

# 南方基金管理有限公司关于以通讯方式召开南方颐元债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告

## 一、召开会议基本情况

南方基金管理有限公司（以下简称基金管理人或本公司）依据中国证监会证监许可[2016]1913号文注册募集的南方颐元债券型发起式证券投资基金（以下简称本基金）于2016年9月26日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方颐元债券型发起式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2017年12月23日起至2018年1月22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：

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦32层

请在信封表面注明：南方颐元债券型发起式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

《关于南方颐元债券型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

对上述议案的说明及《基金合同》的详细修订内容请参见附件四《南方颐元债券型发起式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2017年12月22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 2017 年 12 月 23 日起至 2018 年 1 月 22 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，并在信封表面注明：南方颐元债券型发起式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。

## 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（平安银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日（即 2018 年 1 月 22 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：

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；

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；

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、《关于南方颐元债券型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》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三分之二以上（含三分之二）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2017年12月22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：南方基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

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：平安银行股份有限公司

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。

南方基金管理有限公司

2017年12月21日

附件一：

关于南方颐元债券型发起式证券投资基金转型有关事项的议案

南方颐元债券型发起式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《南方颐元债券型发起式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平安银行股份有限公司协商一致，提议对南方颐元债券型发起式证券投资基金（以下简称本基金）实施转型，将本基金变更为允许单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额达到或者超过基金总份额的50%的基金，转型后本基金不向个人投资者销售，同时调整了本基金的名称、运作方式、投资范围及本基金的管理费率等相关事宜，并根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改部分条款。

本基金转型有关事项需对《基金合同》修改的内容详见附件四：《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同修改说明》。同时根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，提议授权基金管理人在转型实施前预留不少于二十个开放日选择期供持有人选择赎回的前提下，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。在选择期期间，由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。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。在选择期期间，本基金可以暂停日常申购等相关业务。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三分之二以上(含三分之二)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《南方颐元债券型发起式证券投资

资基金基金合同修改说明》对《基金合同》进行修改，并在实施转型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，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订相关转型实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

附件二：

南方颐元债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会

表决票

基金份额持有人名称

证件类型 身份证/其他（请填写证件类型）：

证件号码

联系电话

审议事项 关于南方颐元债券型发起式证券投资基金转型有关事项的议案

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：

- 1、因公证工作的需要，请您准确填写联系电话；
- 2、请以打方式选择表决意见；
- 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；
- 3、必须选择一种且只能选择一种表决意见；
- 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。
- 5、本表决票可从南方基金管理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。

附件三：

南方颐元债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会

代理投票授权委托书

授权人名称

授权人证件类型 身份证/其他（请填写证件类型）：

授权人证件号码

授权人联系电话

授权事项

兹委托先生 / 女士/机构（证件号码：）代表本人（或本机构）参加以投票截止日为 2018 年 1 月 22 日的以通讯会议方式召开的南方颐元债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使本人/本机构于权益登记日所持有的南方颐元债券型发起式证券投资基金（以下简称本基金）全部基金份额对所有议案的表决权。

本授权委托书的有效期为委托人签字或盖章之日起至本基金基金份额持有人大会结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，以最多两次重新召开基金份额持有人大会为限，本授权继续有效。本授权不得转授权。

授权人签名或盖章

年月日

说明：

- 1、因公证工作的需要，请您准确填写联系电话；

- 2、如本次基金份额持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效；
- 3、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效；基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及基金合同要求的授权委托书。

附件四：

南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同修改说明

南方基金管理有限公司（以下简称本公司）旗下的南方颐元债券型发起式证券投资基金（以下简称本基金）成立于2016年9月26日。考虑到本基金目前单一投资者比例已经超过50%，依据中国证监会关于加强投资者集中度管理的要求，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，本基金拟申请变更为允许单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额的50%的基金，未来基金将不向个人投资者销售，同时调整了本基金的名称、运作方式、投资范围及本基金的管理费率等相关事宜，并根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改部分条款。需修改的合同条款列示如下：

章节 修订前 修订后

全文 南方颐元债券型发起式证券投资基金 南方颐元定期开放债券型发起式证券投资基金

全文 国债期货合约、国债期货、期货、期货账户 删除

前言 新增 《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

前言 三、南方颐元债券型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)注册。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 三、南方颐元定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称基金或本基金）由南方颐元债券型发起式证券投资基金变更注册而来，南方颐元债券型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)注册。

中国证监会对南方颐元债券型发起式证券投资基金募集的注册及变更注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

前言 新增 六、本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过基金总份额的50%，本基金不向个人投资者销售。

释义 1、基金或本基金：指南方颐元债券型发起式证券投资基金 1、基金或本基金：指南方颐元定期开放债券型发起式证券投资基金，本基金由南方颐元债券型发起式证券投资基金变更注册而来

释义 7、基金份额发售公告：指《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》 删除

释义 新增 12、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

释义 18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内证券市场的中国境外的机构投资者 18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

