（上接B023版）

兹委托 先生/女士/机构代表本人（或本机构）出席南方沪深300指数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南方沪深300指数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南方沪深300指数证券投资基金份额持有人大会结束之日止。若南方沪深300指数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；基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。

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南方沪深300指数证券投资基金的南方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）号码或该证件号码的更新。

3、基金份额持有人开立持有南方沪深300指数证券投资基金的南方基金账户为多个的，若仅以其中部分账户所持有的南方沪深300指数证券投资基金份额授权受托人参会和投票的，应当注明该账户号码。若不注明的，视为授权受托人就其全部账户所持有的南方沪深300指数证券投资基金份额参会和进行投票。

4、如本次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。

附件三：

南方沪深３００指数证券投资基金基金合同修改说明

鉴于南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同已经生效，该基金与基金管理人现已管理的南方沪深300指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的标的指数相同，且具备由于实物申赎所带来的跟踪紧密等优势，为优化本基金的投资成本，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》等法律法规的规定和《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议变更本基金的投资范围及相关事项，将本基金变更为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，允许本基金投资股指期货，参与融资融券及转融通业务。基于上述投资范围的变更，相应地对《基金合同》中有关本基金的名称、基金份额的申购和赎回、投资、资产估值、费用、基金份额持有人大会及其他部分条款，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改，需修改的合同条款列示如下：

一、将基金合同的名称由“《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》”变更为“《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》”。

二、将基金合同中本基金名称由“南方沪深300指数证券投资基金”变更为“南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，涉及本基金名称表述的条款相应修改。

三、第1章 前言和释义

1、删除“发售公告”、“募集期”、“认购”和“发售”的定义；

2、将原“基金合同生效日”的定义修改为：

“基金合同生效日 指《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效起始日，原《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》自同一日起失效”

3、根据监管机关的规定，增加相关术语的定义，增加的相关术语的定义如下：

“登记结算业务实施细则 指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及其不时修订

交易型开放式指数基金 指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的交易型开放式指数基金，即是指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券、现金等基金合同约定的对价进行申购、赎回，并在深圳证券交易所上市交易

目标ETF 指南方基金管理有限公司管理的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金（简称沪深300ETF）ETF联接基金 是指将其绝大部分基金份额用于投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金

四、第2章 基金的基本情况

调整了“二、基金的类别”和“四、基金的投资目标”的表述，删除了第五条“基金的最低募集份额总额”，同时增加了“九、标的指数和业绩比较基准”和“九、目标ETF及联接基金”的表述，具体内容如下：

1、本章第二条“基金的类别”内容修改为：“股票型证券投资基金、联接基金”

2、本章第四条“基金的投资目标”内容修改为：“本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。”

3、本章删除第五条“基金的最低募集份额总额”全部内容，后续条款的序号相应调整。

4、本章增加第七条“标的指数和业绩比较基准”，具体内容为：

“本基金的指数为沪深300指数。

本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。”

5、本章增加第八条“目标ETF及联接基金”，具体内容为：

“本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：

①在投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

②在交易方式方面，投资者既可以在二级市场买卖目标ETF，也可以按照申购赎回清单的要求，采用份额申购和份额赎回的方式申赎目标ETF；而本基金的申购与赎回则与普通的开放式基金类似，通过基金管理人及代销机构按未知价法采用金额申购、份额赎回的方式进行。

③价格揭示机制不同。目标ETF有实时市场交易价格和每日净值；本基金只揭示每日基金净值。

④申购赎回方式不同。目标ETF的投资人依据申购赎回清单，按以组合证券为主的申购对价、赎回对价进行申购赎回，申购赎回均以份额申报；本基金的投资人依据基金份额净值，以现金方式进行申购赎回，金额申购、份额赎回。

本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：

①法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。

②申购赎回的影响。目标ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申购赎回采用现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

③投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。”

