

# 南方基金管理股份有限公司

## 关于以通讯方式召开南方纯元债券型证券投资基金 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

南方基金管理股份有限公司已于 2018 年 11 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站（www.nffund.com）发布了《南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方纯元债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

### 一、召开会议基本情况

南方基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）依据中国证监会证监许可[2015]2375 号文注册募集的南方纯元债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 5 月 23 日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方纯元债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 11 月 29 日起，至 2018 年 12 月 29 日 17:00 止（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的送达地点：

地址：深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 37 层

邮政编码：518017

联系电话：0755-82763888

收件人：南方基金管理股份有限公司

请在信封表面注明：“南方纯元债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

。

### 二、会议审议事项

《关于南方纯元债券型证券投资基金调整相关要素有关事项的议案》（见附件一）。

对上述议案的说明及《基金合同》的详细修订内容请详见附件四《南方纯元债券型证券投资基金基金合同修改说明》。

### 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年11月29日，权益登记日当天下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

### 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆基金管理人网站(<http://www.nffund.com>)下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

(1) 个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件正反面复印件；

(2) 机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(3) 个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者有效身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(4) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、

商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在自 2018 年 11 月 29 日起至 2018 年 12 月 29 日 17:00 止的期间内（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至基金管理人的办公地址，请在信封表面注明：“南方纯元债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

基金管理人办公地址及联系方法如下：

地址：深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 37 层

邮政编码：518048

联系电话：0755-82763888

收件人：南方基金管理股份有限公司

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（招商银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日（即 2018 年 12 月 29 日）后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在规定截止时间之内送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金

份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定截止时间之内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

## 六、决议生效条件

1、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）；

2、《关于南方纯元债券型证券投资基金调整相关要素有关事项的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人和其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

3、直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、《基金合同》和本公告的规定，并与登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的二分之一以上(含二分之一)方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《基金法》及《基金合同》的规定，基金管理人可在规定时间内就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会，但权益登记日仍为 2018 年 11 月 29 日。

重新召集基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

#### 八、本次大会相关机构

1、召集人：南方基金管理股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦

法定代表人：张海波

成立时间：1998 年 3 月 6 日

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

2、基金托管人：招商银行股份有限公司

3、公证机构：北京市方圆公证处

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

#### 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 400-889-8899（均免长途话费）咨询。

南方基金管理股份有限公司

2018 年 11 月 30 日

附件一：

## 关于南方纯元债券型证券投资基金调整相关要素有关事项的议案

南方纯元债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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《南方纯元债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，提议对南方纯元债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）调整基金的投资范围，同时增加基金合同自动终止的条款并提高基金份额净值的估值精度。本基金需对《基金合同》修改的内容详见附件四：《南方纯元债券型证券投资基金基金合同修改说明》。

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

本议案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人或代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过。本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据本议案及《南方纯元债券型证券投资基金基金合同修改说明》对《基金合同》进行修改，并在调整前披露修改后的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件，同时基金管理人在调整前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订相关调整实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

附件二：

| 南方纯元债券型证券投资基金基金份额持有人大会<br>表决票  |   |    |    |
|--|---|----|----|
| 基金份额持有人名称  |   |    |    |
| 证件类型   | <input type="checkbox"/> 身份证/ <input type="checkbox"/> 其他（请填写证件类型）： |    |    |
| 证件号码   |   |    |    |
| 联系人  |   |    |    |
| 联系电话   |   |    |    |
| 审议事项   | 关于南方纯元债券型证券投资基金调整相关要素有关事项的议案  |    |    |
| 表决意见   | 同意  | 反对 | 弃权 |
|  |   |    |    |
| 基金份额持有人/代理人签名或盖章   |   |    |    |
| 年 月 日  |   |    |    |
| 说明：<br>1、因公证工作的需要，请您准确填写联系电话；<br>2、请以打“√”方式选择表决意见；<br>2、表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见；<br>3、必须选择一种且只能选择一种表决意见；<br>4、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合会议公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；<br><br>5、本表决票可从南方基金管理股份有限公司官方网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。 |   |    |    |



附件四：

### 南方纯元债券型证券投资基金基金合同修改说明

南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）旗下的南方纯元债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2017年5月23日成立。经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，本基金拟调整基金的投资范围并增加基金合同自动终止条款，同时根据最新的法律法规和监管要求，更新基金合同中的部分表述。需修改的合同条款列示如下：

| 章节    | 原《基金合同》条款  | 《基金合同》条款  |
|-------|--|---|
| 全文    | 中国银行业监督管理委员会   | 中国银行保险监督管理委员会   |
| 全文    | 期货   | 全文删除  |
| 释义    | 29、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 | 29、基金合同生效日：指基金管理人根据2018年X月X日基金份额持有人大会审议通过的日期，本基金的基金合同生效日为201X年X月X日  |
| 释义    | 无  | 48、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待 |
| 释义    | 无  | 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。  |
| 基金的发售 | 全章节  | 删除该部分内容   |
| 基金备案  | 全章节  | 基金合同的生效<br>一、基金合同的生效<br>本基金原基金合同于2017年5月23日正式生效。自该日起，本基金管理人正式开始管理本基金。   |