释义 20、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称 20、投资人：指机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称，本基金不向个人投资者销售

释义 28、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 28、基金合同生效日：指基金管理人根据201X年X月X日基金份额持有人大会审议通过的《关于南方颐元债券型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》确定并公告的基金正式实施转型的日期，本基金的基金合同生效日为201X年X月X日

释义 31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

31、存续期：指《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限

释义 35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

35、开放期：本基金开放申购、赎回等业务的期间。本基金自基金合同生效后，每 3 个月开放一次，每个开放期为基金合同生效日所在月份在后续每 3 个日历月之后下一月的前 5 个工作日。在此期间，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额

36、封闭期：本基金首个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易

37、开放日：指开放期内为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

释义 38、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为 40、认购：指在基金募集期内，投资人根据《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同》和《南方颐元债券型发起式证券投资基金招募说明书》的规定申请购买基金份额的行为

41、申购：指基金合同生效后的开放期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、赎回：指基金合同生效后的开放期内，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

释义 44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10% 46、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的 20%

释义 新增 48、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

49、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 51、发起式基金：指符合《运作办法》和中国证监会规定的相关条件而募集、运作，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

52、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

53、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员 55、发起式基金：指符合

《运作办法》和中国证监会规定的相关条件而募集、运作，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外的投研人员，下同）等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

56、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不低于三年

57、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

基金的基本情况 三、基金的运作方式

契约型开放式 三、基金的运作方式

契约型开放式

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

本基金自基金合同生效后，每 3 个月开放一次申购和赎回，每个开放期为基金合同生效日所在月份在后续每 3 个日历月之后下一月的前 5 个工作日。在此期间，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额。

本基金首个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

基金的基本情况 四、基金的投资目标

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。 四、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。

基金的基本情况 五、基金的最低募集金额

本基金为发起式基金，其中，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于 1000 万元人民币，且持有期限不少于 3 年，法律法规和监管机构另有规定的除外。

六、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。 删去

基金的基本情况 新增 七、其他事项

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过基金总份额的 50%，本基金不向个人投资者销售。

基金份额的发售 第四部分基金份额的发售

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

（详见《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同》） 删除

基金备案 第五部分基金备案

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，使用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元，且发起资金认购方承诺认购的基金份额持有期限不少于 3 年的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 第四部分基金的历史沿革和存续

#### 一、本基金的历史沿革

本基金由南方颐元债券型发起式证券投资基金变更注册而来。南方颐元债券型发起式证券投资基金经中国证监会 2016 年 8 月 23 日证监许可[2016]1913 号文注册募集。募集期从自 2016 年 9 月 19 日至 2016 年 9 月 22 日止，共募集 110,001,111.32 份基金份额，募集户数为 2 户。募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 26 日生效。

经中国证监会 2017 年 12 月 13 日证监许可[2017]2296 号文准予变更注册，并经 201X 年 X 月 X 日基金份额持有人大会审议并通过《关于南方颐元债券型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，南方颐元债券型发起式证券投资基金于 xx 年 xx 月 xx 日正式实施转型，本基金合同生效日为 201X 年 X 月 X 日。

转型后，本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过基金总份额的 50%，本基金不向个人投资者销售。

转型后，发起资金提供方认购的基金份额持有期限自本基金的基金合同生效日起不少于三年，法律法规和监管机构另有规定的除外。

#### 基金备案 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

《基金合同》生效满 3 年后，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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

《基金合同》生效满 3 年后，连续 20 个工作日出现基金资产净值低于 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，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

#### 基金份额的申购与赎回 二、申购和赎回的开放日及时间

##### 新增 二、申购和赎回的开放日及时间

##### 1、基金份额的开放期和封闭期

本基金自基金合同生效后，每 3 个月开放一次，每个开放期为基金合同生效日所在月份在后续每 3 个日历月之后下一月的前 5 个工作日。在此期间，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额。

本基金首个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

开放期内申购、赎回等业务的具体规则以基金管理人届时公告为准。如封闭期后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购或赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直到满足开放期的时间要求，具体时间以基金管理人届时公告为准。

##### 基金份额的申购与赎回 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎

回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 2、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为开放期内上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。封闭期内，本基金不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 基金份额的申购与赎回 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

## 3、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换等申请的，视为无效申请。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

## 基金份额的申购与赎回 四、申购与赎回的程序

### 3、申购和赎回申请的确认

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

## 四、申购与赎回的程序

### 3、申购和赎回申请的确认

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构已经接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制

### 新增 五、申购和赎回的数量限制

2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

## 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、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。

5、具体见招募说明书。

#### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

5、具体见招募说明书。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

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。

#### 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

新增

发生上述第1、2、3、5、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

七、拒绝或暂停申购的情形 开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

2、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

8、个人投资者申购。

发生上述第1、2、3、4、6、7、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停申购情形的，开放期将按因不可抗力等原因而暂停申购的时间相应延长，直至满足开放期时间要求。

