

# 关于南方人工智能主题混合型证券投资基金转换证券交易模式有关事项的公告

为了更好地为投资者提供服务,南方基金管理股份有限公司(以下简称“本基金管理人”)根据相关法律法规和《南方人工智能主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案,决定对南方人工智能主题混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)转换证券交易模式。现将具体事宜公告如下:

## 一、证券交易模式的转换

自2023年7月13日起,本基金将启动证券交易模式的转换工作。届时转换完成后,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。

本次证券交易模式的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进行审议。

二、基于上述证券交易模式的转换,《南方人工智能主题混合型证券投资基金托管协议》(以下简称“托管协议”)的个别条款进行了相应修订,具体修订内容请见本公告附件。

三、本基金证券交易模式转换的完成时间以及修订后的托管协议的生效时间将另行公告,修订后的托管协议届时将在本基金管理人官方网站(www.nffund.com)上披露。对于本公告未尽事宜,敬请投资者阅读《南方人工智能主题混合型证券投资基金基金合同》、《南方人工智能主题混合型证券投资基金招募说明书》及其更新、本基金基金产品资料概要及其更新等相关文件。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同和招募说明书及其更新等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择适合的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

投资者可访问本基金管理人官方网站(www.nffund.com)或拨打客户服务热线(400-889-8899)咨询相关情况。

特此公告

南方基金管理股份有限公司  
2023年7月13日

附件:《南方人工智能主题混合型证券投资基金托管协议》涉及本次证券交易模式转换的修订内容(具体请以届时披露的修订后的托管协议内容为准)

章节	修订前表述	修订后表述
第五部分 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>(四)基金证券账户的开立和管理</p> <p>1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。</p> <p>2、基金管理人以本基金名义在基金管理人选择的证券经营机构开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照规定向证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</p> <p>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的资金全额存放在基金管理人作为基金开立的证券资金账户中,场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的证券经营机构负责。</p> <p>3、基金证券账户的开立和使用,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未经对方同意擅自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>4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>5、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开设、使用的,按有关规定开设、使用并管理;若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。</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、基金托管人和证券经纪机构的固有财产。</p> <p>(四)基金证券账户的开立和管理</p> <p>1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。</p> <p>2、基金管理人以本基金名义在基金管理人选择的证券经营机构开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照规定向证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</p> <p>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的资金全额存放在基金管理人作为基金开立的证券资金账户中,场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的证券经营机构负责。</p> <p>3、基金证券账户的开立和使用,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未经对方同意擅自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。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。</p> <p>4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人或证券经纪机构负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。</p> <p>5、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开设、使用的,按有关规定开设、使用并管理;若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。</p>
	<p>(五)债券托管专户的开设和管理</p> <p>基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定,以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。</p>	<p>(五)债券托管专户的开设和管理</p> <p>基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定,以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。</p>

## (一) 选择代理证券买卖的证券经营机构

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代理本基金证券买卖的证券经营机构,使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,由基金管理人提前通知基金托管人。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,并将上述情况及基金专用交易单元号、佣金费率等基金基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人。因相关法律法规或交易规则的修改带来的变化以届时有效的法律法规和相关交易规则为准。

## (二) 基金投资证券后的清算交收安排

### 1、清算与交割

基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。资金汇划由基金托管人根据基金管理人的交易成交结果具体办理。

如果因为基金托管人自身原因在清算上造成基金资产的损失,应由基金托管人负责赔偿基金的损失;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,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,造成基金财产损失的由基金管理人承担;如果由于基金管理人违反法律法规、交易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,由此给基金造成的损失由基金管理人承担。