五、第3章 基金份额的发售

本章标题修改为：“基金的历史沿革与存续”，全部内容修改为：

“一、本基金的历史沿革

南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金由南方沪深300指数证券投资基金通过基金合同修订变更而来。

南方开元沪深300指数证券投资基金经中国证监会《关于同意南方沪深300指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]127号文）核准募集，基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

南方沪深300指数证券投资基金自2009年3月4日至2009年3月20日进行公开募集，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，《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》于2009年3月25日生效。

2011年2月18日，南方基金管理有限公司管理的开元证券投资基金正式转型为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）。2013年4月17日南方沪深300指数证券投资基金以现场会议方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于南方沪深300指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》，同意将南方沪深300指数证券投资基金变更为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金，允许本基金投资股指期货，参与融资融券及转融通业务，并基于上述投资范围的变更，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、基金份额的申购和赎回、投资、资产估值、费用、基金份额持有人大会及其他部分条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决议事项已经中国证监会于2013年XX月XX日核准生效，自该日起，《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，并取代《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》，南方沪深300指数证券投资基金正式变更为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。”

六、删除第4章“基金备案”所有内容，余下章节的序号相应调整。

七、第5章 基金份额的申购和赎回

根据本基金基金份额净值计算的调整及本基金变更投资范围后因投资目标ETF而导致本基金可能发生的暂停申购赎回情况，对基金合同进行修改，具体修改内容如下：

1、删除本章第二条“申购与赎回的开放日及时间”中的“本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。”

2、本章第九条“拒绝或暂停申购的情形及处理方式”，在第（4）款之后增加如下内容：

“⑤目标ETF暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

⑥目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形；

⑦发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请；”

其余条款的序号相应调整。

3、本章第十条“暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”，在第（4）款之后增加如下内容：

“⑤目标ETF暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

⑥目标ETF暂停赎回或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形；

⑦发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；”

其余条款的序号相应调整。

八、第6章 基金合同当事人及权利义务

根据本基金变更投资范围后因投资目标ETF而导致基金管理人和基金份额持有人的权力增加，对基金合同进行修改，具体内容如下：

1、本章第一条第（二）款第1项“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：”，增加第（16）项“经与基金托管人协商一致，代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标ETF所产生的权利”，其余项目序号相应调整。

2、本章第三条第1款“根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：”，增加第（6）项“出席或者委派代表出席目标ETF份额持有人大会，对目标ETF份额持有人大会审议事项行使表决权。本基金参会份额和票数按权益登记日本基所持有的目标ETF份额占本基金资产的比例折算”，其余项目序号相应调整。

3、本章第三条第2款“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：”中第（1）项“遵守《基金合同》”，修改为：

“（1）认真阅读并遵守《基金合同》；

②了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

③关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；”

其余项目序号相应调整。

九、第7章 基金份额持有人大会

根据监管机构对联接基金的监管要求，对本基金基金份额持有人大会的召开事由进行补充，并增加了本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面的联系，具体修改条款如下：

1、本章第一条第1款“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”，将原“⑧变更基金投资目标、范围或策略”修改为：“⑧变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或目标ETF基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略的情况除外”；增加“⑬基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会”，其余项目序号相应调整。

2、本章第一条第2款“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”，将原“⑨在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式”；增加“⑩由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或目标ETF基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略”和“⑪经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则”，其余项目序号相应调整。

3、本章第三条第1款，“召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前40天，在至少一家指定媒体公告。”修改为：“召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日在指定媒体公告。”

4、本章第四条第2款，删除“⑤会议通知公布前报中国证监会备案。”

5、本章第四条增加第3款和第4款，具体内容为：

“3.在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4.在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。”

6、本章第五条第1款“议事内容及提案权”，内容修改为：

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。”

7、本章增加第九条“本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面的联系”，具体内容为：

“鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系。

本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。计算参会份额和计票时，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日本基金所持有的目标ETF份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF份额持有人大会。”

8、本章增加第十条，具体内容为：“十、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。”

