

南方恒元保本混合型证券投资基金保本期到期转型修订基金合同的公告

南方恒元保本混合型证券投资基金（基金简称为南方恒元，基金代码为 202211，以下简称本基金）为契约型开放式证券投资基金，基金管理人为南方基金管理有限公司（以下简称本公司或本基金管理人），基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基金登记机构为南方基金管理有限公司，担保人为江苏省信用再担保有限公司和深圳市高新投集团有限公司。

本基金经中国证监会 2008 年 9 月 5 日证监许可[2008]1106 号文核准募集，于 2008 年 11 月 12 日成立。本基金保本期为三年，第一个保本期自 2008 年 11 月 12 日开始至 2011 年 11 月 14 日（2011 年 11 月 12 日、2011 年 11 月 13 日为非工作日，顺延至 2011 年 11 月 14 日），第二个保本期自 2011 年 12 月 13 日至 2014 年 12 月 15 日（2014 年 12 月 13 日、2014 年 12 月 14 日为非工作日，顺延至 2011 年 11 月 15 日），第三个保本期自 2014 年 12 月 30 日至 2018 年 1 月 2 日（2017 年 12 月 30 日、2017 年 12 月 31 日、2018 年 1 月 1 日为非工作日，顺延至 2018 年 1 月 2 日）。

鉴于本基金的第三个保本期即将到期，但本基金管理人无法为本基金转入下一保本期确定保本担保人，本基金将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件，为此，本基金管理人经与托管人协商一致，根据《南方恒元保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）有关本基金保本期届满时，在符合法律法规有关担保人、或保本义务人资质要求、并经基金管理人和基金托管人认可的担保人、或保本义务人同意为下一保本期提供保本保障，与本基金管理人签订保证合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的情况下，本基金继续存续并进入下一保本期，下一保本期的具体起始日期以本基金管理人届时公告为准。否则，本基金转型为南方中证 100 指数证券投资基金，基金投资、基金费率、分红方式等相关内容也将做相应修改。在报中国证监会核准后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明的规定，决定将本基金转型为南方中证 100 指数证券投资基金（以下简称南方中证 100）。为适应基金转型的需要，本公司经与基金托管人协商一致，决定对《基金合同》进行修订。现将有关修订事项作说明如下：

1、根据本基金转型为非避险投资策略的南方中证 100 的情况及适应国内基金立法的需要，《基金合同》本次修订删除了《基金合同》中与基金避险投资策略运作有关的条款，将《基金合同》规定的有关基金转型为南方中证 100 后的基金份额申购与赎回、基金的投资、基金的费用与税收、基金的收益与分配等条款列为《基金合同》的正式条款，同时《基金合同》还根据国内基金立法的现状，还对合同其他条款进行了修订。《基金合同》具体修订的条目和内容见附表。

2、《基金合同》本次修订事项，或属于基金合同有明确约定的事项，或属于因相应的法律法规发生变动需要对基金合同进行修改的事项，或属于对基金份额持有人利益无实质性影响的事项，由基金管理人与托管人协商一致后修改基金合同的程序符合《基金合同》的约定，并已报中国证监会备案。

3、根据本公司发布的南方恒元保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方中证 100 指数证券投资基金相关业务规则的公告中的相关安排，自 2018 年 1 月 16 日起，本基金将更名为南方中证 100 指数证券投资基金，《南方恒元保本混合型证券投资基金基金合同》将更名为《南方中证 100 指数证券投资基金基金合同》，《南方中证 100 指数证券投资基金基金合同》的具体内容将按本次修订并公告的文本执行。

4、本基金管理人经与基金托管人协商一致，在对基金合同进行修订后，也将对基金托管协议和招募说明书涉及的上述相关内容进行相应修订。具体修订的内容，详见刊登在 2017 年 12 月 22 日《中国证券报》的《南方中证 100 指数证券投资基金招募说明书》。《南方中证 100 指数证券投资基金基金合同》及《南方中证 100 指数证券投资基金托管协议》同时登载于本公司网站。投资人办理基金交易等相关业务前，应仔细阅读该基金的基金合同、招募说明书及其更新、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件。

