

关于富国中证 A50 交易型开放式指数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，提升富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，富国基金管理有限公司（以下简称“我司”）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》等法律法规的有关规定和《富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，决定转换本基金的证券交易结算模式，由托管人交易结算模式改为证券经纪商交易结算模式，并相应修改《基金合同》、《富国中证 A50 交易型开放式指数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 3 月 8 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及《基金合同》、《托管协议》的相应修改将在基金开放申购、赎回及上市交易前完成，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、《基金合同》和《托管协议》的修订

因转换证券交易结算模式，本基金管理人拟对《基金合同》、《托管协议》相关内容进行修订，具体修订内容详见本公告附件一《富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订对照表》、附件二《富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议修订对照表》。

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《基金合同》、《托管协议》生效时间将另行公告，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》的有关规定在规定网站披露。

2、招募说明书涉及前述修订内容的，将一并修订更新，并依照《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上公告。

3、投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 95105686、400-888-0688（均免长途话费）咨询。

四、风险提示

我司承诺以诚实信用、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。

富国基金管理有限公司

2024年3月8日

附件一：《富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订对照表》

章节	修改前	修改后
<p>第九部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；<u>若本基金采用证券经纪商交易结算模式，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪商，并签订证券经纪服务协议；本基金管理人亦有权决定本基金证券交易模式的转换；</u></p>
<p>第十六部分 基金资产估值</p>	<p>九、特殊情形的处理</p> <p>2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记机构、指数编制机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，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、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>九、特殊情形的处理</p> <p>2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记机构、指数编制机构、<u>存款银行或证券经纪机构</u>等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，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、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>

附件二：《富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议修订对照表》

章节	修改前	修改后
<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>7. 基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交易的基金资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金资产造成的损失等不承担责任。</p> <p>(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>2. 基金证券账户的开立和使用，仅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或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>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。</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>7. 基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交易的基金资产（包括但不限于证券交易资金账户内的资金、证券类基金资产、期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金资产造成的损失等不承担责任。</p> <p>(四) 基金证券账户和证券交易资金账户的开立和管理</p> <p>2. 基金证券账户和证券交易资金账户的开立和使用，仅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或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>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账户建立第三方存管关系。</p> <p>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</p>

	<p>5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，按有关规定开立、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。</p>	<p><u>算。</u></p> <p><u>5. 基金管理人承诺证券交易资金账户为主资金账户，不开立任何辅助资金账户；不为证券交易资金账户另行开立银行托管账户以外的其他银行账户。</u></p> <p>6. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，按有关规定开立、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。</p>
六、指令的发送、确认及执行	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>对于场内业务，首次进行场内交易前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。</p>	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p><u>对于场内业务，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系统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。</u></p>
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构</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，并按照有关合同和规定行使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营机构，使用其交易单元作为基金的交易单元。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议（交易单元租用协议），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结算数据。基金管理人应根据</p>	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构</p> <p>1、<u>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后确定代理本基金证券买卖证券经纪机构，并承担相应责任。基金管理人和被选择的证券经纪机构签订证券经纪合同或其他约定的形式，由基金管理人通知基金托管人，并按法律法规要求在法定信息披露报告中披露有关内容。基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可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。</u></p>

	<p>有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、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。</p> <p>2、基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经营机构选择的规则执行。</p> <p>（二）基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>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》的要求执行。</p>	<p>2、基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、<u>证券经纪</u>机构选择的规则执行。</p> <p>（二）基金投资证券后的清算交收安排</p> <p><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。</u></p> <p><u>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延误。</u></p> <p><u>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。如因基金托管人的自身原因在清算上造成基金资产的损失，应由基金托管人负责赔偿基金的损失。</u></p> <p><u>证券经纪机构代理本基金财产与中国证券登</u></p>
--	---	--

		<p><u>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本基金正常结算、交收业务无法完成的责任。</u></p>
<p>附件：托管银行证券资金结算规定</p>	<p>资产托管人和资产管理人为确保证券交易资金结算业务安全、高效运行，有效防范结算风险，规范结算行为，进一步明确资产托管人与其代理结算客户在证券交易资金结算业务中的责任，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券登记结算管理办法》、《中国证券登记结算有限责任公司结算参与人管理规则》等有关法律法规、部门规章及相关业务规则，资产管理人和资产托管人就参与中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“结算公司”）多边净额结算业务相关事宜规定如下：—</p> <p>第一条 资产托管人系经中国证监会、中国银保监会及其他相关部门核准具备证券投资基金、保险资产、企业年金基金以及其他与结算公司结算业务相关的托管业务资格的商业银行；资产管理人系经中国证监会、中国银保监会批准设立的证券公司、基金管理公司、保险公司、保险资产管理公司等投资管理机构。—</p> <p>第二条 资产管理人管理并由资产托管人托管的资产在证券交易所市场达成的符合多边净额结算要求的证券交易，采取托管银行结算模式的（包括公募基金、专户账户、企业年金、社保基金等），应由资产托管人与结算公司办理证券资金结算业务；资产托管人负责参与结</p>	

