

# 华宝基金管理有限公司关于华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金证券交易模式转换有关事项的公告

为了更好地为投资者提供服务，华宝基金管理有限公司（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》的有关规定与《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，经与基金托管人华泰证券股份有限公司协商一致，并履行适当程序，决定转换华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）证券交易模式。现将相关事宜公告如下：

## 一、证券交易模式转换

自 2024 年 4 月 18 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《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》（以下简称“托管协议”）的相关条款进行修订，具体修订内容请见本公告附件。

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，对《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》进行相应修订，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《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》、《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新等相关文件。

## 四、投资者可通过以下途径咨询有关详情

华宝基金管理有限公司客户服务电话：4007005588、4008205050

华宝基金管理有限公司网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)

风险提示：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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金过往业绩及其净值高低并不预示本基金未来业绩表现。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。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、临时公告等资料，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2024年4月18日

附件：《华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》修改如下：

原托管协议涉及修改章节	原托管协议表述	修订后表述
五、基金财产保管	<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>(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<u>和证券经纪机构</u>的固有财产。</p>
	<p>(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开设和管理</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、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，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。</p>	<p>(四) 基金证券账户<u>和证券交易资金账户</u>的开设和管理</p> <p>4、<u>基金管理人在所选择的证券公司下属营业机构以基金名义开立资金账户，并应及时将资金账户的相关信息以双方认可的方式及时通知基金托管人。基金管理人、证券经纪商应协助基金托管人将该账户与基金资金账户建立第三方存管关系，如因基金管理人、证券经纪商原因致使对应关系无法建立，基金托管人不承担任何责任。</u></p> <p>5、<u>交易所场内证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易资金全额存放在基金管理人为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</u></p>

		<p><u>管证券投资基金账户内存放的资金。</u></p> <p>6、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，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。</p>
	<p><del>（八）基金财产投资的有关有价凭证的保管</del></p> <p>实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于其档案库或保险柜。保管凭证由基金托管人持有，基金托管人承担保管职责。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任</p>	<p><u>（八）非现金类财产的保管</u></p> <p><u>1、证券类资产及证券交易资金的保管</u></p> <p><u>本基金投资形成的证券类资产，由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行第三方保管；证券交易结算资金由相关证券经纪商和存管银行保管。对于在未经基金托管人同意的情况下基金管理人自行变更证券经纪商或存管银行造成的损失，及因证券经纪商原因导致证券交易结算资金无法正常转账支取造成的损失，基金托管人不承担责任。</u></p> <p><u>2、基金财产投资的有关有价凭证等的保管</u></p> <p><u>基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。基</u></p>

		<p><u>基金管理人</u>对基金财产权利行使依据的任何形式的变更，都必须提前或在变更当日通知基金托管人，并在变更后5个工作日内提交给基金托管人。</p>
<p>六、 指令的发送、确认及执行</p>		<p><u>基金管理人</u>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。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。</p> <p><u>基金管理人</u>在运用基金财产时向基金托管人发送场外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）基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券经营机构、期货经纪机构。</p> <p>1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：</p> <p>（1）资金雄厚，信誉良好。</p> <p>（2）财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。</p> <p>（3）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。</p> <p>（4）具备基金运作所需的高效、安全</p>	<p>（一）基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券<u>经纪</u>机构、期货经纪机构。</p> <p>1、选择代理证券买卖的证券<u>经纪</u>机构的标准：</p> <p>（1）资金雄厚，信誉良好。</p> <p>（2）财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。</p> <p>（3）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。</p> <p>（4）具备基金运作所需的高效、安全</p>

<p>的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。</p> <p>(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、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、证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。</p> <p>2、选择代理证券买卖的<u>证券经营机构</u>的程序</p> <p>基金管理人根据以上标准进行考察后确定<u>证券经营机构</u>。基金管理人与被选择的<u>证券经纪商</u>签订委托协议(或交易单元租用协议)，并按照法律法规的规定向中国证监会报告。基金管理人应将委托协议(或交易单元租用协议)的原件或扫描件及时送交基金托管人。</p> <p>3、<u>相关信息的通知</u></p> <p>基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人基金专用交易单元的号码、券商名称、佣金费率等基金基本信息以及变更情况，其中交易单元的租用应至少在首次进行交易的10个工作日前通知基金托管人，交易单元的退租应在次日内通知到基金托管人。</p> <p>4、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，并与期货经纪机构、托管人共同签订期货经纪合同，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>证券经纪机</u></p>	<p>的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。</p> <p>(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、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、证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。</p> <p>2、选择代理证券买卖的<u>证券经纪机构</u>的程序</p> <p><u>基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪机构，并与其签订证券经纪相关协议，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构应就本基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>3、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，并与期货经纪机构、托管人共同签订期货经纪合同，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>证券经纪机</u></p>
--	--

构选择的规则执行。

## （二）基金的清算交收安排

1、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3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、结算保证金限额进行重新核算、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、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结算保证金。基金管理人应预留最低备付金和结算保证金，并根据中国证券登记结算有限责任公司确定的实际最低备付金、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。

2、基金托管人负责基金场内交易等的清算交收。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。基金托管人、基金管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

3、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

## （二）基金的清算交收安排

### 1、清算与交割

基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交收，由基金托管人根据相关登记结算公司的结算规则负责办理；基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交收，由基金管理人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负责办理。

