开元证券投资基金召开基金份额持有人大会的第三次提示性公告

南方基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2012年11月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.cn）及基金管理人网站（www.nffund.com）发布了《开元证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》，并于2012年12月4日、2012年12月12日和2012年12月14日在上述报纸和网站上分别发布了《开元证券投资基金召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告》、《关于开元证券投资基金份额持有人大会召开时间调整的公告》和《开元证券投资基金召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现将具体事宜再次提示如下：

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《开元证券投资基金基金合同》的有关规定，开元证券投资基金（以下简称“本基金”或者“基金开元”）的基金管理人南方基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以现场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、会议召开时间：2013年1月4日14时30分。

2、会议召开地点：北京洲际酒店（北京西城区金融街11号）。

3、会议召开方式：现场方式。

二、会议审议事项

《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

三、会议的议事程序和表决方式

1、大会主持人宣布会议开始；

2、大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有表决权的总数、占权益登记日基金总份额的比例；

3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；

4、大会主持人公布计票人、监票人、公证机关和公证员姓名、见证律师；

5、大会主持人宣读议案；

6、与会人员对议案进行审议，并进行表决；

7、计票人在基金份额持有人表决后立即进行清点，监票人对此进行监督，公证机关对计票过程予以公证；

8、大会主持人当场公布计票结果；

9、大会公证机关就本次会议召开的程序以及持有人大会形成的决议的合法性、合规性进行公证；

10、见证律师发表意见。

四、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2012年12月4日，即在2012 年12月4日深圳证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司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会。

五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件和材料

1、个人基金份额持有人出席会议的，需要提交本人开立持有本基金基金份额的证券账户（深交所A股账户或深交所证券投资基金账户，下同）所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

2、机构基金份额持有人出席会议的，需要提交该机构开立持有本基金基金份额的证券账户所使用的加盖单位公章的企业营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表单位出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件及单位授权委托书（单位法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明书）。

3、委托他人出席本次大会的，还应按照本公告第六条的规定，提供相关资料。

六、授权

本基金的基金份额持有人如不能亲自出席本次大会，可以通过以下方式授权他人代为出席本次大会。

（一）纸面授权方式

1、个人基金份额持有人委托他人出席会议

个人基金份额持有人委托他人出席会议的，需要提交基金份额持有人签字的授权委托书（内容及格式参考本公告附件二）和基金份额持有人开立持有本基金基金份额的证券账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件。

如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（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），和代表单位出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件及单位授权委托书（授托人法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明书）。

2、机构基金份额持有人委托他人出席会议

机构基金份额持有人委托他人出席会议的，需要提交加盖公章的授权委托书（内容及格式参考本公告附件二）和基金份额持有人开立持有本基金基金份额的证券账户所使用的加盖单位公章的企业营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（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），和代表受托机构出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件及单位授权委托书（受托人法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明书）。

如果受托人为本基金的基金管理人或销售机构，其将在取得基金份额持有人签署的授权委托书后统一办理授权手续（包括提供受托人上述证明文件）。

（二）电话授权方式

为方便基金份额持有人参与本次大会，基金管理人特开设录音电话授权方式，基金管理人和部分销售机构将通过各自的客服代表与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由客服代表根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

（三）短信授权方式

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供短信通道供基金份额持有人进行授权。 基金管理人和本基金的部分销售机构将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集授权短信，持有人回复短信表明授权意见。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。

（四）网络授权方式

为方便基金份额持有人授权，基金管理人在网站设立授权专区，基金份额持有人可通过登录基金管理人网站www.nffund.com授权专区，通过网络进行授权。

通过网络进行授权的基金份额持有人，应正确填写姓名、证件号码等信息，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过网络授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

（五）授权权力确定原则

1、如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

2、如果同一基金份额在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。

3、如果同一基金份额存在多次以有效纸面授权的，以受托人收到的最后一次纸面授权为准；不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，授权相同的，按照该相同的授权计票；授权不一致的，视为弃权。

4、如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在有效的其他非纸面方式授权的，以有效的其他非纸面方式的授权为准；

5、如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项，以表示具体表决意见的授权为准；最后时间收到的多次授权其授权表示一致的，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

6、如果委托人在授权委托书中明确其表决意见的，将以委托人的表决意见为准；如果授权委托书中未明确委托人的表决意见的，即视为授权受托人按照受托人的意志全权行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

（六）授权资料送达的地址和时间

纸面授权资料请于2012年12月31日17:00之前送达至如下地址：深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦32层，邮编：518048，收件人：南方基金管理有限公司。封面请注明“基金开元转型”。

七、会议出席对象

1、2012年12月4日（权益登记日）下午交易时间结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体持有人或其代理人均有权参与本次会议的表决。

