

鹏华基金管理有限公司关于鹏华品质优选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

为更好地满足投资者的需求，鹏华基金管理有限公司（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》等有关规定和《鹏华品质优选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定转换鹏华品质优选混合型证券投资基金（以下简称“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结算模式，并相应修改《鹏华品质优选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。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自2024年4月24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的转换并相应修改《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审议。

二、因转换证券交易结算模式，对《托管协议》的相关条款进行修改，修改前后对照表如下：

托管协议		
章节	原文条款 内容	修改后条款 内容
五、 基金 财产 保管	<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>（三）基金的银行账户的开立和管理</p> <p>基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。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资产托管专户进行。</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>（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>（三）基金的银行账户的开立和管理</p> <p>基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金除证券交易所场内交易以外的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。</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>基金管理人以本基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户，用于基金证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易资金清算，并与基金托管人开立的资产托管专户建立第三方存管关系。</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。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。</p>
<p>六、指令的发送、确认和执行</p>	<p>(二) 指令的内容</p> <p>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。基金管理人发送给基金托管人的纸质指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签字，对电子直连划款指令或者网银形式发送的指令应包括但不限于款项事由、支付时间、金额、账户等，基金托管人以收到电子指令为合规有效指令。</p>	<p>(二) 指令的内容</p> <p>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。对于场内业务，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，基金托管人执行操作。基金管理人发送给基金托管人的纸质指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签字，对电子直连划款指令或者网银形式发送的指令应包括但不限于款项事由、支付时间、金额、账户等，基金托管人以收到电子指令为合规有效指令。</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</p> <p>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。选择的标准是：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的证券经营机构，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。</p> <p>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</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/期货买卖的证券/期货经营机构。选择的标准是：基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经纪机构，并与基金托管人、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买卖中各类证券交易、证券交收及相关资金交收、交易数据传输及接收过程中的职责和义务。</p> <p>(二) 基金投资证券、期货后的清算交收安排</p> <p>1、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；本基金通过期货经纪机构进行的交易由期货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。基金管理人、基金托管人以及被</p>

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。

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。

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。

基金参与港股通交易的，基金管理人应保证在T+1日9:30之前在托管的托管专户或结算备付金账户上有足够的头寸用于港股通T+1日公司行动、证券组合费和风控资金的交收，在T+1日14:00之前在托管的托管专户或结算备付金账户上有足够的头寸用于港股通T+2日交易资金的交收。如由于基金管理人的原因导致港股通交收失败，由此给托管人、托管人托管的其他资产组合造成的经济损失，由基金管理人承担。

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，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。

2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序

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，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。如果非因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，并立即通知基金管理人。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

选择的证券经纪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。

2、本基金投资于所有场外交易的资金汇划，由基金托管人负责办理。

3、证券经纪机构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，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。

基金管理人负责选择代理本基金证券交易的证券公司（经纪商）。本基金证券交易数据传输及清算交收相关约定，基金管理人、基金托管人将与证券经纪商另行签署证券经纪服务协议。

	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。	
八、 基金 资产 净值 计算 和会 计核 算	由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司以及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或由于国家会计政策变更、市场规则变更等原因，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减轻或消除由此造成的影响。	由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司、 证券经纪机构 以及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或由于国家会计政策变更、市场规则变更等原因，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减轻或消除由此造成的影响。

三、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。本公司将根据相关法律法规，更新本基金的招募说明书并在规定媒介上公告。

投资者可访问鹏华基金管理有限公司网站（www.phfund.com.cn）或拨打全国免长途费的客户服务电话（400-6788-533）咨询相关情况。

本公告的解释权归本公司所有。

本公告仅对本基金证券交易结算模式转换的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）等信息披露文件。

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。基金的过往业绩并不代表其将来表现。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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，全面认识基金的风险收益特征，在了解基金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。

鹏华基金管理有限公司

2024年4月19日