

# 关于富国中证红利低波动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，提升富国中证红利低波动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《富国中证红利低波动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，经与基金托管人中国光大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》、《富国中证红利低波动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5月8日（即本基金合同生效日次日）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。

本次转换证券交易结算模式并相应修改《基金合同》、《托管协议》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《富国中证红利低波动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《富国中证红利低波动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5月8日

附件一：《富国中证红利低波动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
第九部分 基金合同当事人及权利义务	<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、期货经纪机构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、期货经纪机构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>
第十六部分 基金资产估值	<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、存款银行<u>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：《富国中证红利低波动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>(四) 基金证券账户和<b>结算备付金</b>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><del>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<b>结算备付金</b>账户，并代表本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。最低备付金、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。</del></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<b>证券经纪机构</b>的固有财产；</p> <p>(四) 基金证券账户和<b>证券交易资金</b>账户的开立和管理</p> <p>2. 基金证券账户<b>和证券交易资金账户</b>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><u>4. 基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立<b>证券交易资金</b>账户，用于基金财产<b>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。</b></u></p> <p><u>本基金通过<b>证券经纪机构</b>进行的交易由<b>证券经纪机构</b>作为<b>结算参与人</b>代理本基金进行<b>结算。</b></u></p> <p><u>5. 基金管理人承诺<b>证券交易资金</b>账户为<b>主资金</b>账户，不开立任何<b>辅助资金</b>账户；不<b>为证券交易资金</b>账户另行开立<b>银行托管</b>账户以外的其他<b>银行</b>账户。</u></p>
<p>六、指令的发</p>		<p><u>基金管理人在运用基金财产时，开展场内<b>证券交易</b>前，基金管理人通过<b>基金托管</b>账</u></p>

送、确认及执行		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；或由基金托管人根据基金管理人的划款指令执行银证互转。
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券经营机构、期货经纪机构</p> <p><del>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。基金管理人负责选择证券经营机构，租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，并将被选中证券经营机构提供的《基金用户交易单位变更申请书》及时送达基金托管人，确保基金托管人申请接收结算数据。交易单元保证金由被选中的证券经营机构交付。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。</del></p> <p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</p> <p><del>根据《中国证券登记结算有限责任公司结算备付金管理办法》，在每月前6个工作日内，中国证券登记结算有限责任公司对结算参与人的最低结算备付金限额进行重新核</del></p>	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券经营机构、期货经纪机构</p> <p><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的证券经纪机构，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>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</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>算、调整。基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司调整最低结算备付金当日，在资金流量表中反映最低备付金调整的情况。基金管理人应预留最低备付金，并根据中国证券登记结算有限责任公司确定的实际下月最低备付金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。</p> <p>根据《中国证券登记结算有限责任公司证券结算保证金管理办法》，在每月前2个工作日内，中国证券登记结算有限责任公司对结算参与人的结算保证金进行调整，基金托管人在调整当日，在资金流量表中反映结算保证金的调整情况，基金管理人应预留足够头寸。</p> <p>基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。场内资金结算由基金托管人根据中国证券登记结算有限责任公司结算数据办理；场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的交易划款指令具体办理。</p> <p>如果因为基金托管人自身原因在清算上造成基金财产的损失，应由基金托管人负责赔偿；如果因为基金管理人未事先通知基金托管人增加交易单元等事宜，致使基金托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由基金管理人承担；如果因为基金管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成基金资产损失的由基金管理人承担；如果由于基金管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖等原因造成基金投资清算困难和风险的，</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>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。基金管理人应在 T+1 日中登公司规定的清算时间 11:00 之前将透支款及时划入该基金财产托管账户，并及时补足欠库券。在完成交割清算后，基金托管人根据基金管理人的指令，在不损害本基金财产利益的前提下将基金管理人垫支的透支款或欠库券取回并退回基金管理人，—由此给基金托管人、本基金造成的直接损失由基金管理人承担。—</p> <p>中国证券登记结算有限责任公司上海分公司目前实行 T+0 预交收制度，—因此基金管理人须于 T 日 15:30 之前备足当日上海市场交易担保交收需支付的资金头寸，—以便基金托管人履行 T+0 预交收职责；若有大宗交易，基金管理人还需于 T 日 15:30 之前通知基金托管人交易金额。若由于基金管理人的原因导致预交收失败，—由此引起的后果由基金管理人承担。基金管理人应采取合理措施，确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于 T+1 日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的资金结算。若由于基金管理人的原因导致托管人交收失败，—由此引起的后果由基金管理人承担。若结算机构的交收规则发生变化，基金托管人和基金管理人应根据新的交收规则作出相应变动，—基金管理人应配合基金托管人为完成交收提供必要的帮助。—</p> <p>非担保交收业务的交易告知。非担保交</p>	
--	--	--

	<p>收业务是指证券登记结算有限责任公司上海分公司组织交易双方根据业务规则规定或双方约定的结算模式完成交收，证券登记结算有限责任公司不作为双方的共同对手方，不提供交收担保。为确保非担保交收业务的正常交收，基金管理人应于交易当日及时将该交易书面告知基金托管人并进行电话确认。通过深圳综合协议平台达成的公司债转让交易告知时间为申报当日 15:30；其余产品非担保交易告知截止时点为交易当日 16:30。</p> <p>由于通过深圳综合协议平台的公司债，结算方式为逐笔全额非担保交收，最终交易确认时点为 T 日 15:50，因此基金管理人应于 T 日 15:00 分之前向基金托管人发送非担保交收债券的买入指令。</p> <p>基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时，基金托管专户或资金交收账户（除登记公司收保或冻结资金外）上有充足的资金。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，但应及时通知基金管理人。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时间（该必需的时间不长于正常情况下基金托管人日常处理该指令所用的平均时间）。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、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。</p>	
八、基	(二) 基金资产估值方法和特殊情形的	(二) 基金资产估值方法和特殊情形的



<p><b>金资产 净值计 算和会 计核算</b></p>	<p>处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>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>处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>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、存款银行 <b>或证券经纪机构</b>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>
---	--	--