

诺德基金管理有限公司关于诺德策略精选混合型证券投资基金转换证券交易结算模式有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，为投资者提供更好的服务，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《诺德策略精选混合型证券投资基金基金合同》《诺德策略精选混合型证券投资基金托管协议》的有关规定，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，诺德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定将诺德策略精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的证券交易结算模式由托管人交易结算模式调整为证券经纪商交易结算模式，并相应修订本基金的托管协议和招募说明书，本次修订自本公告发布之日起生效。现将有关情况公告如下：

一、证券交易结算模式转换

自2023年12月28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、因转换证券交易结算模式，拟对《诺德策略精选混合型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，修订内容详见附件的修改前后文对照表。

三、本基金证券交易结算模式转换完成时间以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。

本基金管理人后续将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定对本基金招募说明书的相关内容进行更新，并将更新后的招募说明书在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）及本基金管理人网站（www.nuodefund.com）上披露。

投资者欲了解详情，请登录本公司网站（www.nuodefund.com）查阅相关公告或拨打本公司客户服务电话（400-888-0009）咨询相关事宜。

本公告的有关内容在法律法规允许范围内由本基金管理人负责解释。

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。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。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（更新）等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

诺德基金管理有限公司

2023年12月27日

附件：

诺德策略精选混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表

附件：《诺德策略精选混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》

章节	修改前	修改后
	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>(四)基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>2. 基金证券账户的开立和使用，仅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或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>.....</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上海分公司、深圳分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、交收价差资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>(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、<u>证券/期货经纪机构</u>的固有财产；</p> <p>.....</p> <p>(四) 基金证券账户<u>及其他投资</u>账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>2. 基金证券账户、<u>证券资金</u>账户的开立和使用，仅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或转让基金的任何证券账户、<u>证券资金</u>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>.....</p> <p>4. <u>基金管理人以本基金的名义在证券经纪机构开立证券资金账户，用于本基金场内证券交易的结算、证券交易结算资金的存管和交易结算资金的变动明细的记录。本基金参与交易所证券交易的交易结算资金应由第三方存管银行存管，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。本基金在证券经纪机构开立的证券资金账户、基金托管人以本基金名义在第三方存管银行开立的银行结算账户以及第三方存管银行为本基金建立的交易结算资金管理账户应当一一对应。基金管理人代表本基金与证券经纪机构和第三方存管银行签署第三方存管协议及相关协议。本协议生效期间，银证转账密码由基金托管人负责保管和使用。</u></p> <p>.....</p>
六、指令的发送、确认及执行	<p>基金管理人运用基金财产时向基金托管人发送资金划拨及其他款项付款指令，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> <p>.....</p>	<p><u>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。</u></p> <p>基金管理人运用基金财产时向基金托管人发送<u>场外</u>资金划拨及其他款项付款指令，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> <p>.....</p>
七、交易及	(一) 选择代理证券、期货买卖的 证	(一) 选择代理证券、期货买卖的 证

<p>清算交收安排</p>	<p>券、期货经营机构</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《基金用户交易单位变更申请书》及时送达基金托管人，确保基金托管人申请接收结算数据。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>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》和《证券结算保证金管理办法》等相关规定，在每月前3个工作日内，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和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和结算保证金当日，在资金流量表中反映最低备付金和结算保证金调整的情况。基金管理人应预留最低备付金和结算保证金，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和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</p>	<p>券经纪机构、期货经纪机构</p> <p>基金管理人应设计选择代理证券买卖的证券经纪机构的标准和程序。基金管理人负责选择证券经纪机构，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，就基金参与场内证券交易、结算等具体事项另行签订协议。</p> <p>……</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>本基金财产所有场内证券交易的清算交收由基金管理人选择的证券经纪机构作为结算参与人负责办理，由该证券经纪机构直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中国证券登记结算有限责任公司针对各类交易品种制定的结算业务规则和规定。</p> <p>对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。</p> <p>本基金财产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>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；由于基金管理人的原因造成的正常结算业务无法完成，由基金管理人承担直接经济损失；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的直接经济损失。</p> <p>对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。</p>
---------------	--	--

人负责赔偿；但因中国人民银行、中国证券登记结算有限责任公司和中央国债登记结算有限责任公司资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非基金托管人的原因造成清算资金无法按时到账的情形，基金托管人可免责；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。

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司分别对部分交易品种实行T+0非担保交收制度，因此对于T+0非担保买入交易，基金管理人须于T日14:00之前备足当日非担保交收需支付的资金头寸，并发送指令通知基金托管人，以便基金托管人履行T+0非担保交收职责；对于非担保卖出交易，基金管理人应在T日14:00之前发送调回指令给基金托管人，并确保卖出方及时履行付款和交收责任，否则无法及时调回卖出款项的责任由基金管理人承担。由于基金管理人的原因导致预交收失败，由此引起的后果由基金管理人承担。基金管理人应采取合理措施，确保在T日日终有足够的资金头寸用于T+1日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。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。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的行权交收日为T日，为避免交收失败，基金管理人须在T日通知基金托管人并将划款指令传真给基金托管人。对中国证券登记结算有限责任公司实行非担保交收的品种，由于非基金托管人的原因导致交收失败，基金托管

	<p>人不承担责任。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。</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。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>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>.....</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>.....</p> <p>（2）由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，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>	<p>（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>.....</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>.....</p> <p>（2）由于证券、期货交易所及其登记结算公司或证券/期货经纪机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，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>