在规定期限内执行并在执行完毕后回函确认,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《<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,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>(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><u>基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交割,由基金托管人负责根据相关登记结算机构的结算规则办理;基金投资于证券交易所所有场内交易的清算交割,由基金管理人负责委托代理证券买卖的证券经纪机构根据中国证券登记结算公司的结算规则办理。</u></p> <p><u>证券经纪机构负责本基金场内证券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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>场外交易资金对外投资划款由基金托管人凭基金管理人符合本托管协议约定的有效资金划拨指令进行资金划拨;场外投资本金及收益的划回,由基金管理人负责协调相关资金划拨回本基金托管户事宜。基金管理人应确保基金托管人在执行其发送指令时,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。基金管理人在发送指令时应充分考虑基金托管人执行指令所需的合理必要时间。如非因基金托管人原因无法按时划款,由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。</u></p> <p><u>本基金参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的,通过证券经纪机构代理进行交易,由证券经纪机构直接从资</u></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 时之前完成融资，用以完成清算交收。</p> <p>3、基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序</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，由此给基金造成的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>(三) 资金、证券账目及交易记录的核对</p> <p>对基金的交易记录，由基金管理人按日进行核对。每日对外披露基金份额</p>	<p><u>金账户中进行资金清算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。</u></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，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。<u>基金托管人采用固定比例最低备付金计收方式的，如果非因基金托管人原因发生超买行为，必须于 T+1 日上午 10 时之前划拨资金；基金托管人采用差异化比例最低备付金计收方式的，如果因非基金托管人原因发生超买行为，基金管理人必须于 T+1 日上午 8:30 之前划拨资金</u>，用以完成清算交收。</p> <p>3、基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序</p> <p>基金管理人应确保基金托管人、<u>证券经纪机构</u>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，由此给基金造成的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原因导致基金无法按时支付证券清算款，由此给基金及<u>基金管理人</u>造成的损失由基金托管人承担。</p> <p>(三) 资金、证券账目及交易记录的核对</p> <p>对基金的交易记录，由基金管理人与<u>基金托管人</u>按日进行核对，<u>同时与证</u></p>
--	---	--

	<p>净值之前,必须保证当天所有实际交易记录与基金会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致,造成基金会计核算不完整或不真实,由此导致的损失由基金的会计责任方承担。</p> <p>对基金的资金账目,由相关各方每日对账一次,确保相关各方账账相符。对基金证券账目,由每周最后一个交易日终了时相关各方进行对账。</p>	<p>券经纪机构进行交易记录的核对。每日对外披露基金份额净值之前,必须保证当天所有实际交易记录与基金会计账簿上的交易记录完全一致。如果由于券经纪机构提供的数据错误或者不完整致使实际交易记录与会计账簿记录不一致,造成基金会计核算不完整或不真实,由此导致的损失由券经纪机构承担。如果由于基金管理人自身原因致使实际交易记录与会计账簿记录不一致,造成基金会计核算不完整或不真实,由此导致的损失由基金管理人承担。</p> <p>对基金的资金账目,由相关各方每日对账一次,确保相关各方账账相符。对基金证券账目,基金管理人和基金托管人每交易日结束后核对基金证券账目,并每日与券经纪机构提供的对账单数据进行核对,确保账目相符。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(三) 估值差错处理</p> <p>由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p>(五) 基金定期报告的编制和复核</p> <p>基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。</p>	<p>(三) 估值差错处理</p> <p>由于证券交易所、登记结算公司及券经纪机构发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p> <p>(五) 基金招募说明书、定期报告的编制和复核</p> <p>在《基金合同》生效后,基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书、基金产品资料概要并登载在指定网站上;基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。</p>

三、其他需要提示的事项

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《中海能源策略混合型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，对基金管理人、基金托管人相关信息进行了更新，并根据实际情况更新了基金清算交收有关规则，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《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》、《中海能源策略混合型证券投资基金托管协议》、《中海能源策略混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

2、投资者可通过本公司客服电话 400-888-9788 或 021-38789788 咨询有关详情，也可登陆本公司网站（www.zhfund.com）获取相关信息。

风险提示：

本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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资有风险，敬请投资人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。

中海基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日