## (一) 选择代理证券买卖的证券经营机构

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,明确三

## (一) 选择代理证券买卖的证券经营机构

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,明确三

第七部分 交易及清算交收安排	<p>基金管理人应采取合理措施,确保在T+1日12:00之前有足够的资金头寸用于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。</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,基金托管资金账户或资金交收账户上有充足的资金。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,但应及时通知基金管理人。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>2、港股通证券交易及清算交收安排</p> <p>港股通交易的境内结算由基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)根据相关业务规则组织完成。香港中央结算有限公司(以下简称“香港结算”)因无法交付证券对中国结算实施现金结算的,中国结算参照香港结算的处理原则进行相应业务处理;香港结算发生破产而导致其全部履行对中国结算的交收义务的,由中国结算协助向香港结算追索,中国结算和基金托管人不承担由此产生的相关损失。</p> <p>港股通交易各项业务的收付款时点按如下约定:</p> <p>(1)交易资金</p> <p>对于T日港股通交易的清算结果为净应付的,基金管理人应保证在T+1日14:00前托管账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算,如基金的资金头寸不足,则基金托管人应按照中国结算的有关规定办理。对于T日港股通交易清算结果为净应付的,基金托管人于T+1日14:00之前扣收应付资金。</p> <p>对于T日港股通交易的清算结果为净应收的,基金托管人于T+3日上午12:00前返还应收资金。</p> <p>(2)风控资金、红利/公司收购资金、证券组合费对于T日清算的风控资金、红利/公司收购资金、证券组合费,如为净应付的,基金管理人应保证在T+1日上午10:00前托管账户有足够的资金,托管人于T+1日上午10:00扣收委托人的净应付资金。</p> <p>对于T日清算的风控资金、红利/公司收购资金,如为净应收的,托管人于T+1日上午12:00前返还应收资金。</p> <p>基金托管人负责差额缴款、按金等风控资金的计算,基金管理人应按照基金托管人的计算结果按时缴纳风控资金。</p> <p>对于遇恶劣天气等原因导致延迟交收时,若托管资产为净应付的,则仍按前述约定的时间进行扣收;若托管资产为净应收的,则交收时间视中国结算向基金托管人的支付情况确定。</p> <p>基金管理人应做好头寸管理,避免因延迟交收而导致的透支。</p> <p>由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的,由责任方承担相应的责任。</p> <p>由于基金管理人出现资金交收违约并造成基金托管人对中国结算违约的,基金托管人有权将基金管理人相当于交收违约金额的应收证券指定为暂不交付证券并由中国结算按其业务规则进行处理,由此造成的风险、损失和责任,由基金管理人承担。基金管理人出现证券交收违约的,基金托管人有权将相当于证券交收违约金额的资金暂不划付给基金管理人。</p> <p>基金管理人知晓并认可,出于降低金市场资金成本的原因,中国结算可以依照香港结算相关业务规则,将每日净卖出证券向香港结算提交作为交收担保品。</p>	<p>方在本基金参与场内证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构,并与其签订期货经纪合同,其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行,若无明确规定的,可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。</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>基金投资于证券发生的所有场外交易的清算交割,由基金托管人负责办理;基金投资于证券发生的所有场内交易的清算交割,由基金管理人选择的证券经纪机构根据相关登记结算公司的结算规则办理。本基金场内证券投资的具体操作按照基金管理人、基金托管人及证券经纪机构签署的证券经纪服务协议约定执行。</p> <p>基金托管人负责基金场外买卖证券的清算交收,场外资金汇划由基金托管人根据基金管理人的场外交易划款指令具体办理。</p> <p>证券经营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,并承担由证券经营机构原因造成的正常清算、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清算业务无法完成,责任由基金管理人承担。如果因基金托管人过错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>基金管理人应采取合理措施,确保在T+1日12:00之前有足够的资金头寸用于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清算。</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,基金托管资金账户或资金交收账户上有充足的资金。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,但应及时通知基金管理人。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>
第十一部分 基金费用	<p>(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:</p> $H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第3-10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。</p>	<p>(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:</p> $H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,托管人与管理人核对一致后,由托管人根据管理人的指令或双方约定方式,在月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,托管人与管理人核对一致后,由托管人根据管理人的指令或双方约定方式,在月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第3-10项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。</p>
	<p>(五)基金管理费和托管费的复核程序、支付方式和时间</p> <p>1、复核程序</p> <p>基金托管人对基金管理人计提的基金管理费和托管费等,根据本托管协议和基金合同的有关规定进行复核。</p> <p>2、支付方式和时间</p> <p>基金管理费和托管费每日计提,按月支付由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p>	<p>(五)基金管理费和托管费的复核程序、支付方式和时间</p> <p>1、复核程序</p> <p>基金托管人对基金管理人计提的基金管理费和托管费等,根据本托管协议和基金合同的有关规定进行复核。</p> <p>2、支付方式和时间</p> <p>基金管理费和托管费每日计提,按月支付,托管人与管理人核对一致后,由托管人根据管理人的指令或双方约定方式,在月初3个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p>