

财通证券资产管理有限公司关于财通资管优选回报一年持有期 混合型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，提升财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，财通证券资产管理有限公司（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》的有关规定和《财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定转换本基金证券交易模式。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易模式转换

自2022年6月6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公司办理，由证券公司履行交易管理职责。

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，拟对《财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《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
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 法定代表人： 陶以平（代为履行法定代表人职权）	（二）基金托管人 法定代表人： <u>吕家进</u>
五、基金财产的保管	（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。 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、期货账户及投资所需的其	（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。 3. 基金托管人按照规定开设基金财产的 <u>托管</u> 资金账户、证券账户、期货账户及投资所需的其他

<p>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（以下或称“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>账户。基金管理人、基金托管人、证券经纪机构三方应签订证券经纪服务协议。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关证券资金账户。</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>（三）基金银行账户的开立和管理</p> <p>1. 基金托管人为本基金单独开立托管资金账户。托管资金账户的名称应当包含本基金名称，具体名称以实际开立为准。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款，均需通过该托管资金账户进行。</p>	<p>（三）基金银行账户的开立和管理</p> <p>1. 基金托管人为本基金单独开立托管资金账户。托管资金账户的名称应当包含本基金名称，具体名称以实际开立为准。本基金的除证券交易所场内交易以外的货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款，均需通过该托管资金账户进行。</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>4. 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、结算互保基金、交收价差资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>无</p>	<p>（七）证券资金账户的开立与管</p>

		<p>理</p> <p><u>基金管理人以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，用于基金财产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清算，并与基金托管人开立的托管资金账户建立第三方存管关系。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立证券资金账户，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><u>交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易的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选择的证券经纪机构负责。证券资金账户内的资金，只能通过证银转账方式将资金划转至基金托管资金账户，不得将资金划转至任何其他银行账户。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>六、指令的发送、确认及执行</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国证券登记结算有限责任公司或深、沪证券交易所的交易数据与中国证券登记结算公司进行交收。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</p>	

	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。	
七、交易及清算交收安排	<p>（一）选择证券/期货买卖的证券/期货经营机构</p> <p>（1）基金管理人应设计选择代理证券买卖的证券经营机构的标准和程序。</p> <p>（2）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。</p> <p>（3）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。</p> <p>（4）基金管理人应配合基金托管人在基金财产开始进行场内交易前办妥专用交易单元合并清算手续。</p>	<p><u>（一）选择代理证券、期货买卖的证券经纪机构、期货经纪机构</u></p> <p><u>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，由基金管理人与基金托管人及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。</u></p>
	<p>（二）基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>（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：</p> <p>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》。</p> <p>2、基金托管人遵照中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司备付金、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国证券登记结算有限责任公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低手基金托管人根据中国证券登记结算有限责任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</p>	<p><u>（二）基金投资证券后的清算交收安排</u></p> <p><u>基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交割，由基金托管人负责办理；基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交割，由基金管理人选择的证券经纪机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。本基金场内证券投资的具体操作按照基金管理人、基金托管人及证券经纪机构签署的《财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金证券经纪服务协议》的约定执行。</u></p> <p><u>基金托管人负责基金场外买卖证券的清算交收，场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的场外交易划款指令具体办理。</u></p>

<p>托管人根据中国证券登记结算有限责任公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。</p> <p>3、根据中国证券登记结算有限责任公司托管行集中清算规则，如委托财产T日进行了中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司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。</p> <p>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中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金、交易保证金以及中国证券登记结算有限责任公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，基金托管人将于中国证券登记结算有限责任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，中国证券登记结算有限责任公司根据结算规则，调增计划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。</p> <p>5、基金管理人签署本协议，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中国证券登记结算有限责任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</p>	
--	--

	<p>认文件。</p> <p>(2) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国证券登记结算有限责任公司T+0非担保结算要求的证券交易：</p> <p>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基金托管人勾单），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</p>	
--	---	--

<p>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内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) 因本基金资金不足导致交易交收失败，由基金管理人承担交易失败的风险，基金托管人无义务为本基金垫付交收款项；</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款指令，导致基金托管人无法及时完成支付结算操作而使交易交收失败的，由基金管理人自行承担交易失败的风险；</p> <p>3) 因本基金资金不足，且占用基金托管人最低备付金交收成功，造成基金托管人损失，则基金管理人应承担赔偿责任，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) 因本基金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</p>	
---	--

<p>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基金托管人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证券登记结算有限责任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，并且中国证券登记结算有限责任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。</p> <p>（4）基金管理人已充分了解基金托管人结算模式下可能存在的交收风险，基金管理人承</p>	
---	--

	诺若由于基金托管人托管的其他产品过错而导致本基金交易交收失败的，基金托管人不承担责任。	
--	--	--

三、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《财通资管优选回报一年持有期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《财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

公司网址：www.ctzg.com。

客户服务电话热线：95336。

五、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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本公司提醒投资者，投资者投资基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。基金的过往业绩不预示未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成基金业绩表现的保证。

本公告解释权归本公司所有。

特此公告。

财通证券资产管理有限公司

2022年6月2日