

东海基金管理有限责任公司关于东海核心价值精选混合型证券投资基金 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，增强东海核心价值精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，东海基金管理有限责任公司（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》和《东海核心价值精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人江苏银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定转换本基金证券交易结算模式，并对《东海核心价值精选混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）等法律文件进行修订。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自 2023 年 11 月 7 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、因本基金转换证券交易结算模式，本公司拟对《托管协议》相关条款进行修订，具体修改内容详见附件《东海核心价值精选混合型证券投资基金托管协议修订前后对照表》。

三、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》及其生效时间将另行公告。本公司将根据上述修订情况，在《东海核心价值精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）》中，对上述内容进行相应修改，并将更新后的文件在规定媒介披露。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《东海核心价值精选混合型证券投资基金基金合同》、《东海核心价值精选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、其他事项

1、投资者可通过以下途径咨询有关详情

客户服务电话：40095 95531

网址：<https://www.donghaifunds.com>

2、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。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。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

附件：《东海核心价值精选混合型证券投资基金托管协议修订前后对照表》

东海基金管理有限责任公司

2023年11月7日

附件：《东海核心价值精选混合型证券投资基金托管协议修订前后对照表》

章节	修订前	修订后
<p>五、基金财产的保管</p> <p>（一）基金财产保管的原则</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。</p>	<p>（2）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>五、基金财产的保管</p> <p>（四）基金证券账户、证券资金账户的开立和管理</p>	<p>（四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理</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>基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司进行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</p>	<p>（四）基金证券账户、证券资金账户的开立和管理</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>基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构营业网点开立证券资金账户。证券经营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，并按照该证券经营机构开户的流程和要</p>

	<p>结算备付金账户。</p>	<p>求与基金管理人签订相关协议。</p> <p>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所选择的证券经营机构负责。证券资金账户内的资金，只能通过证银转账方式将资金划转至基金托管资金账户，不得将资金划转至任何其他银行账户。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。</p>
<p>六、指令的发送、确认和执行</p>		<p>基金管理人在运用基金财产开展场内证券交易时，应通过基金托管资金账户与证券资金账户已建立的第三方存管系统实现基金托管资金账户与证券资金账户之间的资金划转，即银证互转，基金托管人应当根据基金管理人的指令办理划款。</p> <p>基金管理人在运用基金财产开展场外交易时，应向基金托管人发送场外交易资金划拨及其他款项付款</p>

		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>六、指令的发送、确认和执行</p> <p>(三) 指令的发送、确认和执行的程序和程序</p>	<p>基金管理人应按照《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令，发送人应按照其授权权限发送指令。指令由“授权通知”确定的有权发送人代表基金管理人用传真的方式向基金托管人发送。发送后基金管理人及时通过电话与基金托管人确认指令内容。凡指令以传真或扫描件形式发出的，则指令正本由基金管理人保管，基金托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以基金托管人收到的划款指令传真件或扫描件为准。</p> <p>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</p>	<p>基金管理人应按照《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令，发送人应按照其授权权限发送指令。指令由“授权通知”确定的有权发送人代表基金管理人用传真的方式向基金托管人发送。发送后基金管理人及时通过电话与基金托管人确认指令内容。凡指令以传真或扫描件形式发出的，则指令正本由基金管理人保管，基金托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以基金托管人收到的划款指令传真件或扫描件为准。</p> <p>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</p>

	<p>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 15:00 前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前 2 个工作小时发送，且相关付款条件已经具备。对于同业市场债券交易通知单加盖印章后传真给基金托管人。对于被授权人发出的指令，基金管理人不得否认其效力。基金托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令的有效后，方可执行指令。指令执行完毕后，基金托管人应及时通知基金管理人。基金托管人仅根据基金管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。对于新股申购网下公开发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T 日)的前一日下班前将新股申购指令发送给托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00 时。</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</p>	<p>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 15:00 前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前 2 个工作小时发送，且相关付款条件已经具备。对于同业市场债券交易通知单加盖印章后传真给基金托管人。对于被授权人发出的指令，基金管理人不得否认其效力。基金托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令的有效后，方可执行指令。指令执行完毕后，基金托管人应及时通知基金管理人。基金托管人仅根据基金管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。对于新股申购网下公开发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T 日)的前一日下班前将新股申购指令发送给托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00 时。</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</p>
--	--	---

	<p>用书面通知托管人，托管人在 16:00 前支付至登记结算公司指定账户。</p> <p>对于在上交所固定收益平台和在深交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 15:00 将划款指令发送至托管人。</p> <p>因基金管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国证券登记结算有限责任公司所造成的损失由基金管理人承担，包括赔偿在上海市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用中国证券登记结算有限责任公司上海分公司最低备付金带来的利息损失。</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》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。若基金管理人超出上述时间点给基金托管人发送划款指令，基金托管人将尽全力配合执行，但托管人不保证当日能够完成。</p>	<p>书面通知托管人，托管人在 16:00 前支付至登记结算公司指定账户。</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》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。若基金管理人超出上述时间点给基金托管人发送划款指令，基金托管人将尽全力配合执行，但托管人不保证当日能够完成。</p>
--	--	--

<p>七、交易及清算交收安排</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>1、选择代理证券买卖的证券经营机构</p> <p>(2) 选择程序</p>	<p>基金管理人根据以上标准进行考察后选择证券经营机构。基金管理人应代表基金与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议。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>基金管理人根据以上标准进行考察后选择证券经营机构，并与其签订证券经纪合同。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，明确三方在本基金参与场内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。基金管理人应及时将基金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>七、交易及清算交收安排</p> <p>(二) 基金清算交收的时间和程序</p>	<p>(1) 因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交收，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。</p> <p>(2) 如果因为基金托管人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未事先通知基金托管人增加交易单元，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</p>	<p>(1) 因本基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交收，由基金托管人负责办理。因基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交收，由基金管理人选择的证券经纪机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。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。</p> <p>(2) 对基金管理人的资金划拨指令，基金托管人在</p>

	<p>金财产损失的由基金管理人承担；如果由于基金管理人违反法律法规、交易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，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，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>（3）基金管理人应采取合理措施，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，确保在 T+1 日 12:00 之前有足够的资金头寸用于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的资金结算。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。</p>	<p>复核无误后应在规定期限内执行并在执行完毕后回函确认，不得延误。如果因为基金托管人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。</p>
--	---	---