

金鹰基金管理有限公司关于金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金 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，增强金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，金鹰基金管理有限公司（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《金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，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 2024 年 4 月 12 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结算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《金鹰周期优选灵活配置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，修订内容详见附件。

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《金鹰周期优选灵活配置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《金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《金鹰周期优选灵活配置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

本公司网站：www.gefund.com.cn

本公司客服电话：400-6135-888

五、本公告的解释权归金鹰基金管理有限公司。

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、招募说明书和基金产品资料概要等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司

2024年4月11日

金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议修改内容对照表

章节	原文内容	修订后内容
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 注册资本：人民币 349, 018, 545, 827 元	(二) 基金托管人 注册资本：人民币 <u>35, 640, 625. 7089</u> 万元
五、基金财产保管	(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、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、 <u>证券经纪机构</u> 的固有财产。
	(三) 基金的银行账户的开立和管理 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设资产托管银行账户，……	(三) 基金的银行账户的开立和管理 <u>基金管理人指定基金托管人为本基金的第三方存管银行，本基金第三方存管 账户即托管账户，基金管理人按照基金托管人要求提供开户所需资料。</u> 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设资产托管银行账户，……
	(四) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理 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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。 基金证券账户的开立和使用，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；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。	(四) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理 基金证券账户的开立和使用，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本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。 <u>证券账户开立后，基金管理人以本基金的名义在代理证券买卖的证券经纪机构处开立证券资金账户，用于本基金交易所场内证券交易的结算以及现金资产的记录。本基金参与交易所证券交易的交易结算资金应由第三方存管银行存管，本基金在证券经纪机构开立的证券资金账户、基金管理人以本基金名义在第三方存管银行开立的银行结算账户以及第三方存管银行为本基金建立的交易结算资金管理账户应当一一对应。基金管理人代表本基金与证券经纪机构和第三方存管银行签署第三方存管协议及相关协议。基金证券账户的开立和开户回执的保管由基金托管人负责，账户</u>

		<p><u>资产的管理和运用由基金管理人负责。</u></p> <p><u>本托管协议生效后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。</u></p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>(二) 指令的内容</p> <p>指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项<u>支付</u>的指令。基金管理人发送给基金托管人的纸质指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签字，对电子直连划款指令或者网银形式发送的指令应包括但不限于款项事由、支付时间、金额、账户等，基金托管人以收到电子指令为合规有效指令。</p>	<p>(二) 指令的内容</p> <p>指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的<u>场外</u>资金划拨、<u>银证互转</u>及其他款项<u>收付</u>的指令，<u>基金托管人执行基金管理人的指令、办理基金名下的资金往来等有关事项。基金管理人发送指令应采用电子指令或传真或双方共同确认的方式。</u>基金管理人发送给基金托管人的纸质指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签字，对电子直连划款指令或者网银形式发送的指令应包括但不限于款项事由、支付时间、金额、账户等，基金托管人以收到电子指令为合规有效指令。</p> <p><u>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资金账户之间划款，即银证互转。基金管理人通过基金托管人进行银证互转，由基金管理人向基金托管人发送指令，基金托管人操作。</u></p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(一) 选择代理证券买卖的证券经<u>营</u>机构及期货买卖的期货经<u>商</u>的标准和程序</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营机构、期货买卖的期货经纪商。选择的标准是：</u></p> <p><u>1、资历雄厚，信誉良好。</u></p> <p><u>2、财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。</u></p> <p><u>3、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作</u></p>	<p>(一) 选择代理证券买卖的证券经<u>纪</u>机构及期货买卖的期货经<u>纪</u>机构的标准和程序</p> <p><u>基金管理人应设计选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准和程序。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，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。</u></p> <p>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，……</p>

<p><u>高度保密的要求。</u></p> <p><u>4、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服。</u></p> <p><u>5、研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个券分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。</u></p> <p><u>基金管理人负责根据以上标准以及内部管理制度对有关证券经营机构、期货经纪商进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经营机构，并承担相应责任。基金管理人和被选择的证券经营机构签订交易单元使用协议，由基金管理人通知基金托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。</u></p> <p>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，……</p> <p><u>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及时以书面形式通知基金托管人。</u></p>	
<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p><u>1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任</u></p> <p><u>基金管理人与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《托管银行证券资金结算协议》，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。</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并在执行完毕后回函确认，不得延误。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>本基金证券投资的清算交割，由基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、其他相关登记结算机构及清算代理银行办理。</u></p> <p><u>如果因基金托管人原因在清算和交收中造成基金财产的损失，应由</u></p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p><u>本基金财产所有场内证券交易的清算交收由基金管理人选择的证券经纪机构作为结算参与人负责办理，由该证券经纪机构直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中国证券登记结算有限责任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>本基金财产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。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。</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正常结算、交收业务无法完成的责任。如</u></p>

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《托管银行证券资金结算协议》而造成基金投资清算困难和风险的，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，由此给基金或基金托管人造成的损失由基金管理人承担。

2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序

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，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。如果非因基金托管人原因发生超买行为，基金管理人必须于T+1日上午12时之前划拨资金，用以完成清算交收。

3、基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

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，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。

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》、基金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。

果因基金托管人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的原因造成正常结算业务无法完成，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，基金托管人应给予必要的配合，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。