	<p>算公司多边净额结算业务，资产管理人应当按照资产托管人提供的清算结果，按时履行交收义务，并承担对资产托管人的最终交收责任。</p> <p>第三条 资产托管人和资产管理人同意遵守结算公司制定的业务规则。</p> <p>第四条 多边净额结算方式下，证券和资金结算实行分级结算原则。资产托管人负责办理与结算公司之间证券和资金的一级清算交收，同时负责办理与资产管理人之间证券和资金的二级清算交收。</p> <p>第五条 资产托管人依据交易清算日（T日）清算结果，按照结算业务规则，与结算公司完成最终不可撤销的证券与资金交收处理；同时在规定时限内，与资产管理人完成不可撤销的证券、资金交收处理。</p> <p>第六条 资产管理人管理资产交收违约应遵循谁过错谁赔偿的原则。</p> <p>（一）因资产管理人头寸匡算错误等资产管理人原因导致的交收违约实际损失，由资产管理人承担。</p> <p>（二）因资产托管人操作失误等资产托管人原因导致的交收违约实际损失，由资产托管人承担。</p> <p>（三）由第三方过错导致的交收违约损失，按照最大程度保护资产管理人管理托管资产持有人合法权益的原则，由双方协商处理，并由双方共同承担向第三方追偿的责任。</p> <p>除依据相关法律法规和本规定约定外，资产托管人不得擅自用资产管理人管理托管资产</p>	
--	---	--

	<p>的证券和资金从事证券交易。资产托管人擅自动用资产管理人管理托管资产的证券和资金造成损失的，应当对资产管理人管理资产及资产管理人遭受的实际损失承担赔偿责任。资产托管人擅自动用资产管理人管理托管资产的证券和资金得到盈利的，所有因此而取得的收益归于托管资产，且资产管理人不承担任何相关费用。</p> <p>若资产管理人过错且利用自有资金或按照中国证监会规定使用风险准备金垫付资金交收透支，由此产生的收益归托管资产，由此产生的实际损失由资产管理人承担。</p> <p>第七条 资产托管人按照结算公司的规定，以资产托管人自身名义向结算公司申请开立相关结算备付金账户、证券交收账户以及按照结算公司相关业务规定应开立的其他结算账户，用于办理资产托管人所托管资产在证券交易所市场的证券交易及非交易涉及的资金和证券交收业务。</p> <p>第八条 根据结算公司业务规则，资产托管人依法向资产管理人管理资产收取存入结算公司的最低结算备付金、交收价差保证金及结算保证金等担保资金，该类资金的收取金额及其额度调整按照结算公司规则以及资产管理人和资产托管人的其他书面协议或约定执行。</p> <p>若资产管理人管理资产结算备付金账户日末余额低于其最低结算备付金限额的，资产管理人应于规定时间内补足款项。</p> <p>第九条 资产托管人收到结算公司按照与结</p>	
--	--	--

	<p>算银行商定利率计付的结算备付金(含最低备付金)、结算保证金等资金利息后,于收息当日向资产管理人管理资产支付。</p> <p>第十条 资产托管人于交易清算日(T日),根据结算公司按照证券交易成交结果计算的资 金清算数据和证券清算数据以及非交易清算数据,分别用以计算资产管理人管理资产资金和证券的应收或应付净额,形成资产管理人当日交易清算结果。资产托管人应及时、高效、安全地完成托管资产的证券交易资金清算交收,对于结算公司已退还各托管资产的交收资金应及时计入各托管资产的银行账户。</p> <p>第十一条 资产托管人完成托管资产清算后,对于交收日可能发生透支的情况,应及时与资产管理人沟通。</p> <p>资产托管人手交收日(T+1日)根据交易所或结算公司数据计算的资产管理人T日交易清算结果,完成资产管理人管理资产资金、证券的交收。</p> <p>第十二条 资产管理人对资产托管人提供的清算数据存有异议,应及时与资产托管人沟通,但资产管理人不得因此拒绝履行或延迟履行当日的交收义务。经双方核实,确属资产托管人清算差错的,资产托管人应予以更正并赔偿托管资产及资产管理人实际损失;若经核实,确属结算公司清算差错的,资产管理人应配合资产托管人与结算公司沟通。若因资产管理人在托管交易单元上进行非托管资产交易等事宜,致使资产托管人接收清算数据不完整</p>	
--	--	--

	<p>不正确，造成清算差错的，责任由资产管理人承担。</p> <p>第十三条 为确保资产托管人与结算公司的正常交收，不影响资产托管人所有托管资产的正常运作，正常情况下，交易日（T日）日终资产管理人应保证其管理的各托管资产资金账户有足够的资金可完成与结算公司于交收日（T+1日）的资金交收。</p> <p>第十四条 若资产管理人管理资产资金账户T日余额无法满足T+1日交收要求时，资产管理人应按照《托管协议》或操作备忘录中约定的时点补足金额，未有约定的，应于T+1日12:00前补足金额，确保资产托管人及时完成清算交收。对于创新产品，补足金额的时点可在托管协议或其他文件中约定。</p> <p>第十五条 资产管理人未按本规定第十四条约定时限补足透支金额，其行为构成资产管理人资金交收违约，资产托管人依法按以下方式处理，且资产管理人应予以配合：</p> <p>（一）资产管理人应在不晚于结算公司规定的时点前两个小时向资产托管人书面指定托管资产证券账户内相当于透支金额价值120%的证券（按照前一交易日的收盘价计算）作为交收履约担保物。资产管理人未能按时指定的，资产托管人依法自行确定相关证券作为交收履约担保物，并及时书面通知资产管理人。资产管理人未及时向资产托管人指定或指定错误的，相关责任由资产管理人承担。</p> <p>资产托管人可向结算公司申请，由结算公司协</p>	
--	--	--

