

# 博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金证 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，提升博时量化多策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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《博时量化多策略股票型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，并履行适当程序后，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《博时量化多策略股票型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2月29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、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《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《〈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《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、投资者可通过以下途径了解或咨询详情。

公司网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)

博时基金客户服务热线：95105568

4、本公告的解释权归博时基金管理有限公司。

#### 四、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。

博时基金管理有限公司

2024年2月27日

附件：《托管协议》修订对照表

章节	原托管协议内容	修订后托管协议内容
<p>五、基金财产的保管</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</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收的基金资产（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>8. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</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收的基金资产（包括但不限于<u>证券交易资金账户内的资金、证券类基金资产、</u>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>8. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。</p>
	<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>4. <u>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。</u></p> <p>.....</p>	<p>(四) 基金证券账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>4. <u>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。</u></p> <p><u>基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户、证券交易资金账户，亦不得使用证券账户或证券交易资金账户进行本基金业务以外的活动。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。</u></p> <p>5. <u>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>.....</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>.....</p>	<p>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送<b>场外</b>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>.....</p>
	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1. 指令的发送：基金管理人应按照相关法律法规以及本协议的规定，在其合法的经营权限和交易权限内依照授权通知的授权用传真方式或其他基金托管人和基金管理人认可的方式向基金托管人发送。基金管理人在发送指令时，应确保相关出款账户有足够的资金余额，并为基金托管人留出执行指令所必需的时间。</p> <p>对于新股、新债申购等网下公开发行业务，基金管理人应于网下申购缴款日的 10:00 前将指令发送给基金托管人。</p> <p>对于期货出入金业务，基金管理人应于交易日期货出入金截止时间前 2 小时将期货出入金指令发送至基金托管人。</p> <p><del>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。</del></p> <p>对于银行间业务，基金管理人应于交易日 15:00 前将银行间成交单及相关划款指令发送至基金托管人。基金管理人应与基金托管人确认基金托管人已完成证书和权限设置后方可进行基金财产的银行间交易。</p> <p>对上海证券交易所认购权证行权交易，基金管理人应于行权日 15:00 前将需要交付的行权金额及费用书面通知基金托管人，基金托管人在 16:00 前支付至中国证券登记结算有限责任公司指定账户。</p> <p>对于指定时间出款的交易指令，基金管理人应提前 2 小时将指令发送至基金托管人；对于基金管理人于 15:00 以后发送至基金托管人的指令，基金托管人不保证当日出款。</p>	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1. 指令的发送：基金管理人应按照相关法律法规以及本协议的规定，在其合法的经营权限和交易权限内依照授权通知的授权用传真方式或其他基金托管人和基金管理人认可的方式向基金托管人发送。基金管理人在发送指令时，应确保相关出款账户有足够的资金余额，并为基金托管人留出执行指令所必需的时间。</p> <p>对于新股、新债申购等网下公开发行业务，基金管理人应于网下申购缴款日的 10:00 前将指令发送给基金托管人。</p> <p>对于期货出入金业务，基金管理人应于交易日期货出入金截止时间前 2 小时将期货出入金指令发送至基金托管人。</p> <p><u>对于场内业务，基金管理人在运用基金财产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户与证券资金账户之间划款，即银证互转。</u></p> <p>对于银行间业务，基金管理人应于交易日 15:00 前将银行间成交单及相关划款指令发送至基金托管人。基金管理人应与基金托管人确认基金托管人已完成证书和权限设置后方可进行基金财产的银行间交易。</p> <p>对上海证券交易所认购权证行权交易，基金管理人应于行权日 15:00 前将需要交付的行权金额及费用书面通知基金托管人，基金托管人在 16:00 前支付至中国证券登记结算有限责任公司指定账户。</p> <p>对于指定时间出款的交易指令，基金管理人应提前 2 小时将指令发送至基金托管人；对于基金管理人于 15:00 以后发送至基金托管人的指令，基金托管人不保证当日出款。</p>
<p>七、交易</p>	<p>(一) 选择代理买卖证券、期货的证券、期货经营机构</p> <p><u>1、基金管理人应设计选择代理证券买卖的</u></p>	<p>(一) 选择代理买卖证券、期货的证券、期货经纪机构</p> <p><u>1、基金管理人应制定选择的标准和程序，</u></p>

<p>及清算 交收安 排</p>	<p>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，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。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。</p>	<p>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，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。</p>
	<p>（二）基金投资证券后的清算交收安排 基金管理人和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《托管银行资金结算规定》的要求执行。</p>	<p>（二）基金投资证券后的清算交收安排 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。 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。 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。 证券经纪机构代理本基金财产与中登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。</p>
	<p>（四）资金净额结算 基金资金账户与“基金清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日（T日：资金交收日，下同）按照</p>	<p>（四）资金净额结算 基金资金账户与“基金清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照资金账户应收资金（<u>申购申</u></p>

	<p>资金账户应收资金(T-1日直销申购申请金额与T-2日代销申购申请金额与T-3日基金转换转入申请金额之和)与应付资金(T-3日赎回金额与T-3日基金转换转出金额之和)差额来确定资金账户净应收额或净应付额,以此确定资金交收额,基金托管人应当为基金管理人提供适当方式,便于基金管理人进行查询和账务管理。当存在资金账户净应收额时,基金管理人应在交收日 15:00 时之前从基金清算账户划往基金资金账户,基金管理人通过基金托管人提供的方式查询结果;当存在资金账户净应付额时,基金托管人按照基金管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日及时划往基金清算账户,基金管理人通过基金托管人提供的方式查询结果。</p>	<p><u>请对应申购净额与基金转换转入申请对应净额之和)与应付资金(赎回申请对应赎回金额扣除归基金资产的费用与基金转换转出申请对应金额扣除归基金资产的费用之和)</u>差额来确定资金账户净应收额或净应付额,以此确定资金交收额,基金托管人应当为基金管理人提供适当方式,便于基金管理人进行查询和账务管理。当存在资金账户净应收额时,基金管理人应在交收日 15:00 时之前从基金清算账户划往基金资金账户,基金管理人通过基金托管人提供的方式查询结果;当存在资金账户净应付额时,基金托管人按照基金管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日及时划往基金清算账户,基金管理人通过基金托管人提供的方式查询结果。</p>
二十、其他事项	本协议附件构成本协议不可分割的组成部分。	(删除)
附件	托管银行证券资金结算规定	(删除)