

大成基金管理有限公司关于大成核心趋势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，提升大成核心趋势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，大成基金管理有限公司（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》的有关规定和《大成核心趋势混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中信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 2021 年 9 月 10 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《大成核心趋势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
第五条 基金财 产保管	5.1 基金财产保管的原则 5.1.1 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。	5.1 基金财产保管的原则 5.1.1 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人 <u>和证券经纪机构</u> 的固有财产。
	5.4 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理 5.4.2 基金托管人以基金托管人的名义在中登公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用手证券清算。	5.4 基金证券账户与证券资金账户的开设和管理 5.4.2 <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> <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的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选择的证券公司负责。</u>
	5.4.3 基金证券账户与证券交易资金账	5.4.3 基金证券账户与证券资金账户的

	<p>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或证券交易资金账户；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>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或证券资金账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。<u>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。</u></p>
<p>第七条 交易及清算交收安排</p>	<p>7.1 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>7.1.1 基金管理人应制定选择代理证券买卖的证券经营机构的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，由基金管理人提前通知基金托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。交易单元保证金由被选中的证券经营机构支付。</p> <p>7.1.2 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以书面形式通知基金托管人。</p>	<p>7.1 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>7.1.1 <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，并与基金托管人、证券经营机构签订证券经纪服务协议，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。</u></p> <p>7.1.2 基金管理人应及时将<u>本基金财产</u>的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，<u>以便基金托管人估值核算使用。</u></p>
	<p>7.2 清算与交割</p> <p>7.2.1 基金投资证券后的清算交收安排基金管理人应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>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，不得无故延误。</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登公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。</p> <p>交易及清算交收安排中管理人应为托管人预留 2 个小时的指令处理时间，当日 15:00 之后收到的指令，托管人尽力负责但不承诺指令支付成功。如果因基金</p>	<p>7.2 清算与交割</p> <p>7.2.1 基金投资证券后的清算交收安排<u>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；本基金其它证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。</u></p> <p>7.2.2 <u>证券交易所证券资金结算基金托管人、基金管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则和规定自动成为本条款约定内容。</u></p> <p><u>基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定的结算业务规则 and 规定。</u></p> <p><u>证券经纪机构代理本基金与中登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；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</u></p>

<p>托管人过错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，基金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>7.2.2 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。</p> <p>7.2.3 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、本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过错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>承担。</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>
--	--

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《大成核心趋势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《大成核心趋势混合型证券投资基金基金合同》、《大成核心趋势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.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

五、本公告的解释权归大成基金管理有限公司。

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。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

大成基金管理有限公司

2021年9月8日