

# 关于太平中证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

为更好地满足投资者需求，提升太平中证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《太平中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《太平中证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，太平基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，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》。现将具体事宜公告如下：

## 一、证券交易结算模式转换

自2024年1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、托管协议的修改

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，修改内容详见附件《<太平中证1000指数增强型证券投资基金托管协议>修改前后文对照表》。

基金管理人将对本基金招募说明书及基金产品资料概要进行更新。

## 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》事宜履行了适当程序，符合法律法规、监管机构和《基金合同》的规定。

3、投资者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（更新）、基金产品资料概要（更新）及相关法律文件。投资者可登录本基金管理人网站（[www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)）或拨打本基金管理人的客户服务电话（021-61560999或4000288699）获取相关信息。

#### 四、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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。投资者在投资基金之前，请仔细阅读《基金合同》和基金产品资料概要（更新）、招募说明书（更新），全面认识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，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

太平基金管理有限公司  
2024年1月29日

附件：《太平中证1000指数增强型证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
五、 基金 财产 的保 管	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>1. 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</p> <p>2. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>1. 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</p> <p>2. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人<b>和证券经纪机构</b>的固有财产。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。</p>
	<p>(三) 基金的银行存款账户的开立和管理</p> <p>1. 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。</p> <p>2. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。</p>	<p>(三) 基金的银行存款账户的开立和管理</p> <p>1. 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。</p> <p>2. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金<b>除证券交易所场内交易以外</b>的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。</p>
	<p>(四) 基金证券交收账户、<b>资金交收账户</b>的开立和管理</p> <p>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开立证券账户。</p> <p>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>基金管理人不得对基金证券交收账户、<b>资金交收账户</b>进行证券的超卖或超买。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p>	<p>(四) 基金证券交收账户、<b>证券资金账户</b>的开立和管理</p> <p>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开立证券账户。</p> <p>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><b>证券账户开立后，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对应的证券资金账户，并通知基金托管人。证券资金账户用于本</b></p>

	<p>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即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。</p>	<p>基金证券交易的结算以及证券交易结算资金的记录，并与本基金银行存款账户之间建立唯一银证转账对应关系，证券经纪机构对开立的证券资金账户内存放的资金的安全承担责任，基金托管人不负责保管证券资金账户内存放的资金。</p> <p>由基金托管人持基金管理人与证券经纪机构签订的三方存管相关协议办理证券资金账户与本基金银行存款账户的银证签约手续，未经基金托管人书面同意，基金管理人不得将银证签约的指定银行结算账户（即本基金银行存款账户）变更为其他账户，否则，因此引起的法律后果及给本基金造成的损失全部由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人不得对基金证券交收账户、证券资金账户进行证券的超卖或超买。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p>
<p>六、指令的发送、确认和执行</p>	<p>无</p>	<p>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；或由基金托管人根据基金管理人的划款指令执行银证互转。</p> <p>基金管理人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收付指令，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。基金管理人发送指令应采用电子传真、邮件、电子指令或双方认可的其他方式。</p>

<p><b>七、交易及清算交收安排</b></p>	<p>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构的标准和程序</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经纪机构，<b>并代表基金与被选择的证券经纪机构签订交易单元租用协议</b>。基金管理人应及时将基金交易单元号、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，并在法定信息披露公告中披露相关内容。</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>(一) 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经纪机构的标准和程序</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经纪机构，<b>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，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</b>。基金管理人应及时将基金交易单元号、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，并在法定信息披露公告中披露相关内容。</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> <p>1. 资金划拨</p> <p>对于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。基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的资金划拨指令时，基金银行账户或<b>资金交收</b>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，并立即通知基金管理人。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和在途时间。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。对超头寸的划款指令，基金托管人有权止付但应及时电话通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>2. 结算方式</p> <p>支付结算以转账形式进行。如中国人民银行有更快捷、安全、可行的结算方式，基金托管人可根据需要进行调整。</p> <p>3. 证券交易资金的<b>清算</b></p> <p><b>本基金投资于证券而发生的场内、场外交易的清算交割，由基金托管人负责办理。</b></p> <p>本基金场外证券投资的清算交割，由基金托管人根据基金管理人的指令通过登</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 资金划拨</p> <p>对于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。基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的资金划拨指令时，基金银行账户或<b>证券资金</b>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，并立即通知基金管理人。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和在途时间。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。对超头寸的划款指令，基金托管人有权止付但应及时电话通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>2. 结算方式</p> <p>支付结算以转账形式进行。如中国人民银行有更快捷、安全、可行的结算方式，基金托管人可根据需要进行调整。</p> <p>3. 证券交易所资金的<b>结算</b></p> <p><b>本基金的证券交易所证券交易资金结算模式为券商结算模式。证券经纪机构负责根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）的相关规则，作为结算参与人与中国结算办理本基金投</b></p>

<p>记结算机构办理。本基金场内证券投资的清算交割，由基金托管人根据双方签订的《托管银行证券资金结算协议》约定，由基金托管人负责办理。但本基金场内证券投资涉及T+0日非担保、RTGS交收的业务，基金管理人应在T+0日15:00前书面通知基金托管人办理交收，否则基金托管人不能保证相关清算交割成功。如因基金托管人的自身原因在清算上造成基金资产的损失，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投资运作行为而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损失由基金管理人承担。</p> <p>基金托管人在完成相关登记结算公司通知的事项后应通知基金管理人。</p> <p>由于基金管理人的原因造成基金无法按时支付证券清算款，按照登记结算机构的有关规定办理。</p> <p>本基金参与港股通交易时，基金管理人应事先书面通知基金托管人，明确交易单元、佣金费率等相关信息，在托管人完成相关设置后方可开展交易。若涉及需基金管理人做出选择的港股通公司行为，基金托管人根据基金管理人提供的数据将基金管理人的选择结果提交给中国结算。</p>	<p>资于证券交易所证券交易及非交易涉及的证券资金的清算交收。基金管理人应遵守有关登记结算机构制定的相关业务规则和规定，该等规则和规定自动成为本条款约定的内容。</p> <p>基金管理人、基金托管人和证券经纪机构就本基金参与证券交易所证券交易的具体事项另行签订协议，明确三方在本基金参与证券交易所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。证券经纪机构负责证券资金账户的资金安全和完整，并承担因证券经纪机构原因导致本基金清算交收业务无法完成给本基金造成的损失；若由于基金管理人的投资行为造成基金投资清算困难和风险的，由基金管理人负责解决，由此给本基金造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人应根据证券交易的资金需求，向基金托管人发送银证/证银转账指令，将资金从本基金银行存款账户划至证券资金账户，或将资金从证券资金账户划至本基金银行存款账户。基金托管人对基金管理人的指令根据本协议约定核对无误后，通过银证转账方式执行指令。本基金投资于证券而发生的场内、场外交易的清算交割，由基金托管人负责办理。</p> <p><b>4. 场外交易资金结算</b></p> <p>本基金场外证券投资的清算交割，由基金托管人根据基金管理人的指令通过登记结算机构办理。如因基金托管人的自身原因在清算上造成基金资产的损失，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投资运作行为而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损失由基金管理人承担。</p>
--	--