

关于鹏扬元合量化大盘优选股票型 证券投资基金转换证券交易结算模式 有关事项的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求,提升鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(以下简称本基金)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》的有关规定和《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)的约定,经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,鹏扬基金管理有限公司(以下简称本公司)决定转换本基金的证券交易结算模式,并相应修订《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金托管协议》(以下简称《托管协议》)及《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金招募说明书》(以下简称《招募说明书》)。现将相关事项公告如下:

一、证券交易结算模式转换

自2024年4月11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经纪机构办理,由证券经纪机构履行场内证券交易结算管理职责。

本公司将视证券交易结算模式转换情况,就证券交易结算模式转换完成并生效的时间另行公告,敬请投资者关注本公司届时发布的相关公告。

二、《托管协议》等法律文件修订

本公司根据上述事项、本基金实际运作情况对本基金的《托管协议》进行了必要的修订,具体修订内容请详见本公告附件;同时,本公司将按规定更新《招募说明书》,并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定进行披露。

本次转换证券交易结算模式对基金份额持有人利益无实质性不利影响,不需召开基金份额持有人大会,可由基金管理人和基金托管人协商后修改。

三、其他事项

本基金的托管协议、招募说明书修订的内容和程序符合有关法律法规和《基金合同》的规定。本次修订后的《托管协议》、《招募说明书(更新)》将按规定在本公司网站(www.pyamc.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)公告。投资者办理基金交易等相关业务前,应仔细阅读基金的《基金合同》、《招募说明书(更新)》、《基金产品资料概要(更新)》、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件。

投资者可以通过本基金管理人的网站(www.pyamc.com)或客户服务热线(400-968-6688)咨询相关情况。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者投资本公司管理的基金时,应认真阅读基金合同、招募说明书(更新)、产品资料概要(更新)等法律文件,全面了解基金的风险收益特征和产品特性,在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上,充分考虑自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,理性判断市场,谨慎做出投资决策。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。请投资者严格遵守反洗钱相关法律法规的规定,切实履行反洗钱义务。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司