	<p>助将相关交收履约担保物予以冻结，资产管理人应向资产托管人出具同意结算公司协助资产托管人冻结其证券账户内相应证券的书面文件（对于企业年金基金等涉及资产托管人、资产管理人及委托人或受托人的托管资产，资产管理人向资产托管人出具的书面文件应经资产管理人委托人或受托人确认。委托人或受托人与资产托管人、资产管理人签署的合同、操作备忘录等法律文件中有相关内容的，视为确认）。</p> <p>（二）资产管理人于 T+2 日在结算公司规定时间前补足相应资金的，资产托管人可向结算公司申请解除对相关证券的冻结；否则，资产管理人应配合资产托管人对冻结证券予以处置，如资产管理人不配合，资产托管人依法对冻结证券进行处置，但须及时书面通知资产管理人。</p> <p>（三）证券处置产生的资金，如相关交易尚未完成交收的，应首先用于完成交收，不足部分资产管理人及时补足。</p> <p>第十六条 资产管理人知晓并确认，资产管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，结算公司依法对质押券进行处置，但须及时书面通知资产管理人。资产管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及资产管理人委托人或受托人所应承担的委托债券投资风险，预先书面告知资产管</p>	
--	--	--

	<p>理人委托人或受托人，并由资产管理人委托人或受托人签字确认。委托人或受托人与资产托管人、资产管理人签署的合同、操作备忘录等法律文件中有相关内容的，视为确认。</p> <p>第十七条 由于资产管理人原因，其管理资产发生证券超额卖出或卖出回购质押债券而导致证券交收违约行为的，资产托管人暂不交付其相应的应收资金，并依法按照结算公司有关违约金的标准向资产管理人收取违约金。资产管理人须在两个交易日内补足相关证券及其权益。资产管理人未能补足的，资产托管人依法根据结算公司相关业务规则进行处理，由此产生的实际损失由资产管理人承担，收益归托管资产所有。</p> <p>第十八条 因资产管理人原因发生资金交收违约时，资产托管人依法采取以下风险管理措施，但须提前书面通知资产管理人：—</p> <ul style="list-style-type: none"> （一） 按照结算公司标准计收违约资金的利息和违约金；— （二） 按结算公司标准调高资产管理人管理资产的最低备付金或结算保证金比例；— （三） 报告监管部门及结算公司；— （四） 按照结算公司业务规则向结算公司申报暂停资产管理人的相关结算业务；— （五） 根据监管部门或结算公司要求采取的其他措施。 <p>第十九条 如因资产管理人原因造成资产托管人对结算公司出现违约情形时，结算公司实施相关风险管理措施引发的后果由资产管理</p>	
--	---	--

	<p>人自行承担，由此造成资产管理人管理资产及资产托管人实际损失，资产管理人应负责赔偿。</p> <p>如因资产托管人原因造成未及时将资产管理人应收资金支付给资产管理人或未及时委托证券登记结算机构将资产管理人应收证券划付到资产管理人证券账户的，资产托管人应当对资产管理人承担违约责任；如因资产托管人原因造成对结算公司交收违约的，相应后果由资产托管人承担。以上造成的托管资产及资产管理人的实际损失，资产托管人应负责赔偿。</p> <p>第二十条 本规定任何一方未能按本规定的约定履行各项义务均将被视为违约，除法律法规或结算公司业务规则另有规定，或本规定另有约定外，违约方应承担因其违约行为给对方和托管资产造成的实际损失。如双方均有违约情形，则根据实际情况由双方分别承担各自应负的违约责任。</p> <p>第二十一条 如果协议的一方或双方因不可抗力不能履行本规定时，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任。不可抗力是指资产托管人或资产管理人不能预见、不可避免、不能克服的客观情况。任何一方因不可抗力不能履行本规定时，应及时通知对方并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，并采取适当措施防止损失的扩大。</p> <p>第二十二条 本规定适用于现在及以后由资产管理人管理、资产托管人托管的所有业务品种。</p>	
--	--	--

	<p>第二十三条——本规定有效期间，若因法律法规、结算公司业务规则发生变化导致本规定的内容与届时有效的法律法规、业务规则的规定不一致的，应当以届时有效的法律法规、业务规则的规定和上述协议的约定为准，协议双方应根据最新的法律法规、业务规则和上述协议对本规定进行相应的修改和补充。</p>	
--	--	--