投资者可访问南方基金管理有限公司网站(www.nffund.com)或拨打全国免长途费的客户服务电话（400—889—8899）咨询相关情况。

风险提示：

本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。基金的过往业绩不代表其将来表现。

本基金转型为南方中证 100 指数证券投资基金，为股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金；且为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。转型后的南方中证 100 指数证券投资基金不再属于避险策略基金或保本基金，与转型前的南方恒元保本混合型证券投资基金具有不同的风险收益特征，其预期风险高于南方恒元保本混合型证券投资基金。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。

南方基金管理有限公司

2017 年 12 月 22 日

附件：转型合同修订说明

《南方恒元保本混合型证券投资基金基金合同》与《南方中证 100 指数证券投资基金基金合同》条文对照表

章节 条款 合同原文 调整或增加或删除后表述 相关说明

全文 南方恒元保本混合型证券投资基金 南方中证 100 指数证券投资基金 根据原先基金合同约定的名称调整

前言 《证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》 更新法规名称

本基金由基金管理人按照法律法规和《基金合同》的规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对基金募集的核准并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自担风险。 本基金由南方恒元保本混合型证券投资基金转型而来。南方恒元保本混合型证券投资基金由基金管理人按照法律法规和《基金合同》的规定募集，并经中国证监会核准，其转型后的南方中证 100 指数证券投资基金已经中国证监会备案。中国证监会对南方恒元保本混合型证券投资基金募集的核准以及其转型为本基金的备案，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自担风险。

根据《运作办法》第 4 条补充了开放式基金的风险提示。

投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

删除 删除了保本基金的风险

为投资者提供保本金额的保证，并由担保人提供不可撤销的连带责任担保 删除 删除了保本基金的风险

释义 发售公告指《南方恒元保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》 删除 转为非保本后，不涉及担保人 在本基金合同中如无特别指明，指本基金公告的当期保本期内的保本担保人 删除 转为非保本后，不涉及

无 人民币合格境外机构投资者指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人 根据法规完善表述

投资者指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称 投资者指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称 根据法规完善表述

基金合同生效日基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日 基金合同生效日指南方恒元保本混合型证券投资基金
保本期到期操作期间截止日的次日，即南方恒元保本混合型证券投资基金转型为南方中证 100 指数证券投资基金之日 转为非保本，修改基金合同生效日

募集期指自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限 删除 转为非保本后，不涉及

保本期 本基金的保本期每三年为一个周期。本基金第一个保本期自基金合同生效日起至三年后的对应日；本基金第一个保本期后的各保本期自本基金公告的保本期起始之日起至三年后对应日。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在保本期到期前公告到期处理规则，并确定下一个保本期的起始时间。基金合同中若无特别所指，保本期即为当期保本期。

保本期到期日或到期日即为当期保本期届满日，自当期保本期开始之日起至三年后对应日止。如该对应日为非工作日，保本期到期日顺延至下一个工作日

保本 在保本期到期日，如按基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额在当期保本期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额，差额部分即为保本赔付的差额，则基金管理人应补足该差额

持有到期的基金份额第一个保本期指基金持有人认购或申购基金份额并持有到保本期到期日的基金份额部分；之后各期保本期指基金持有人从上一个保本期结束后选择或默认选择转入当期保本期以及过渡期申购、当期保本期申购并持有到当期保本期到期日的基金份额部分

保本金额 指为从上一个保本期结束后选择或默认选择转入当期保本期、过渡期申购以及当期保本期申购并持有到期的基金份额提供的保本金额；保本金额的计算方法详见本合同第十二部分

