

南方基金管理股份有限公司关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金份额转换结果的公告

南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）于2020年9月30日至2020年10月30日以通讯方式组织召开了南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议了《关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。《议案》于2020年10月30日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本公司已于2020年10月31日发布了《南方基金管理股份有限公司关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金转型实施前的转型选择期为2020年11月2日至2020年11月27日，转型选择期结束后，以2020年11月30日为基金份额转换基准日，将南方国企改革份额的场内份额、国企改革A份额、国企改革B份额转换成南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额，南方国企改革份额的场外份额转换成南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场外份额。现将转换结果公告如下：

一、基金份额转换结果

以基金份额转换基准日南方国企改革份额的基金份额净值为基准，国企改革A份额、国企改革B份额按照各自的基金份额参考净值转换成南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额。国企改革A份额、国企改革B份额经转换后的场内份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。有关国企改革A份额、国企改革B份额基金份额转换结果如下表所示：

转换前的基金份额	转换前基金份额参考净值（元）	转换前基金份额数（份）	转换比例	转换后的基金份额	转换后基金份额净值（元）	转换后基金份额数（份）
国企改革A份额	1.0499	16,388,287.00	1.0499	南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额	1.0000	17,206,062.00
国企改革B份额	1.4563	16,388,287.00	1.4563	南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额	1.0000	23,866,262.00

南方国企改革份额的场内份额、场外份额分别自动转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额、场外份额。基金份额转换后，南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场外份额数保留到小数点后两位，余额计入基金财产；场内份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。具体如下表所示：

转换前的基金份额	转换前基金份额参考净值（元）	转换前基金份额数（份）	转换比例	转换后的基金份额	转换后基金份额净值（元）	转换后基金份额数（份）
南方国企改革份额的场内份额	1.2531	19,405,106.00	1.2531	南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额	1.0000	24,316,538.00
南方国企改革份额的场外份额	1.2531	51,653,514.35	1.2531	南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场外份额	1.0000	64,727,018.83

投资者自2020年12月3日起（含该日）可查询经本基金登记结算机构及本公司确认的转换后基金份额。由于各销售机构系统及业务安排等原因，上述转换后份额的可查询时间可能有所不同，具体以各销售机构为准。

二、重要提示

（一）《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）基金合同》《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）托管协议》自2020年12月1日起生效，原《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金托管协议》自同日起失效。自2020年12月1日起，本基金的基金名称由“南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金”变更为“南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）”，南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场外简称及场内简称仍为“改革基金”，基金代码仍为“160136”，新增的南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）C类基金份额简称为“改革基金C”，基金代码为010722。

（二）投资者持有的转换后南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A类场外份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

转换后的南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额的申购费率、赎回费率具体如下：

1、A 类基金份额场外和场内申购费率相同，如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M<200 万	0.8%
200 万≤M<500 万	0.4%
M≥500 万	每笔 1,000 元

2、本基金 A 类份额、C 类份额的场外和场内赎回费率相同，如下表所示：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<7 日	1.5%
N≥7 日	0

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的南方国企改革份额折算转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额后，其原基金份额持有期计入南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额的持有期；基金份额持有人持有的国企改革 A 份额、国企改革 B 份额折算转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额后，基金份额持有期自南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额确认之日起计算；基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费用。

（四）基金转换的特别风险揭示

1、国企改革 A 份额和国企改革 B 份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

份额转换后，国企改革 A 份额持有人原持有的国企改革 A 份额将变为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。份额转换后，国企改革 B 份额持有人原持有的国企改革 B 份额将变为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。

由于南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）为股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金和混合型基金。

2、国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的流动性风险

国企改革 A 份额和国企改革 B 份额转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额前，国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的持有人有两种方式退出：1）在场内

按市价卖出基金份额；2）在场内买入等量的对应份额（即国企改革 A 份额持有人买入等量的国企改革 B 份额，或者国企改革 B 份额持有人买入等量的国企改革 A 份额），合并为南方国企改革份额，按照南方国企改革份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

3、转换前存在溢价交易的国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前（不含基金份额转换基准日），国企改革 A 份额和国企改革 B 份额仍可正常交易。期间，国企改革 A 份额和国企改革 B 份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额转换基准日日终，国企改革 A 份额和国企改革 B 份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（www.nffund.com）等方式进行查询。

4、国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

基金份额转换基准日日终，国企改革 A 份额和国企改革 B 份额均按各自的基金份额参考净值转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，并进行取整计算（最小单位为 1 份），因此国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化。

5、国企改革 A 份额和国企改革 B 份额转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额后无法办理场内赎回的风险

国企改革 A 份额和国企改革 B 份额转换为南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。具有二级市场交易资格的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买国企改革 A 份额或国企改革 B 份额，转换为南方中证国有企业改革指数证券

投资基金（LOF）A类场内份额后可能无法办理场内赎回。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、在南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

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）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 咨询。

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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2020年12月2日