

关于南方-招行-市场中性策略 1 号资产管理计划 2012 年 12 月开放参与及退出的通知

南方-招行-市场中性策略 1 号资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2012 年 4 月 27 日成立，资产管理人为南方基金管理有限公司（以下简称“本公司”），资产托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。根据《南方-招行-市场中性策略 1 号资产管理计划资产管理合同》和《南方-招行-市场中性策略 1 号资产管理计划投资说明书》的相关约定，本计划将于 2012 年 12 月 17 日、2012 年 12 月 18 日开放退出，于 2012 年 12 月 19 日、2012 年 12 月 20 日、2012 年 12 月 21 日开放参与。现将有关事项通知如下：

一、参与和退出的场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人、招商银行股份有限公司和东吴证券股份有限公司的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。

二、参与和退出的时间

本计划将于 2012 年 12 月 17 日、2012 年 12 月 18 日开放退出，于 2012 年 12 月 19 日、2012 年 12 月 20 日、2012 年 12 月 21 日开放参与。

三、参与和退出的费用

客户在本计划存续期开放参与日参与本计划时需缴纳参与费，按参与金额采用比例费率，并采取前端收费形式。本计划的参与费率为 0.5%。

客户在本计划存续期开放退出日退出本计划，不收取退出费用。

四、参与退出的价格

本计划份额在开放日的参与和退出价格由当日计划份额净值决定。

五、参与和退出的金额限制

1、参与的金額限制

投资者首次在本资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，单笔购买金额应不低于 100.5 万元人民币（含参与费用）；资产委托人追加购买资产管理计划份额的，追加金额应为 1 万元人民币的整数倍。

2、退出的金額限制

当投资者持有的计划资产净值高于 100 万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划；选择部分退出资产管理计划的，投资者在退出后持有的计划资产净值不得低于 100

万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于 100 万元人民币。当投资者持有的计划资产净值低于 100 万元人民币（含 100 万元人民币）时，需要退出计划的，投资者必须选择一次性全部退出资产管理计划。

在符合上述规定的前提下，资产管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制。

六、参与份额和退出金额的计算

1、参与份额的计算

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 参与金额 - 净参与金额

参与份额 = 净参与金额 / 申请受理日资产管理计划份额净值

2、退出金额的计算

采用“份额退出”方式，退出价格以 T 日的计划份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

退出总金额 = 退出份额 × 退出当日计划份额净值

净退出金额 = 退出总金额 - 退出份额提取的业绩报酬

七、参与和退出的方式及程序

1、“未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2、资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3、资产委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

4、当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确

认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。正常情况下，注册登记机构在 $T+1$ 日内为资产委托人申请的有效性进行确认。资产委托人应在一个开放周期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

6、参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的款项将退回资产委托人指定资金账户。资产委托人退出申请确认后，资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项，退出款项自确认之日起 5 个工作日内划往资产委托人银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

7、资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人提前 3 个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

八、巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

资产管理计划的净份额退出申请超过上一日资产管理计划总份额的 10%，为巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分延期退出。

（1）接受全额退出：当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分延期退出：当资产管理人认为兑付资产委托人的退出申请有困难，或认为兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使计划资产净值发生较大波动时，资产管理人在当日接受退出比例不低于上一日计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个委托人申请退出份额占当日申请退出总份额的比例，确定该委托人当日受理的退出份额；未受理部分除委托人在提交退出申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有退出优先权，退出价格为下一个开放日的价格，以此类推，直到全部退出为止。若确因市场情况导致当年开放日结束时仍未完成全部退出的办理，则可进一步延期，但应于当年开放日结束后 10 个工作日内完成。

当发生退出延迟办理时，资产管理人应当及时告知资产委托人。

九、拒绝或暂停参与、暂停或延缓退出的情形及处理

1、在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

- （1）资产管理计划资产委托人达到 200 人。
- （2）根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产委托人的利益的情形。
- （3）因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产委托人利益的。
- （4）资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产委托人利益的。
- （5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时，参与款项将退回资产委托人账户。

2、在如下情况下，资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

- （1）因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。
- （3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。
- （4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时，资产管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知资产委托人。

3、在如下情况下，资产管理人可以暂停或延缓接受资产委托人的退出申请：

- （1）因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。
- （3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。
- （4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知资产委托人。在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。

十、资产管理计划的人数控制

为了确保资产管理计划人数满足备案条件，本计划将采用下列方式进行人数控制：

1、销售机构的控制办法

销售机构将通过客户预约受理序号或合同编号的方式，对参加销售的分支机构进行号码资源分配，正式签约的合同份数不得超过该销售机构分配的号码资源总数。

2、资产管理人直销的控制办法

投资者欲通过资产管理人直销网点参与，资产管理人需向销售机构申请合同号码资源，在获得销售机构的书面确认后，资产管理人直销网点可以受理该参与申请，该参与申请获得优先确认权。

若投资者通过资产管理人直销网点提交的参与申请因不满足参与条件而未被受理，资产管理人可书面通知销售机构重新使用该号码资源。

3、通过本计划注册登记机构进行控制

通过直销网点参与并获得优先确认权的参与申请，优先确认。销售机构提交的参与申请，本计划注册登记机构将按照参与申请的时间先后顺序进行确认；相同时间或无法按时间顺序确认的参与申请将按照金额大小顺序进行确认；对于按时间先后和金额大小均无法决定确认顺序的，以本计划注册登记机构确认结果为准。

对参与申请确认成功的人数达到本资产管理计划备案规定人数上限时，其后的参与申请，如为原资产委托人或已有参与申请被确认成功的投资者的追加参与申请，则予以确认，否则确认为失败。

十一、其他事项

1、本通知仅对本次开放参与和退出的有关事项和规定予以说明，其它未说明的事项遵循本计划合同和投资说明书的规定。投资者欲了解本计划的详细情况，请登陆本公司网站（www.nffund.com），阅读本计划的资产管理合同和投资说明书。

2、资产管理人可综合各种情况对本次开放参与和退出的安排做适当调整。

3、本通知解释权归资产管理人。

特此通知

南方基金管理有限公司

二〇一二年十二月十二日