2、基金管理人代表。

3、基金托管人代表。

4、基金管理人聘请的公证机关人员。

5、基金管理人聘请的见证律师。

八、基金份额持有人大会预登记

1、现场方式预登记

（1）个人基金份额持有人出席会议的，需要提交本人开立持有本基金基金份额的证券账户（深交所A股账户或深交所证券投资基金账户，下同）所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

（2）机构基金份额持有人出席会议的，需要提交该机构开立持有本基金基金份额的证券账户所使用的加盖单位公章的企业营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表单位出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件及单位授权委托书（单位法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明书）。

（3）委托他人出席本次大会的，还应按照本公告第六条的规定，提供相关资料。

现场预登记地址：北京市西城区武定侯街6号卓著中心1603室；联系人：宁军

2、传真方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人可凭上述资料的传真件向基金管理人进行预登记，传真号码010-66573868（确认电话为010-66575012）、传真号码0755-83887663（确认电话为0551-3815370）、传真号为0755-82763900（确认电话为0755-82763875）。

3、预登记时间：2012年12月5日-2012年12月28日，每天上午9:00-下午5:00（周六、周日及法定节假日除外），基金管理人将为基金份额持有人办理现场预登记或传真方式预登记。

4、关于预登记的说明：基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况，以便为持有人大会召开进行相应准备。持有人大会会议入场前仍需按照本公告第五条的规定提供相应资料办理现场会议登记，请各基金份额持有人予以积极配合。

九、会议召开的条件

1、对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当大于代表权益登记日基金总份额的50%（不含50%）；

2、到会的基金份额持有人身份证明、代理人身份证明及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且与基金管理人持有的登记资料相符。

十、形成基金份额持有人大会决议的条件

1、基金份额持有人所持的每份基金份额有一票表决权。

2、基金份额持有人或代理人在表决票上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。未填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持份数的表决结果均计为“弃权”。

3、《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》应当由出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的2/3以上通过（不含2/3）。

十一、重要提示

本次会议将于2013年1月4日下午14时30分召开，届时基金管理人、基金托管人、基金管理人聘请的公证机关人员以及见证律师将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件提前半小时至会议地点，以便验证入场。主持人宣布会议开始后，不再对未登记的基金份额持有人进行登记，未登记的持有人不得入场参加会议。

基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人（或代理人）、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场，对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

特别提醒各位基金份额持有人在进行预登记及会议现场登记时，需要提供的是开立持有本基金基金份额的证券账户所使用的身份证件及（或）其复印件，如若开立有多个账户且使用的是不同的身份证件，需要分别提供各账户对应的身份证件及（或）其复印件。

本基金自2012年12月5日开始停牌。基金管理人将于基金份额持有人大会决议公告后向深圳证券交易所申请复牌。

基金管理人将在基金份额持有人大会召开前发布提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

十二、持有人大会联系方式

1、南方基金管理有限公司

个人客户联系人：姚婷婷

联系电话：0551-3815370

传真：0755-83887663

机构客户联系人：崔宏玮

联系电话：0755-82763875

传真：0755-82763900

2、南方基金管理有限公司北京分公司

联系人：宁军

联系电话：010-66575012

传真：010-66573868

3、南方基金管理有限公司全国客服电话：400-889-8899

4、南方基金管理有限公司网站：www.nffund.com

南方基金管理有限公司

2012年12月24日

附件一：

关于开元证券投资基金转型有关事项的议案

基金开元份额持有人：

鉴于开元证券投资基金将于2013年3月27日到期，为了消除基金到期及折价的影响，维护基金持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《开元证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国工商银行协商一致，提议对基金开元实施转型。《基金开元转型方案说明书》见附件三。

为实施基金开元转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金开元转型的有关具体事宜，并可以在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对《开元证券投资基金基金合同》等法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

南方基金管理有限公司

2012年11月27日

附件二：

授权委托书

兹委托　　先生/女士/机构代表本人（或本机构）出席于　　年　月　日召开的开元证券投资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开元证券投资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开元证券投资基金基金份额持有人大会结束之日止。若开元证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，以最多两次重新召开持有人大会为限，本授权继续有效。本人（或本机构）同意被授权人转授权，转授权仅限一次。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码：

受托人：

受托人证件号码：

委托日期：　年　月　日

附注：1、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。

2、本授权委托书中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人在其开立持有开元证券投资基金的证券账户（A股账户或证券投资基金账户）所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）号码。

3、基金份额持有人开立持有开元证券投资基金的证券账户（A股账户或证券投资基金账户）为多个的，若仅以其中部分证券账户所持有的开元证券投资基金份额授权受托人参会和投票的，应当注明该证券账户号码。若不注明的，视为授权受托人就其全部证券账户所持有的开元证券投资基金份额参会和进行投票。