基金管理人应在本基金正式投资运作之前为本基金指定证券经纪商和专用交易席位，本基金进行场内证券投资所涉及的证券经纪商交易席位号、交易品种的费率表、证券经纪商佣金收取标准等事项在本基金的经纪操作协议中进行约定。

本基金通过指定证券经纪商进行场内交易时有关交易数据传输与接收、场内证券交易的资金清算与交割等事项在本基金的经纪操作协议中进行约定。

### 2、资金结算的注意事项

基金托管人负责基金场外买卖证券的清算交收，场外资金划拨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。

场内转账类指令由基金托管人根据基金管理人有效的划款指令执行。

对于因本基金投资产生的应收资产，基金管理人应采取措施向有关当事人进行催收，在此过程中给本基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有

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、超卖及质押券欠库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，由基金管理人负责解决，基金托管人应给予必要的配合，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。—

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责任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。基金管理人应知晓并同意下列事项：—

—(1) 基金托管人有权向登记公司申报冻结其证券账户内与违约资金等额的证券，申报冻结证券的证券品种、数量可由基金托管人确定。登记公司根据基金托管人申报的证券品种、数量办理相应冻结。基金管理人在规定时间内补足违约交收资金的，基金托管人向登记公司申报解除证券冻结。—

—(2) 如因基金管理人原因造成债券质押式回购交收违约，但托管人未对登记公司交收违约的情况下，基金托管

关当事人追偿本基金财产的损失。

证券经纪机构代理本基金财产与证券登记结算机构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；若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由基金管理人承担。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，应由基金托管人负责赔偿基金的损失。

(三) 资金、证券账目和交易记录  
核对

人有权向登记公司申报将基金管理人的回购质押券划转至基金托管人的证券处置账户，申报划转的质押券品种、数量可由基金托管人确定。登记公司根据基金托管人的申报办理相关质押券的划转。基金管理人在规定时间内补足违约交收资金的，基金托管人向登记公司申报将基金托管人证券处置账户内的相关证券划回至基金管理人的证券账户。

~~（3）基金管理人资金不能足额完成非担保交收业务品种资金交收的，按照登记公司相关规定执行。~~

~~（4）基金托管人有权以基金管理人的违约交收资金为基数，按照有关规定计收违约金。~~

4、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，基金银行账户或资金交收账户上有充足的资金。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，由此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。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。对于要求当天到账的指令，应在当天16:00前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前1个工作日（工作时间：9:00-17:00）发送，且相关付款条件已经具备。

5、对于在上海证券交易所固定收益平台和在深圳证券交易所综合协议交易平台交易的、实行“实时逐笔全额结算”和“T+0逐笔全额非担保交收”的业务，基金管理人应在交易日14:00

前将划款指令发送至基金托管人。

6、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》、本协议的指令不得以不合理拖延或拒绝执行。如由于基金托管人的过错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。

### （三）交易资金最高额度

1、根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》（以下简称“《业务规则》”）的规定，基金管理人应当依据在基金托管人处托管的产品合计资产总额以双方认可的方式向基金托管人提供资金前端控制最高额度（以下简称“最高额度”）相关信息，基金管理人应确保提供的最高额度相关信息完整、真实有效且符合相关规定。因基金管理人未及时向基金托管人提供最高额度信息或所提交最高额度信息有误或不完整而导致最高额度申报失败，由此造成的责任及损失由基金管理人承担。

2、基金托管人应对基金管理人申报信息的真实、完整性进行事后稽核。基金托管人发现基金管理人提供的最高额度相关信息违反法律法规规定或相关业务规定时，不予申报，并应及时以双方认可的形式通知基金管理人纠正。在正常业务受理渠道和申报规定的时间内，因基金托管人原因未能及时提交或正确申报基金管理人提交的符合

~~业务规定且真实有效的信息导致对基金管理人最高额度控制造成影响的，基金托管人应承担相应的责任，因不可抗力、意外事件等非基金托管人原因造成的情形，基金托管人不承担责任。~~

~~3、基金管理人应根据业务实际情况和自身风控需要向沪、深交易所申报自设额度。基金管理人应定期对自设额度进行评估、优化并对全天净买入申报金额及额度使用情况进行监测，出现接近最高或自设额度情形的，应当及时进行核查，采取相关措施保障后续交易的正常进行。因基金管理人自设额度与最高额度产生冲突而造成的损失，基金托管人不承担相应责任。~~

~~4、基金管理人向基金托管人提供最高额度相关信息或盘中紧急申报信息时，应确保托管人有足够的处理时间（至少为2个工作小时）。在每个交易日13:00（盘中紧急申报为10:00）以后收到的最高额度相关信息或盘中紧急申报信息，基金托管人不保证当日完成申报流程。基金管理人因最高额度信息有误或发生重大变化需进行盘中紧急申报时，需按照中国结算相关规定提交相应材料，并在事后联合基金托管人（如需要）向沪、深交易所提交书面说明。~~

~~5、基金管理人、基金托管人应建立健全资金前端控制内部控制制度和应急预案，制定完备的资金前端控制业务流程，定期对资金前端控制相关工作进行合规审查；因任何一方未按照《业~~

	<p>务规则》规定而导致的后果，由该方承担。</p> <p>6、基金管理人根据《业务规则》及本协议应承担的义务及责任不因授权他人代为办理而免除。</p> <p>—(四)资金、证券账目和交易记录核对</p>	
--	--	--