

国金基金管理有限公司

关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 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，增强国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，国金基金管理有限公司（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《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人中国光大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并修订《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）。现将具体事项公告如下：

一、证券交易模式转换

自 2023 年 1 月 12 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及《托管协议》的修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，根据《基金合同》的约定无需召开基金份额持有人大会审议。

二、因转换证券交易模式等内容，拟对《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	<p>（四）基金证券账户和 结算备付金账户的开立和管理</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、证券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>（四）基金证券账户和 资金交收账户 的开立和管理</p> <p>4. 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资产托管专户建立第三方存管关系。</p> <p>新增以下内容并调整后续序号：</p> <p>5. 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设证券交易资金账户中，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</p>

		<p>人不负责办理场内的证券交易资金清算,也不负责保管证券交易资金账户内存放的资金。</p> <p>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。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。</p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>(三)指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1. 指令的发送</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应于划款前一日向基金托管人发送投资划款指令并确认,如需在划款当日下达投资划款指令,在发送指令时,应为基金托管人留出执行指令所必需的时间(该必需的时间不长于正常情况下基金托管人日常处理该指令所用的平均时间)。基金管理人发送有效指令(包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令)的截止时间为当天的15:00。如基金管理人要求当天某一时点到账,则交易结算指令需提前2个工作小时发送,并进行电话确认。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17:00前将新股申购指令发送给基金托管人,指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00时。对上海证券交易所的认购权证行权交易,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前支付至登记结算公司指定账户。由于基金管理人原因导致的指令传输不及时、未能留出足够的划款时间,致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。由于基金托管人原因导致资金未能及时到账所造成的损失由基金托管人承担。</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</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应于划款前一日向基金托管人发送投资划款指令并确认,如需在划款当日下达投资划款指令,在发送指令时,应为基金托管人留出执行指令所必需的时间(该必需的时间不长于正常情况下基金托管人日常处理该指令所用的平均时间)。基金管理人发送有效指令(包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令)的截止时间为当天的15:00。如基金管理人要求当天某一时点到账,则交易结算指令需提前2个工作小时发送,并进行电话确认。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17:00前将新股申购指令发送给基金托管人,指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00时。对于银证转账指令,指令发送时间最迟不应晚于T日下午14:00时。由于基金管理人原因导致的指令传输不及时、未能留出足够的划款时间,致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。由于基金托管人原因导致资金未能及时到账所造成的损失由基金托管人承担。</p>
<p>七、交易</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p>	<p>(一)选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p>

<p>及清算交收安排</p>	<p>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。基金管理人负责选择证券经营机构,租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,并将被选中证券经营机构提供的《托管银行新增交易单元申请书》及时送达基金托管人,确保基金托管人申请接收结算数据。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>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,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。</p> <p>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,并承担相应责任。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纪机构的有关情况、基金通过该证券经纪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>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</p> <p>根据《中国证券登记结算有限责任公司结算备付金管理办法》、《证券结算保证金管理办法》,在每月第2个工作日,中国证券登记结算有限责任公司对结算参与人的最低结算备付金、结算保证金限额进行重新核算、调整。基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司调整最低结算备付金、结算保证金当日,在资金流量表中反映最低备付金、结算保证金调整的情况。基金管理人应预留最低备付金、结算保证金,并根据中国证券登记结算有限责任公司确定的实际下月最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作,调整所需的现金头寸。</p> <p>基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。场内资金结算由基金托管人根据中国证券登记结算有限责任公司结算数据办理;场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的交易划款指令具体办理。</p> <p>如果因为基金托管人自身原因在清算上造成基金财产的损失,应由基金托管人负责赔偿;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等事</p>	<p>(二)基金投资证券/期货后的清算交收安排</p> <p>1. 清算与交割</p> <p>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/期货经纪机构应根据有关法律法规及相关业务规则,签订证券/期货经纪服务协议,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>本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金汇划,全部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>

宜，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，造成基金资产损失的由基金管理人承担；如果由于基金管理人违反市场操作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，由此给基金托管人、本基金造成的直接损失由基金管理人承担。

基金管理人应采取合理、必要措施，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，基金管理人应在T+1日上午10:00前补足透支款项，确保资金清算；若有大宗交易，基金管理人还需于T日15:30之前通知托管人交易金额。若由于基金管理人的原因导致基金托管人交收失败，由此引起的后果由基金管理人承担。若结算机构的交收规则发生变化，基金托管人和基金管理人应根据新的交收规则作出相应变动，基金管理人应配合基金托管人为完成交收提供必要的帮助。