#### 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

2、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

4、删除

若出现巨额赎回情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停赎回情形的，开放期将按因不可抗力等原因而暂停赎回的时间相应延长，直至满足开放期时间要求。

#### 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即

认为是发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

## 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式（包括但不限于短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式）在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付赎回款项或延期办理赎回申请。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当接受并确认所有的有效赎回申请，当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的百分之二十，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

(3) 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 80%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 80%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日赎回申请一并处理，基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理，但若在开放期最后一日发生上述情形的，超过部分将视为无效赎回申请。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回延缓支付赎回款项时，基金管理人应当在指定媒介上刊登公告。

基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

法定代表人：吴万善

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

法定代表人：张海波

基金合同当事人及权利义务 (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利及债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

基金合同当事人及权利义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(2) 办理基金备案手续；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人； 2、

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(2) 办理基金注册或备案手续；

删除

基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

法定代表人：孙建一

注册资本：伍拾壹亿贰仟叁百叁拾伍万零肆佰壹拾陆元整 二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

法定代表人：谢永林

注册资本：人民币 17,170,411,366 元

基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(9) 发起资金提供方持有认购的基金份额不少于 3 年； 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(9) 发起资金提供方持有认购的基金份额自基金合同生效日起不少于 3 年；

基金份额持有人大会 一、召开事由

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，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：

(4) 转换基金运作方式；

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：

(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以外的其他情形。 一、召开事由

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，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：

(4) 转换基金运作方式（不包括本基金封闭期与开放期的转换）；

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：

(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。

基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 三、原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取基金管理费或基金托管费。 三、原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。

基金的投资 二、投资范围

本基金主要投资于国内依法发行上市交易的国债、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、政府机构债券、地方政府债券、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的纯债部分、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）、同业存单、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。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。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。本基金不投资股票、权证、可转债。

## 二、投资范围

本基金主要投资于国内依法发行上市交易的国债、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、政府机构债券、地方政府债券、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的纯债部分、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）、同业存单、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。本基金不投资股票、权证，可转债仅投资可分离交易可转债中的纯债部分。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内，本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，封闭期内不受上述 5%的限制。

## 基金的投资 三、投资策略

### 6、国债期货投资策略

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。

### 6、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

## 基金的投资 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）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；
- （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；
- （11）基金总资产不超过基金净资产的 140%；

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）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，可转债仅投资可分离交易可转债中的纯债部分；应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金开放期开始前 10 个工作日、开放期以及开放期结束后的 10 个工作日内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制；
- （2）开放期内，本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，封闭期内

不受上述 5%的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(11) 开放期内，基金总资产不得超过基金净资产的 140%；封闭期内，本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 200%；

基金的投资 (13) 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%； 删除

基金的投资 新增

(13) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

基金的投资 除上述第(9)项另有约定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的 除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项另有约定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的

基金的投资 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

六、风险收益特征

本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

基金的投资 七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理； 七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

删除

基金资产估值 三、估值方法

5、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

删除并新增：

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 六、暂停估值的情形

新增 六、暂停估值的情形

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金应当暂停估值；

基金费用与税收 一、基金费用的种类

新增 一、基金费用的种类

10、基金财产投资运营过程中的增值税；

基金费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

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 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.5\%$ 当年天数

上述一、基金费用的种类中第3—8、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。

#### 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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.3\%$ 当年天数

上述一、基金费用的种类中第3—8、10、11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。

基金费用与税收 三、不列入基金费用的项目

3、《基金合同》生效前的相关费用； 三、不列入基金费用的项目

3、《南方颐元债券型发起式证券投资基金基金合同》生效前的相关费用；

基金的会计与审计 一、基金会计政策

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披露； 一、基金会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；

基金的信息披露 五、公开披露的基金信息

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载其在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供说明。

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。

五、公开披露的基金信息

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在其网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供说明。

删除

基金的信息披露 3、基金托管协议是界定基金托管人和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。

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。 3、基金托管协议是界定基金托管人和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。

基金的变更申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金正式实施转型前，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。

基金的信息披露 （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。

《基金合同》生效公告中应说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。 删除

基金的信息披露 (四) 基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过其网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。 (二) 基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个工作日的次日,通过其网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露工作日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金的信息披露 (六) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

《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。

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。 (四) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金运作期间,如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在基金定期报告影响投资者决策的其他重要信息项下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有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

基金的信息披露 (七) 临时报告

7、基金募集期延长;

21、本基金开始办理申购、赎回;

23、本基金发生巨额赎回并延期办理;

24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请; (五) 临时报告

删除

20、本基金进入开放期;

22、本基金在开放期发生巨额赎回并延缓支付赎回款项;

23、本基金暂停接受赎回申请;

26、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

基金的信息披露 (十) 中国证监会规定的其他信息。

(八) 中国证监会规定的其他信息。

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和招募说明书(更新)中充分披露基金的相关情况并揭示相关风险,说明该基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过基金总份额的 50%,基金不向个人投资者公开销售。

基金合同的效力 《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。

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。《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

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。

特此说明。