

## 万家基金管理有限公司

# 关于万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求,增强万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的市场竞争力,万家基金管理有限公司(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》和《万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,经与基金托管人招商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模式。现将具体事宜公告如下:

### 一、证券交易模式转换

自2020年11月23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《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》(以下简称“《托管协议》”)相关条款进行修订,修订内容如下:

	修订前表述	修订后表述
五、 基金 财产 的保 管	(一)基金财产保管的原则 1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。 ..... 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。  ..... (二)基金资金账户的开立和管理 1.基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户(也可称为“托管账户”),保管基金的银行存款,并根据基金管理人的指令办理资金	(一)基金财产保管的原则 1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和 <b>证券经纪机构</b> 的固有财产。 ..... 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。 <b>证券经纪商根据相关法律法规规定及相关协议约定为本基金开立证券资金账户。基金管理人、基金托管人、证券经纪商三方应签订证券经纪服务协议。</b> ..... (二)基金资金账户的开立和管理 1.基金管理人以基金名义在基金管理人选择的 <b>证券经营机构</b> 开立 <b>证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、</b>

	<p>收付。托管账户名称应为“万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金”，预留印鉴为基金托管人印章。</p> <p>.....</p> <p>(三)基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>.....</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、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。</p> <p>.....</p>	<p>规范性文件为本基金开立相关资金账户并<u>按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</u></p> <p><u>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的资金全额存放在基金管理人为基金开设的证券资金账户中,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,也不负责保管证券资金账户内存放的资金。</u></p> <p>.....</p> <p>(三)基金证券账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>4. <u>基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户、证券资金账户,亦不得使用证券账户或证券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>.....</p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>(三)指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>1. ....</p> <p>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。</p>	<p>(三)指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>1. ....</p> <p>对于场内业务,基金管理人运用基金财产时,开展场内证券交易前,基金管理人通过基金资产托管账户与证券资金账户已建立的第三方存管系统在资产托管专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>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</p> <p>1、基金管理人应设计选择代理证券买卖的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</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>1、基金管理人应制定选择的标准和程序,并负责根据相关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相关协议,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公告中披露有关内容。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>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>.....</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>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《托管银行证券资金结算规定》的要求执行。</p>	<p><u>基金管理人应在基金起始运作前将基金专用交易单元号、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,并将被选中证券经营机构提供的《交易单元租用协议》及时送达基金托管人。</u></p> <p>.....</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <p><u>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。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。</u></p> <p><u>本基金投资于场内交易的投资品种前,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。本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金汇划,由基金托管人负责办理。</u></p>
---	--

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,在《万家中证 1000 指数增强型发起式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本公司官网上披露。本公告未尽事宜,敬请投资者参见《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

本公司网站: [www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

本公司客服电话: 400-888-0800

五、本公告的解释权归万家基金管理有限公司。

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。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

万家基金管理有限公司

2020年11月21日