非担保交收业务的交易告知。非担保交收业务是指中国结算上海分公司组织交易双方根据业务规则规定或双方约定的结算模式完成交收，中国结算不作为双方的共同对手方，不提供交收担保。为确保非担保交收业务的正常交收，投资管理人务必高度重视此类业务交易告知的重要性，即于发生国债买断式回购到期购回、权证行权、大宗专场、专项资产管理计划转让以及部分发行类业务（股配债、老股东配售的增发、公司债场内分销）以及通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让和通过深圳综合协议平台的公司债、私募债转让等非担保交收业务，管理人应于交易当日及时将该交易书面告知托管人并进行电话确认。其中权证行权的交易和通过上交所固收平台达成的私募债转让交易告知截止时点

	<p>为申报当日 15:00; 通过深圳综合协议平台达成的公司债、私募债转让交易告知时间为申报当日 15:30; 其余产品非担保交易告知截止时点为交易当日 17:00。</p> <p>通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让, 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算 (RTGS)。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:30 分, 为保证 RTGS 交易成功, 管理人应于交易 T 日的 15:00 之前, 将买入私募债券的指令传真至托管人。</p> <p>通过深圳综合协议平台的公司债, 结算方式为逐笔全额非担保交收, 最终交收时点为 T 日 16:00, 因此基金管理人应于 T 日 15:30 分之前向基金托管人发送非担保交收债券的买入指令。</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, 基金托管专户或资金交收账户 (除登记公司收保或冻结资金外) 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。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 (该必需的时间不长于正常情况下基金托管人日常处理该指令所用的平均时间)。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。</p>	
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p>	<p>(二) 基金投资证券/期货后的清算交收安排</p> <p>3. 沪、深交易所数据传输和接收 基金管理人和基金托管人从证券经纪机构处接收本基金的场内交易电子清算数据, 基金管理人、基金托管人和证券经纪机构之间的场内交易电子清算数据的传输采用专线 (深证通)或各方认可的其他方式。关于沪、深交易所数据传输和接收的具体相关条款、各方当事人权利、责任及义务的具体约定以三方签署的经纪服</p>

<p>七、 交易 及清 算交 收安 排</p>	<p>(四) 申赎资金结算</p> <p>基金托管账户与基金管理人开立的“清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、全额交收”的原则，当存在托管账户应收额时，基金管理人应在 T+2 日 15:00 之前从基金清算账户划到基金托管账户，基金托管人在资金到账后应立即通知基金管理人，并将有关书面凭证传真给基金管理人进行账务管理；当存在托管账户应付额时，基金管理人应在 T+3 日将划款指令发送给基金托管人，基金托管人按基金管理人的划款指令将托管账户应付额在 T+3 日 12:00 之前划往基金清算账户，基金托管人在资金划出后立即通知基金管理人，并将有关书面凭证交给基金管理人进行账务管理。</p> <p>当存在托管账户应付额时，如基金托管专户有足够的资金，基金托管人应按时拨付，因基金托管专户没有足够的资金，导致基金托管人不能按时拨付，基金托管人应及时通知基金管理人，如系基金管理人的原因造成的，基金托管人不承担垫款义务。</p>	<p>务协议为准。</p> <p>(四) 申赎资金结算</p> <p>基金托管账户与基金管理人开立的“清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每个开放日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。如经基金管理人与基金托管人协商一致，交收日可相应调整。</p> <p>当存在基金托管账户净应收额时，基金管理人负责将基金托管账户净应收额在交收日 15:00 前从“清算账户”划到基金托管账户，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。当存在基金托管账户净应付额时，基金托管人按管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日 12:00 前划往“清算账户”，对于未准时划付的资金，基金管理人应及时通知基金托管人划付。因基金托管专户没有足够的资金，导致基金托管人不能按时拨付，基金托管人应及时通知基金管理人。</p>
<p>八、 基金 资产 净值 计算 和会 计核 算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>(2) 由于不可抗力，或证券/期货交易所、证券登记结算机构、存款银行等第三方机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>(2) 由于不可抗力，或证券/期货交易所、证券登记结算机构、证券经营机构、期货经纪机构、存款银行等第三方机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>

三、本基金证券交易模式转换完成的时间以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。本公司将根据上述《托管协议》修订情况，在《国金量化多策略灵活配置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订，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

《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新等相关文件。

四、投资者可登录本公司网站(www.gfund.com)查阅修订后的《托管协议》全文或拨打本公司客户服务热线(4000-2000-18)咨询相关信息。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2023年1月11日