4、本授权委托书中委托人所持基金的份额以持有人大会权益登记日为准。如届时委托人不再持有本基金基金份额，则本授权委托书自动失效。

附件三：

基金开元转型方案说明书

一、说明

（一）鉴于开元证券投资基金（以下简称“基金开元”）将于2013年3月27日到期，为了消除基金到期及折价的影响，维护基金持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《开元证券投资基金基金合同》有关规定，经基金管理人与基金托管人中国工商银行协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论关于基金开元转型有关事项的议案。

（二）本次基金开元转型方案需经参加相关持有人大会表决的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过，存在无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

（三）持有人大会表决通过的事项需报告中国证监会，自中国证监会核准之日起生效。中国证监会对本次基金开元转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或者投资者的收益做出实质性判断和保证。

二、基金开元封转开方案概要

拟主要通过以下几方面的转换、调整，将基金开元从封闭式基金转型为交易型开放式基金。

（一）转换基金运作方式

基金开元由封闭式基金转型为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“沪深300ETF”），在完成有关转型程序后，本基金将上市交易并开放申购、赎回等业务。

（二）调整基金存续期限

基金存续期由2013年3月27日到期调整为无限期。

（三）授权基金管理人向深圳证券交易所申请终止或提前终止基金开元的上市交易；转型为交易型开放式基金，在集中申购结束后1个月内开放申购赎回业务，如符合上市条件，向深圳证券交易所申请上市交易。在沪深300ETF上市交易后，持有人可以利用原有的深圳证券交易所证券账户或者证券投资基金账户进行二级市场交易，也可以根据交易型开放式基金的有关业务规则进行申购赎回。

（四）更名及代码

基金名称由“开元证券投资基金”更名为“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金”。

基金代码也将由184688根据深圳证券交易所规则调整为交易型开放式基金的代码。

（五）调整基金的投资

基金开元原基金合同中约定了投资目标、投资范围、投资决策、投资组合和投资限制。对原有的内容进行调整了，并新增了基金的业绩比较基准、风险收益特征、基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法及基金的融资融券部分。

原基金合同的内容为：

1、投资目标

本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

2、投资范围

本基金的投资范围仅限于国内依法公开发行、上市的债券和股票及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。

3、投资决策

（1）决策依据

①国家宏观经济环境是本基金投资决策的基础；

②国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

③投资对象的收益和风险。在作出投资决策前充分权衡投资对象的收益和风险是维护投资者利益的保障。

（2）决策程序

本基金的管理人内部设立市场研究开发部和基金管理部以及由总经理及相关人员组成的投资决策委员会。投资决策程序如下：

①市场研究开发部专门从事证券市场和宏观经济金融环境的研究，其职责是分析各项投资的可行性，为投资决策委员会提供决策依据；市场研究开发部应建立健全的研究报告制度，为投资决策委员会提供较为切实可行的投资计划。

根据研究工作的方法和范围的差别，研究工作分成两部分：基本分析和市场分析。

基本分析是投资的主要依据，只有把握住基本分析，市场分析才有意义。因此这是研究工作的重点。基本分析包括宏观分析、行业分析、企业分析。

宏观分析：主要是对经济增长率、通货膨胀率、利率、失业率、投资增长率、汇率、储蓄率、税率、财政收支、对外贸易情况、资本流动情况等分析。

行业分析：主要包括国家产业政策、行业地位、行业平均利润率、行业发展前景、行业景气周期等分析。

企业分析：进行企业分析的首要工作是进行企业调研，然后根据调研结果和企业年度报告做出分析。

市场分析包括技术分析和投资心理分析。市场分析主要是根据市场以往的走势进行分析，从技术上提供确定投资组合的重要依据。其主要工作包括：根据市场的历史走势、波浪理论及各项技术指标判断其趋势；根据市场的阶段特征，掌握其阶段性热点。市场分析人员每周做一份简报，每月做一份分析报告，另根据市场的突发事件及时提供报告。每一份报告都以书面形式完成。

②投资决策委员会审议和决定基金的各项投资活动

投资决策委员会为非常设议事机构，由公司总经理及相关人员组成，其功能是为基金投资拟订原则、制定计划和全面部署。该委员会将定期召开会议，如遇紧急情况亦可召开临时会议。主要工作为确定股票投资、国债投资的比例，确定资产分散的程度和各项投资的比重。

投资决策委员会对于市场研究开发部所提供的研究报告应认真加以分析，根据现行法律法规以及基金合同的有关规定，作出投资决策。

③基金管理部根据投资决策委员会制定的投资原则和方向，参考市场研究开发部的行业、企业分析报告，制定国债和股票投资组合。

④风险控制委员会审核基金投资组合

风险控制委员会是由总经理及相关人员组成的非常设议事机构，其定期召开会议，对基金投资组合进行风险评估，并根据风险控制的要求作出适当调整。

4、投资组合

（1）本基金的投资组合必须符合以下规定：

①本基金80%投资于股票，20%投资于国债；

②持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的10%，本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的10%；

