

长信基金管理有限责任公司关于 长信沪深300指数增强型证券投资基金 证券交易结算模式转换有关事项的公告

为更好的满足投资者的需求,提升长信沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)的市场竞争力,长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》的有关规定和《长信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》的约定,经与本基金的基金托管人招商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)协商一致,并报中国证监会备案,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,现将具体事宜公告如下:

一、证券交易结算模式转换

自2021年12月16日起,本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换后,本基金的证券交易所交易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《长信沪深300指数增强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	原条款	修订后条款
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。	(一)基金财产保管的原则 1.基金财产独立于基金管理人、基金托管人和证券经纪机构的固有财产。
	(二)基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理 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全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配合,结算备付金、结算保证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。	(二)基金证券账户、证券资金账户的开立和管理 4.基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券交易资金账户,用于基金财产证券交易资金的存管、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账户建立三方存管关系。 交易所证券交易资金采取第三方存管模式,即用于证券交易结算资金余额存放在基金管理人于基金开立的证券交易资金账户中,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,基金托管人不承担办理场所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。
六、指令的发送、确认及执行	基金管理人运用基金财产时,基金托管人发送资金划拨及其他款项指令,基金托管人执行基金管理人指令,办理基金名下的资金往来等有关事项。	基金管理人在运用基金财产时,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交易资金账户已建立的第三方存管体系在基金托管账户与证券交易资金账户之间划款,即银证互转;或由基金托管人根据基金管理人划款指令执行银证互转。 基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送场外交易资金划拨及其他款项指令,基金托管人执行基金管理人指令,办理基金名下的资金往来等有关事项。
	(三)指令的发送、确认及执行的时间和程序 1.指令的发送:…… 对于场内业务,首次进行场内交易基金管理人应与基金托管人确认已完成交易单元和股东代码设置后方可进行。	(三)指令的发送、确认及执行的时间和程序 1.指令的发送:…… 对于场内业务,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交易资金账户已建立的第三方存管体系在基金托管账户与证券交易资金账户之间划款,即银证互转。
七、交易及清算交收安排	(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构 1.基金管理人应选择代理证券买卖的证券经纪机构的名称和程序,并按照有关规定履行基金财产投资权利而应承担的义务,包括但不限于选择经纪商及投资标的等。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,使用其交易单元作为基金交易单元,基金管理人应提前通知基金托管人,并将交易单元租用协议及相关文件及时送达基金托管人,确保基金托管人申请接收清算数据。交易单元保证金由被选中的证券经纪机构交付,基金管理人应根据有关规定,在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经纪机构的有关情况、基金通过该证券经纪机构买卖证券的成交金额、回购成交量和支付的佣金等予以披露,并将该等情况及基金交易单元号、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。	(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构 1.基金管理人应制定选择的标准和程序,并负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经纪机构进行考察和评估,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、基金托管人和证券经纪机构就本基金参与证券交易的具体事项另行签订证券经纪服务协议,基金管理人应将该服务协议在法定信息披露报告中披露,佣金支付情况等有关内容。
	(二)基金投资证券后的清算交收安排 基金管理人、基金托管人在基金财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责按照附件《托管银行证券资金结算规定》要求执行。	(二)基金投资证券后的清算交收安排 本基金通过证券经纪机构进行的所有证券经纪机构作为清算参与人代理本基金进行清算,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清算参与人代理本基金进行清算,本基金通过证券交易资金托管人或相关机构负责清算。基金管理人、基金托管人以及被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,以具体明确三方在证券交易资金清算业务中的责任。 对于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延误。 本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金划划,由基金托管人负责办理。 证券经纪机构代理本基金财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金清算业务,并承担由证券经纪机构原因造成的正常清算、交收业务无法完成的责任。

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《长信沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)》中,对相关内容进行相应修改,并将更新后的文件在本公司网站上披露。本公告未尽事宜,敬请投资者参见《长信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、《长信沪深300指数增强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户服务中心或官方网站咨询有关详情。

联系机构:长信基金管理有限责任公司

联系电话:400-700-5566

电子信箱:service@xcfund.com.cn

网站:https://www.xcfund.com.cn

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。

长信基金管理有限责任公司

二〇二一年十二月十四日