担保 指担保人为基金管理人履行保本义务提供的不可撤销的连带责任担保

可担保份额指担保人在《保证合同》中承诺为本基金提供担保的基金份额的最高限额 删除 转为非保本后，不涉及

认购指在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为

发售指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为 删除 转为非保本后，不涉及

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。 补充法规适用条款

基金的基本情况 一 基金名称

南方恒元保本混合型证券投资基金 基金名称

南方中证 100 指数证券投资基金 根据原先基金合同约定的名称调整

二 基金类别

保本混合型证券投资基金 基金类别

股票型证券投资基金 根据原先基金合同约定的类别调整

四 基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，为投资者提供保本金额的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。

基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪 根据原先基金合同的投资章节中约定表述

无 标的指数

本基金的标的指数是中证 100 指数 根据原先基金合同的投资章节中约定表述

五 保本

在保本期到期日，如按基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额在当期保本期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，并在保本期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。 删除

转为非保本后，不涉及

六 担保

本基金的担保是指担保人为基金管理人履行保本义务提供的不可撤销的连带责任担保，担保范围为基金持有人持有到期的基金份额与保本期到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额在当期保本期内累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额的差额部分。本保本期内担保人提供担保责任金额上限为不超过当期保本期起始日确认的保本金额。担保人对担保责任金额上限不得调减。经担保人与基金管理人双方协商同意可调增担保责任金额上限。担保期间为基金保本期到期日起六个月。删除 转为非保本后，不涉及

七、 基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。删除 转为非保本后，不涉及

八 基金份额面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金认购费率最高不超过 5%，具体费率按招募说明书的规定执行。基金份额初始面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元。转为非保本，不涉及发售募集，删除认购表述

十、 基金保本期

本基金的保本期每三年为一个周期。本基金第一个保本期自基金合同生效日起至三年后的对应日；本基金第一个保本期后的各保本期自本基金公告的保本期起始之日起至三年后对应日。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在保本期到期前公告到期处理规则，并确定下一个保本期的起始时间。基金合同中若无特别所指，保本期即为当期保本期。删除 转为非保本后，不涉及

基金份额的发售 见原合同 删除 转为非保本后，不涉及

基金的历史沿革 无 本基金由南方恒元保本混合型证券投资基金转型而来。

南方恒元保本混合型证券投资基金为契约型开放式证券投资基金，经中国证监会 2008 年 9 月 5 日证监许可[2008]1106 号文核准募集，于 2008 年 11 月 12 日成立。

南方恒元保本混合型证券投资基金于 2008 年 10 月 7 日至 2008 年 11 月 7 日进行募集，并于 2008 年 11 月 12 日正式成立。本基金保本期为三年，第三个保本期于 2018 年 1 月 2 日到期，由于不符合保本基金存续条件，将按照本基金基金合同的约定转型为南方中证 100 指数证券投资基金，名称相应变更为南方中证 100 指数证券投资基金。

本基金第三个保本期到期操作期间为 2018 年 1 月 2 日（含）起至 2018 年 1 月 15 日（含）止。自

2018 年 1 月 16 日南方恒元保本混合型证券投资基金正式转型为南方中证 100 指数证券投资基金，转型后的《南方中证 100 指数证券投资基金基金合同》自该日起生效。补充基金的历史沿革说明

基金的存续 基金备案

详见原基金合同 《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。保留基金合同原先的基金存续模块，同时根据《运作办法》第 41 条规定完善。

基金份额的申购和赎回 七 3、本基金基金份额净值的计算：

本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。 3、本基金基金份额净值的计算：

本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。 3 位改 4 位

九 无 （4）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资人持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资人变相规避前述 50%比例要求的情形； 根据监管要求

增加投资者集中度超过 50%的情形

(4) 基金份额规模超过担保人可担保份额；删除 转为非保本后，不涉及

(5) 保本期到期前 6 个月内，基金管理人根据基金实际运作情况认为有必要暂停申购；删除 转为非保本后，不涉及

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述(1)到(6)项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定报刊和网站刊登暂停申购公告。发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述(1)、(2)、(3)、(5)、(6)项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定报刊和网站刊登暂停申购公告。当发生上述第(4)项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。根据上述条款调整相应调整序号及表述