③遵守中国证监会规定的其他比例限制；

（2）本基金投资组合的原则

本基金的投资组合应根据市场的变化和风险程度来决定，本着安全性、收益性的原则调整投资组合中的证券构成。

5、投资限制

本基金投资范围仅限于国内依法公开发行、上市的债券和股票及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。

本基金禁止从事下列行为：

（1）投资于其他基金；

（2）将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；

（3）从事证券信用交易；

（4）以基金资产进行房地产投资；

（5）从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

（6）将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

（7）中国证监会规定禁止从事的其他行为。

调整后表述如下：

1、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

2、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

（1）投资策略

本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

（2）投资管理体制和程序

①决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

②投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

③投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

研究支持：指数化投资团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

投资决策：投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

投资绩效评估：投资绩效评估：指数化投资团队定期或不定期对基金进行投资绩效评估，以确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在《招募说明书》中列示。

4、投资组合管理

（1）构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、适当替代和逐步购入。

本基金采取复制法确定目标组合，其投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。

（2）日常投资组合管理

①可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪，分析其对指数跟踪的影响。

②投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合调整方案，并利用自动化指数交易系统调整投资组合，以实现更好的跟踪标的指数的目的。

③制作并公布申购、赎回清单：以T日标的指数权重为基础，考虑T日可能发生的上市公司变动情况，设计T日的申购赎回清单并公告。

（3）定期投资组合管理

基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：

①定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案并实施；

②根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案并实施；

③根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

④投资绩效评估

①定期对基金的绩效评估进行，主要是对跟踪偏离度进行评估；

②指数化投资团队对本基金的运行情况进行量化评估；

③基金经理根据量化评估报告，重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的，基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本，以及税务及其他监管限制，决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更，本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在指定媒体公告，并阐明变更复制方法的原因。

5、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

①在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的100%；

②本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

③本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

④本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

⑤基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

⑥本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

①承销证券；

②向他人贷款或者提供担保；

③从事承担无限责任的投资；

④买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

⑤向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券，但在法律法规或监管机构允许的情况下，标的指数成份股除外；

⑥买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，但在法律法规或监管机构允许的情况下，标的指数成份股除外；

⑦从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

⑧依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

6、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为沪深300指数。

如果指数编制单位变更或停止沪深300指数的编制、发布或授权，或沪深300指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为沪深300指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

7、风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

8、基金管理人代表基金行使股东权利及债权人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；

（2）有利于基金资产的安全与增值；

（3）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

（4）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（5）不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

9、基金的融资融券及转融通

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会。

（六）调整费率及费率结构

1、调整管理费和托管费

（1）年管理费率由1.5%调整为0.5%

（2）年托管费率由0.25%调整为0.1%

2、调整前无指数费，调整后新增指数许可使用费，即基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；

3、调整前无申购赎回费，调整后为：

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

（七）调整基金的收益分配

调整前为：

1、基金收益的构成

（1）基金投资所得红利、股息、债券利息；

（2）买卖证券价差；

（3）存款利息；

（4）其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

2、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

3、收益分配原则

（1）基金收益分配采取现金方式，每年至少一次；

（2）基金年度收益分配比例不得低于基金年度已实现收益的90%；

（3）基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

（4）基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

（5）每一基金单位享有同等分配权。

4、收益分配方案

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

5、收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

调整后为：

1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

（1）当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

（2）本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

（3）在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多12次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

（4）本基金收益分配采取现金分红方式；

（5）《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（6）每一基金份额享有同等分配权；

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

6、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

（八）授权基金管理人修订基金合同

基金管理人提请持有人大会授权修改基金合同，主要基于：

首先，由于基金开元拟转换运作方式、调整存续期限、终止上市交易并调整投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方案，基金管理人需根据持有人大会决议以及转换后基金运作方式的特点相应修订基金合同的相关内容。

第二，考虑到自基金合同生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规陆续颁布、实施和修改，基金管理人需要根据法律法规修订基金合同的相关内容。

第三，考虑到基金开元变更投资目标、投资范围和投资策略后，基金风险收益特征和产品类型发生相应变更，基金管理人拟将基金名称变更为“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金”，同时《开元证券投资基金基金合同》将变更为《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金》。

第四，本次基金份额持有人大会的议案及具体转型方案经基金份额持有人大会通过并依法生效后，将作为基金开元转型的合法依据之一，基金管理人需要根据该议案及具体转型方案内容修订和增加基金合同的其他相关内容。

综上所述，提请基金份额持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订基金合同的内容。基金管理人完成基金合同内容修订并经基金托管人审核同意后，报中国证监会核准。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一