2024年4月10日

附件:《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金托管协议修改前后对照表》

章节	修改前	修改后
	内容	内容
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>.....</p> <p>3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、债券托管账户和期货账户等投资所需账户。基金管理人、基金托管人、证券经纪商三方应签订三方存管协议。证券经纪商根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关证券资金账户。</p> <p>(四)基金证券账户与证券资金账户的开设和管理</p> <p>1.基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。</p> <p>2.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。</p> <p>3.基金管理人以本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,并按照该营业网点开户的流程和要求,签订相关的协议。证券资金账户与基金托管账户建立第三方存管关系。</p> <p>4.基金管理人根据相关法律法规及协议约定在选定的证券经纪商处为本基金开立证券资金账户,用于办理本基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算资金和交易保证金的收取按照代理证券买卖的证券经纪机构的约定执行。</p> <p>(六)存款投资账户的开立和管理</p> <p>基金财产开展定期存款等银行存款投资前,基金管理人应以基金名义开立银行账户,该账户仅用于托管账户划转存款本息及利息收入,开户时基金管理人须向存款银行预留基金托管人印鉴,如基金托管人需变更预留印鉴,基金管理人应通知并配合存款银行办理变更手续。</p> <p>基金管理人应严格按照双方约定,事先向基金托管人提供办理开户、存、支取、变更等业务所需经办人员身份证件等信息材料。如需在存款银行开通网上银行、电话银行、手机银行等功能,需经基金管理人、基金托管人双方确认同意。</p> <p>如需停止使用银行账户,基金管理人应联系基金托管人及时办理销户手续。</p> <p>(八)基金财产投资的有关银行存证实书等有效凭证的保管</p> <p>基金管理人应将基金财产投资的有关有效凭证交由基金托管人保管。属于基金托管人实际控制下的实物加券在基金托管人保管期间的损毁、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。</p> <p>基金投资银行存单的,由存款银行向基金管理人开具存证实书,基金管理人应与基金托管人应遵守以下特别约定:</p> <p>1.基金财产在开展银行存款投资业务前,基金管理人应根据基金托管人的要求,提供办理存证实书出入库手续所需的经办人员身份信息等相关材料。如基金托管人对相关材料有异议,基金托管人有权拒绝办理并不承担相应责任。基金管理人应采取有效措施并更正信息。</p> <p>2.基金管理人应通知存款银行及时与基金托管人办理存证实书出入库保管手续。如存证实书要素与存款协议不符,在基金管理人及存款银行核实更正前,基金托管人有权拒绝办理出入库手续。因发生自然灾害等不可抗力情况导致入库延误的,基金管理人应及时向基金托管人书面说明,并采取积极措施积极推动存证实书入库,在未完成入库前,由存款银行持有并履行保管责任。</p> <p>3.存款到期前,基金管理人应及时与基金托管人办理存证实书出库手续。如需提前支取,基金管理人应出具提前支取说明函。如需部分提前支取,应办理存证实书置换,置换后新存证实书除金额、编号、存证实书开具日期外,其他核心要素与原存证实书一致。</p> <p>4.存款到期后,如因自然灾害等不可抗力导致无法正常办理存证实书出库手续的,基金管理人应在与存款银行的存证实书出库手续上做出相应安排,并明确存证实书将支取后的存款本息全部划回因基金资产托管专户。</p> <p>5.如存证实书因非基金托管人原因出现毁损、灭失,或晚于存款到期日到达存款行等情形,导致存证实书无法按约定支取的,基金管理人应及时采取补救措施,基金托管人不承担相关责任,但应给予积极配合。存证实书仅作为存证实书,不得设立担保或用于任何可能导致存款资金损失的其他用途。</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、证券经纪机构的固有财产。</p> <p>.....</p> <p>3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、债券托管账户和期货账户等投资所需账户。基金管理人、基金托管人、证券经纪商三方应签订三方存管协议。证券经纪商根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关证券资金账户。</p> <p>(四)基金证券账户与证券资金账户的开设和管理</p> <p>1.基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。</p> <p>2.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。</p> <p>3.基金管理人以本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,并按照该营业网点开户的流程和要求,签订相关的协议。证券资金账户与基金托管账户建立第三方存管关系。</p> <p>4.基金管理人根据相关法律法规及协议约定在选定的证券经纪商处为本基金开立证券资金账户,用于办理本基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算资金和交易保证金的收取按照代理证券买卖的证券经纪机构的约定执行。</p> <p>(六)存款投资账户的开立和管理</p> <p>基金财产开展定期存款等银行存款投资前,基金管理人应以基金名义开立银行账户,该账户仅用于托管账户划转存款本息及利息收入,开户时基金管理人须向存款银行预留基金托管人印鉴,如基金托管人需变更预留印鉴,基金管理人应通知并配合存款银行办理变更手续。</p> <p>基金管理人应严格按照双方约定,事先向基金托管人提供办理开户、存、支取、变更等业务所需经办人员身份证件等信息材料。如需在存款银行开通网上银行、电话银行、手机银行等功能,需经基金管理人、基金托管人双方确认同意。</p> <p>如需停止使用银行账户,基金管理人应联系基金托管人及时办理销户手续。</p> <p>(八)基金财产投资的有关银行存证实书等有效凭证的保管</p> <p>基金管理人应将基金财产投资的有关有效凭证交由基金托管人保管。属于基金托管人实际控制下的实物加券在基金托管人保管期间的损毁、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。</p>

<p>七、交易及清算安排</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序</p> <p>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。选择的标准是:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、资质雄厚,信誉良好; 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; 3、内部管理规范,严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求; 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要,并能为本基金提供全面的信息服务; 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、个股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>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进行考察后确定代理本基金证券买卖的证券经营机构,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席位使用协议,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。</p> <p>基金管理人应及时将基金专用席位号、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>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,并与其签订期货经纪合同。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、证券经纪机构选择的规则执行。</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任 <p>基金管理人应与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则,签订《证券交易资金结算协议》,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。</p> <p>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。</p> <p>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和清算代理银行办理。</p> <p>基金参与港股通交易的,基金管理人应保证在T+1日9:30之前在托管的托管专户或结算备付金账户上有足够的头寸用于港股通T+1日公司行动、证券组合费和风控资金的交收,在T+1日14:00之前在托管的托管专户或结算备付金账户上有足够的头寸用于港股通T+2日交易资金的交收。如由于基金管理人的原因导致港股通交收失败,由此给托管人、托管人托管的其他资产组合造成的经济损失,由基金管理人承担。</p> <p>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《证券交易资金结算协议》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,由此给基金造成的损失由基金管理人承担。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2、基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序 <p>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10时之前划拨资金,用以完成清算交收。</p> <ol style="list-style-type: none"> 3、基金无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序 <p>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。</p> <p>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延误或拒绝执行。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。</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经营机构,由基金管理人、基金托管人和证券经纪机构就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议,明确三方在本基金进行证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。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。</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,并与其签订期货经纪合同。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、证券经纪机构选择的规则执行。</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任 <p>本基金通过证券经纪机构进行的交易所场内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。</p> <p>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。</p> <p>本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金清算交割,全部由基金托管人负责办理。</p>
------------------	--	--