十、第11章 基金的投资

根据相关法律法规及监管规则，对本章中投资目标、投资范围、投资理念、投资策略、投资决策依据和决策程序、投资限制、业绩比较基准、基金的融资等与投资相关的条款将进行修改，并“增加目标ETF发生相关变更情形时的处理”条款。具体修改如下：

1、本章第一条“投资目标”全部修改为：“通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。”

2、本章第二条“投资范围”全部修改为：“本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%（已购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），本基金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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（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）。

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。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。届时本基金参与融资融券、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决定。”

3、本章第三条“投资理念”全部修改为：“本基金遵循指数化投资理念，通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股等，力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。”

4、本章第四条“投资策略”全部修改为：“本基金以目标ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。

（一）资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。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。

（二）目标ETF投资策略

本基金投资目标ETF的两种方式如下：

①申购和赎回：目标ETF开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。

②二级市场方式：目标ETF上市交易后，在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

本基金将在目标ETF上市交易、开放申购赎回3个月内，使得本基金投资目标ETF的比例满足基金合同有关投资比例的要求。

（三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建本金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（四）债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时着重考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

（五）股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，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。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：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；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。”

5、本章第五条“投资决策依据和决策程序”全部修改为：

“（一）决策依据

1.国家有关法律、法规、本基金合同和标的指数的有关规定。

2.宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。

3.团队投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过投资研究全体人员的共同努力与分工协作，由基金经理具体制定并执行投资计划，争取对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资决策体制

本基金实行投资决策委员会领导下的团队投资方式。在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，通过投资研究全体人员的团队投资、分工协作，由基金经理具体制定并执行投资计划。

（三）投资决策程序

1.决定主要投资原则：投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，决定基金的主要投资原则，确立基金的投资策略，审定基金资产的配置方案。

2.团队投资与投资决策制定：在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，通过投资研究全体人员的团队投资、分工协作，由基金经理具体执行投资计划。

3.指数化投资团队运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算，并提供量化风险分析报告；研究部对标的指数成份股中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告；市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告，供基金经理决策参考。

4.投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。

5.基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告，在追求跟踪误差最小化的前提下，采取适当的方法以降低交易成本、控制投资风险。

6.交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖，同时判断执行该投资指令是否将发生违法、违规行为，是否会发生特殊交易、是否将要超过比例限制等，履行一线监控职责。

7.指数化投资团队根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关绩效评估报告，基金经理根据评估报告分析该基金的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等；监察稽核部、风险管理部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

8.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、基金申赎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。

本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市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。”

6、本章第六条“投资限制”第（一）款“禁止行为”，将第4项“买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外”修改为：“买卖除目标ETF外的其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外”；将第5项“向基金管理人、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债券”修改为：“向基金管理人、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债券，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标ETF与标的指数成份股除外”；将第6项“买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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”修改为：“买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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，目标ETF与标的指数成份股除外”。

7、本章第六条“投资限制”第（二）款“投资组合限制”全部修改为：“本基金的投资组合将遵循以下限制：

①本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；

②本基金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，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；

③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%；

④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%；

⑤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%；

⑥基金财产参与股票发行中购，本基金所申报的金额不超过本基的总资产，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；

⑦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%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

⑧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、目标ETF、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和目标ETF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%；本基金所持有的股票市值、目标ETF和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑨本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

⑩本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

⑪本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

⑫本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

⑬本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

⑭法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自本基金变更为ETF联接基金的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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按调整后的规定执行。”

8、本章第七条“业绩比较基准”标题修改为“标的指数及业绩比较基准”，全部内容修改为：

“本基金标的指数为中证指数有限公司所编制并发布的沪深300指数及其未来可能发生的变更。

本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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，或目标ETF标的指数发生变更，基金管理人认为有必要作相应调整时，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。”

9、本章第十条“基金的融资”标题修改为“基金的融资融券及转融通”，全部内容修改为：“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、转融通。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。届时本基金参与融资融券、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决定。”