|            |   |  |
|------------|---|--|
|            |   | <p>经中国证监会 2018 年 11 月 5 日证监许可[2018]1782 号文准予变更注册，并经 2018 年 X 月 XX 日基金份额持有人大会审议通过，本基金基金合同于 201X 年 X 月 XX 日生效。</p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定</p> |
| 基金份额的申购与赎回 | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。</p> | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。</p>  |
| 基金份额的申购与赎回 | 无   | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p>   |
| 基金份额的申购与   | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>……</p> <p>当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 50%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对于其超过基金总份额 50%以上部分的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放</p>   | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>……</p> <p>当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对于其超过基金总份额 30%以上部分的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放</p>  |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 赎回         | <p>日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；如基金管理人只接受其基金总份额50%部分作为当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。</p>   | <p>日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；如基金管理人只接受其基金总份额30%部分作为当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。</p>   |
| 基金份额的申购与赎回 | <p>十七、其他业务<br/>在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。</p>   | <p>十七、其他业务<br/>在相关法律法规允许且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。</p>  |
| 基金份额持有人大会  | <p>一、召开事由<br/>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：<br/>（1）终止《基金合同》；<br/>……<br/>（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；<br/>……<br/>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：<br/>（1）调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费和其他应由基金承担的费用；<br/>……<br/>（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会以外的其他情形。</p> | <p>一、召开事由<br/>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：<br/>（1）终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；<br/>……<br/>（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费；<br/>……<br/>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：<br/>（1）调低基金销售服务费和其他应由基金承担的费用；<br/>……<br/>（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</p> |
| 基金的投资      | <p>一、投资目标<br/>本基金在有效控制风险的基础上，力求获得长期稳定的投资收益。<br/>二、投资范围<br/>本基金主要投资于国内依法发行和上市</p>  | <p>一、投资目标<br/>本基金在严格控制风险的基础上，力求获得长期稳定的投资收益。<br/>二、投资范围<br/>本基金主要投资于债券（包括国内依法</p>  |

|                     |   |  |
|---------------------|---|--|
|                     | <p>交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。本基金不投资股票、权证、可转债。</p>                                      | <p>发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不投资股票、权证、可转债。</p> |
| <p><b>基金的投资</b></p> | <p>三、投资策略</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> | <p>删除</p>  |
| <p><b>基金的投资</b></p> | <p>四、投资限制</p> <p>（2）本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>……</p> <p>（15）在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金所持</p>   | <p>四、投资限制</p> <p>（2）本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>……</p> <p>删除</p>  |

|         |   |  |
|---------|---|--|
|         | 有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%； |  |
| 基金的投资   | 五、业绩比较基准<br>中债信用债总指数  | 五、业绩比较基准<br>中债信用债总指数收益率  |
| 基金资产估值  | 二、估值对象<br>基金所拥有的债券、银行存款本息、应收款项、国债期货合约、其他投资等资产及负债。   | 二、估值对象<br>基金所拥有的债券、银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。   |
| 基金资产估值  | 三、估值方法<br>6、中国金融期货交易所上市的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。                             | 三、估值方法<br>6、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。   |
| 基金资产估值  | 四、估值程序<br>1、某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。                 | 四、估值程序<br>1、某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。 |
| 基金资产估值  | 五、估值错误的处理<br>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。                   | 五、估值错误的处理<br>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。    |
| 基金的信息披露 | 本基金在招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。                           | 删除   |
| 基金      | 3、基金托管协议是界定基金托管人和   | 3、基金托管协议是界定基金托管人和基   |

|         |   |  |
|---------|---|--|
| 基金的信息披露 | <p>基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。</p> | <p>基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>本基金的变更申请经中国证监会注册，并经基金份额持有人大会审议通过后，根据《信息披露办法》将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。</p> |
| 基金的信息披露 | <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。</p>  | 删除   |
| 基金的信息披露 | <p>《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p>   | 删除   |
| 基金的信息披露 | <p>本基金在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p>                                       | 删除   |
| 基金的信息披露 | 无   | <p>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。</p>  |
| 基金的信息披露 | 7、基金募集期延长；  | 删除   |

|   |   |  |
|---|---|--|
| <p><b>露<br/>基<br/>金<br/>的<br/>信<br/>息<br/>披<br/>露</b></p> | <p>无</p>  | <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>   |
| <p><b>基<br/>金<br/>合<br/>同<br/>的<br/>效<br/>力</b></p>       | <p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间、基金与基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>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代表签字或签章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。</p> <p>2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。</p> <p>4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</p> <p>5、《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。</p> | <p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间、基金与基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>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代表签字或签章并由中国证监会注册，经 201X 年 X 月 X 日基金份额持有人大会审议通过，自 201X 年 X 月 X 日起生效。</p> <p>2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。</p> <p>4、《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一式一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。</p> <p>5、《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。</p> |

特此说明