十八、基金份额的转让 无 在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人在中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人受理基金份额转让业务的，基金份额持有人应根据基金管理人的业务规则办理基金份额转让业务。根据基金法补充

基金合同当事人及权利义务 一 (24) 严格遵守基金合同中有关保本和保本条款的约定；删除 转为非保本后，不涉及

三 依法申请赎回其持有的基金份额 依法申请转让或者赎回其持有的基金份额 根据基金法补充

基金份额持有人大会 一 (4) 保本期内，更换担保人，但担保人己丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况除外；删除 转为非保本后，不涉及

(7) 变更基金类别，但保本期到期后本基金转型为南方中证 100 指数证券投资基金，并由此变更基金的投资目标、投资范围、投资策略的情况除外；(6) 变更基金类别 转为非保本后，不涉及保本期到期后转型

(4) 保本期内，增加担保人，或在担保人己丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下，更换担保人；

(5) 保本期到期后本基金转型为南方中证 100 指数证券投资基金，并由此变更基金的投资目标、投资范围、投资策略；删除 转为非保本后，不涉及

二 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。按照基金法更新

四 (2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)。 (2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一 (含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一 (含三分之一)。

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)； (3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一 (含二分之一)；若本

人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

八 基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二 4、核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案 按照基金法更新

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后2日内在至少一家指定报刊和网站公告；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告

4、核准：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会核准后2日内在至少一家指定报刊和网站公告；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告

保本 删除 转为非保本后，不涉及

担保 删除 转为非保本后，不涉及

基金的投资 详见原基金合同 详见新基金合同 1、删除保本基金投资条款；

2、保留基金合同原先约定的投资表述所有内容，即转型为南方中证100指数证券投资基金后的投资目标、范围、策略等；

3、根据《基金法》第74条增加禁止条款。

基金资产估值 六 基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。 基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。 3位改4位

一 3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费； 转为指数基金后新增

基金的费用与税收 二 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.3\% \times \text{当年天数}$ 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.5\% \times \text{当年天数}$ 删除保本基金费率，转为非保本的费率表述

基金的收益与分配 保本周期内，保证费由基金管理人从基金管理费收入中列支。 删除 转为非保本后，不涉及

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 2\% \times \text{当年天数}$ 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$ 删除保本基金费率，转为非保本的费率表述

3、指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法支付指数使用许可费。

指数使用许可费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

转为指数基金后新增

基金的收益与分配 三 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资； 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红； 删除保本基金的分配方式，转为非保本的表述

基金的会计与审计 一 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度； 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日； 转为非保本，不涉及

基金的信息披露 五

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。 删除 转为非保本，不涉及

本基金在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细；在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

本基金在基金年报及半年报中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的流通受限证券明细。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特定风险。 增加股指期货、资产支持证券、流通受限证券、持有者集中度的信披内容

保本周期到期 详见原基金合同 删除 转为非保本后，不涉及

基金合同的变更、终止与基金财产的清算 一 （4）保本期内，更换担保人，但担保人已丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况除外； 删除 转为非保本后，不涉及

（7）变更基金类别，但保本期到期后本基金转型为南方中证100指数证券投资基金，并由此变更基金的投资目标、投资范围、投资策略的情况除外； （7）变更基金类别 转为非保本后，不涉及保本期到期后转型

（4）保本期内，增加担保人，或在担保人已丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下，更换担保人；

（5）保本期到期后本基金转型为南方中证100指数证券投资基金，并由此变更基金的投资目标、投资范围、投资策略； 删除 转为非保本后，不涉及

基金合同的效力 1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权签署人签署并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。 1、本基金由南方恒元保本混合型证券投资基金转型而来。《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以

及双方法定代表人或授权代表签字，自南方恒元保本混合型证券投资基金第三个保本期到期操作期间截止日的次日起生效。 转为非保本，说明新基金成立生效日期。