

关于西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金 证券交易结算模式转换并修改托管协议的公告

公告送出日期：2024 年 4 月 25 日

为更好地满足投资者需求，提升西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》、《西部利得中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的有关规定，西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，并履行适当程序，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《托管协议》、更新部分条款。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自 2024 年 4 月 26 日起，本基金将启动证券交易结算模式的转换工作。转换完成后，本基金参与证券交易所交易结算将委托证券经纪商办理，由证券经纪商履行场内证券交易结算管理职责。

本次证券交易结算模式的转换以及对《托管协议》的修改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、《托管协议》的修订

因转换证券交易结算模式，本基金拟对《托管协议》相关条款进行修改，并根据事实性信息更新《托管协议》，具体修订内容如下：

章节	原条款 内容	修改后条款 内容
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.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、 <u>证券/期货经纪机构</u> 的固有财产。

	<p>(四) 基金证券账户和<u>结算备付金账户</u>的开立和管理</p> <p>...</p> <p>3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>4. 基金托管人以自身法人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>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, 按有关规定开设、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>(四) 基金证券账户和<u>证券资金账户</u>的开立和管理</p> <p>...</p> <p><u>3. 基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户。证券经纪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, 并按照该证券经纪机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</u></p> <p><u>4. 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资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中, 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。基金托管人不负责办理场内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。</u></p> <p><u>5. 基金托管人与基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开立和管理期货结算账户。</u></p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送资金划拨及其他款项付款指令, 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。</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>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送<u>场外</u>资金划拨及其他款项付款指令, 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。</p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(一) 选择证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>基金管理人应<u>设计</u>选择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, <u>租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交易单元租用协议, 基金管理人应提前通知基金托管人。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, 并将上述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。因相关法律法规或交易规则的修改带来的变化以届时有效的法律法规和相关交易规则为准。</u></p>	<p>(一) 选择证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>基金管理人应<u>制定</u>选择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, <u>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, 就基金参与场内证券交易、结算等具体事项进行约定。</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>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》、《证券结算保证金管理办法》，在每月第二个工作日内，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或结算保证金和证券结算保证金进行重新核算、调整，管理人应提前一个交易日匡算最低备付金和证券结算保证金调整金额，留出足够资金头寸，以保证正常交收。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和证券结算保证金当日，在资金调节表中反映调整后的最低备付金和证券结算保证金。管理人应预留最低备付金和证券结算保证金，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和证券结算保证金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。</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，基金托管人发现后应立即通知基金管理人，由基金管理人负责处理，由此给基金托管人、本基金和基金托管人托管的其他资产造成的直接损失由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人应采取合理、必要措施，确保 T 日日终有足够的资金头寸完成 T+1 日的投资交易资金结算；如因基金管理人原因导致资金头寸不足，基金管理人应在 T+1 日上午 10:00 前补足透支款项，确保资金清算。如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响基金资产的清算交收及基金托管人与中国证券登记结算有限公司之间的一级清算，由此给基金托管人、基金资产及基金托管人托管的其他资产造成的直接损失由基金管理人负责。</p> <p>2. 交易记录、资金和证券账目核对的时间</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>基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交割，由基金托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理；基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交割，由基金管理人负责委托代理证券买卖的证券经纪机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。</u></p> <p><u>基金托管人负责基金场外买卖证券的清算交收，场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的场外交易划款指令具体办理。</u></p> <p>2. 交易记录、资金和证券账目核对的时间</p>
---	--

<p>和方式</p> <p>(1) 交易记录的核对</p> <p>基金管理人和基金托管人按日进行交易记录的核对。按规定对外披露净值之前, 必须保证当天所有实际交易记录与基金会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致, 造成基金会计核算不完整或不真实, 由此给基金造成的损失由基金管理人承担。</p>	<p>和方式</p> <p>(1) 交易记录的核对</p> <p>基金管理人和基金托管人按日进行交易记录的核对。对外披露净值之前, 必须保证当天所有实际交易记录与基金会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致, 造成基金会计核算不完整或不真实, 由此导致的损失由责任方承担。</p>
<p>(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定</p> <p>...</p> <p>8. 赎回和分红资金划拨规定</p> <p>拨付赎回款或进行基金分红时, 如基金资金账户有足够的资金, 基金托管人应按时拨付; 因基金资金账户没有足够的资金, 导致基金托管人不能按时拨付, 如仅系基金管理人的原因造成, 相应责任由基金管理人承担, 基金托管人不承担垫款义务,但应及时通知基金管理人。</p>	<p>(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定</p> <p>...</p> <p>8. 赎回和分红资金划拨规定</p> <p>拨付赎回款或进行基金分红时, 如基金资金账户有足够的资金, 基金托管人应按时拨付; 因基金资金账户没有足够的资金, 导致基金托管人不能按时拨付, 如系基金管理人的过错原因造成, 责任及相应后果均由基金管理人在其过错范围内承担, 基金托管人不承担垫款义务。</p>
<p>(四) 申赎净额结算</p> <p>...</p> <p>如果当日基金为净应收款, 基金托管人应及时查收资金是否到账, 对于因基金管理人的原因未准时到账的资金, 应及时通知基金管理人划付, 由此产生的责任应由基金管理人承担。</p>	<p>(四) 申赎净额结算</p> <p>...</p> <p>如果当日基金为净应收款, 基金托管人应及时查收资金是否到账, 对于因基金管理人的过错原因未准时到账的资金, 应及时通知基金管理人划付, 由此产生的责任应由基金管理人在其过错范围内承担, 基金托管人不承担责任。</p>

三、重要提示

- 1、本基金证券交易结算模式转换完成时间及修改后的《托管协议》生效时间将另行公告。
- 2、基金管理人已就本次转换证券交易结算模式并修改《托管协议》事宜履行了规定程序, 符合法律法规、监管机构和《基金合同》的规定。
- 3、基金管理人将对本基金招募说明书进行更新。投资人欲了解基金信息请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及相关法律文件。
- 4、投资者如对上述事项有任何疑问, 可以通过本基金管理人的网站(www.westleadfund.com)或全国统一客服热线(400-700-7818)了解详情。

风险提示:

本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财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险, 敬请投资人认真阅

读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

西部利得基金管理有限公司

2024 年 4 月 25 日