10、本章增加第十二条“目标ETF发生相关变更情形时的处理”，具体内容如下：

“目标ETF出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金：若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将删除关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

1.目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；

2.目标ETF终止上市；

3.目标ETF基金合同终止；

4.目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）。

若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。”

十一、第12章 基金的财产

本章第一条“基金资产总值”第8项后增加一项“9、目标ETF投资及其估值调整”，原后续各项的序号相应调整。

十二、第13章 基金资产估值

根据监管规则要求，本章补充约定对目标ETF估值和因目标ETF估值暂停估值的情形，并根据本基金变更投资范围相应增加股指期货等其他资产估值的约定，具体修改如下：

1、本章第三条“估值对象”，内容修改为：“基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、债券、权证、股指期货和银行存款本息等资产和负债。”

2、本章第五条“估值方法”，增加第1款，增加内容为：“1、目标ETF的估值

本基金投资的目标ETF份额以其估值日基金份额净值估值。”

其他各款序号相应调整。

3、本章第五条“估值方法”，增加第7款，增加内容为：“7、本基金投资股指期货合约，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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。”其他各款序号相应调整。

4、本章第七条“暂停估值的情形”，在第2款后增加如下内容：

“3.本基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

4.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；”

其余条款的序号相应调整。

十三、第14章 基金的费用与税收

本章主要下调了本基金的管理费率和托管费率，调整了“二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式”的表述，具体内容如下：

1、本章第一条“基金费用的种类”，增加“8、基金的指数使用费”。其余条款的序号相应调整。

2、本基金变更为联接基金后，联接基金管理费、托管费的计提方式将有所改变。具体修改如下：

“1.基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分基金资产，若为负数，则E取0

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分基金资产，若为负数，则E取0

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3.如将来本基金收取指数使用费，本基金管理人将根据与指数许可方签订的指数许可使用协议，从基金财产中计提指数使用费。具体费率及计提方式，将在更新的招募说明书中规定。

上述“一、基金费用的种类”中第3-9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。”

十四、第15章 基金的收益与分配

1、本章第三条“基金收益分配原则”第1款，修改为：“1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配”。删除第3款“基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；”和第4款“基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才能进行当年收益分配；”。第5款内容修改为：“3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。”其余各款序号相应调整。

2、本章第五条“收益分配方案的确定、公告与实施”，增加如下内容：“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。”

十五、第17章 基金的信息与披露

1、本章第五条第七款“临时报告”中，删除第7项“7、基金募集期延长；”。增加第25项，增加的内容为：“25、目标ETF变更；”，其余各项序号相应调整。

2、本章第五条第八款“基金份额持有人大会决议”，将原“召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前40日公告”修改为：“召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前30日公告”。

十六、第18章 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、本章第一条“《基金合同》的变更”，原“以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：”中第8款“变更基金投资目标、范围或策略”修改为：“变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或目标ETF基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略的情况除外”。

2、本章第一条“《基金合同》的变更”，原“以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：”中增加如下内容：

“⑩基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

⑪单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人会；

⑫基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会；

⑬法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项；”

3、本章第一条“《基金合同》的变更”，原“但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：”中增加如下内容：

“④由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或目标ETF基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略；

⑤经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、登记结算机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；”

其余条款的序号相应调整。

十七、基于上述修改，相应调整基金合同中相关条款的顺序以及被引用相关条款的顺序。

十八、为使基金合同适应新的法律法规的要求以及根据法律法规及《南方沪深300指数证券投资基金基金合同》的规定，对不涉及南方沪深300指数证券投资基金合同当事人权利义务关系变化的部分条款或对南方沪深300指数证券投资基金的基金份额持有人利益无实质性不利影响的部分条款，在本次基金合同修改中一并进行了修改。

特此说明。

南方基金管理有限公司
２０１３年３月４日

南方基金关于南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）增加南京银行、东兴证券为代销机构的公告

根据南方基金管理有限公司（以下简称“本公