南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:海通证券股份有限公司
重要提示

本基金经中国证监会2015年5月12日证监许可[2015]886号文注册募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险(包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险)等,详见招募说明书“风险揭示”章节等。

本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;国企改革B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现;基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、以及《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

2、基金管理人:指南方基金管理有限公司

3、基金托管人:指海通证券股份有限公司

4、基金合同:指《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书:指《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》:指2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

14、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

15、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

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

19、人民币合格境外机构投资者:指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定,运用来自境外的人民币资金进行中国境内证券投资的境外法人

20、投资人:指个人投资者、机构投资者、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

21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人,按其持有的基金份额不同,可区分为南方国企改革份额持有人、国企改革A份额持有人及国企改革B份额持有人

22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定投等业务

23、销售机构:指南方基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中,可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

24、场外:通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回

25、场内:通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

26、登记业务:指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务,及其不时修订和补充

27、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为南方基金管理有限公司或接受南方基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构,本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统,登记在该系统的基金份额也称为场外份额

29、证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,登记在该系统的基金份额也称为场内份额

30、开放式基金账户:指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户,用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

31、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

32、深圳证券账户:指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户(证A股账户)或证券投资基金账户

33、标的指数:指中证国有企业改革指数及其未来可能发生的变更

34、基金份额:指南方国企改革份额、国企改革A份额和/或国企改革B份额

35、南方国企改革份额:指南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额

36、国企改革A份额:指南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之A份额,即低风险且预期收益相对较低的稳健收益类份额

37、国企改革B份额:指南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之B份额,即高风险且预期收益相对较高的积极收益类份额

38、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

39、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

40、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

41、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

42、工行:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

43、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

44、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数

45、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

46、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

47、《业务规则》:指南方基金管理有限公司、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及对其不时做出的修订

48、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

49、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

50、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

51、自动分离:指投资人在场内认购的每2份南方国企改革份额在发售结束后按1:1比例自动转换为1份国企改革A份额和1份国企改革B份额的行为

52、配对转换:指根据基金合同的约定,本基金的南方国企改革份额与国企改革A份额、国企改革B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为,包括基金份额的分拆和合并

53、分拆:指基金份额持有人将其持有的南方国企改革份额按照2份南方国企改革份额对应1份国企改革A份额与1份国企改革B份额的比例进行转换的行为

54、合并:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的国企改革A份额与国企改革B份额按照1份国企改革A份额与1份国企改革B份额对应2份南方国企改革份额的比例进行转换的行为

55、折算:指在基金份额持有人所持基金资产净值不变的前提下,由基金管理人按照一定比例调整南方国企改革份额净值、国企改革A份额参考净值和/或国企改革B份额参考净值,使得基金份额持有人所持基金份额的数额相应变化的行为,包括定期折算和不定期折算

56、定期折算:指基金管理人按一定的周期进行的基金份额折算的行为

57、不定期折算:指当南方国企改革份额净值、国企改革A份额参考净值和/或国企改革B份额参考净值满足一定的条件时,基金管理人进行的基金份额折算行为

58、基金转换:指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金份额的行为

59、系统内转托管:指基金份额持有人将持有的基金份额在登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为

60、跨系统转托管:指基金份额持有人将持有的南方国企改革份额在登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

61、定投计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

62、巨额赎回:指本基金单个开放日,南方国企改革份额净赎回申请(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)超过上一开放日基金总份额(包括南方国企改革份额、国企改革A份额、国企改革B份额)的10%

63、元:指人民币元

64、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

65、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

66、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

67、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

68、基金份额参考净值:指在基金份额净值计算的基础上,根据基金合同给定的计算公式得到的基金份额估算价值,按基金份额的不同,可区分为国企改革A份额参考净值、国企改革B份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

69、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额(参考)净值的过程

70、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介

71、不可抗力:指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

一、基金管理人概况

名称:南方基金管理有限公司
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
成立时间:1998年3月6日
法定代表人:吴万善
注册资本:3亿元人民币
电话:(0755)82763888
传真:(0755)82763889
联系人:鲍文革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西省信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司,2014年公司进行增资扩股,注册资本达3亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

吴万善先生,董事,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员;华泰证券证券发行部副经理、总经理助理;江苏省证券登记处总经理;华泰证券证券副总经理、总裁。现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、华泰金融控股(香港)有限公司董事。

张涛先生,董事,中共党员,毕业于河海大学技术经济及管理专业,获硕士学位。1994年8月加入华泰证券,历任总裁秘书、投资银行一部业务经理、上海总部投资银行业务部副总经理、公司董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任、副总裁、党委委员。现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员;华泰长城期货有限公司董事长、华泰金融控股(香港)有限公司董事。

姜健先生,董事,中共党员,毕业于南京林业大学经济及管理专业,获硕士学位。1994年12月加入华泰证券并一直在华泰证券工作,历任人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行总部股票事务部副总经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部经理、资产管理总部总经理、投资银行总部业务总经理、总裁助理、副总裁、董事会秘书等职务。现任华泰证券股份有限公司的副总裁、党委委员、董事会秘书;华泰联合证券有限责任公司董事、华泰紫金投资有限责任公司董事、江苏股权交易中心有限责任公司董事长、华泰瑞通投资管理有限公司董事、江苏银行股份有限公司董事、证通股份有限公司董事。

夏桂英女士,董事,中共党员,高级经济师,26年法律公司管理经济工作从业经历。毕业于中国政法大学法律专业,获法学硕士学位。曾先后担任中国政法大学中国法制研究所教师、深圳市人大法工委办公室主任科员、深圳市光通发展有限公司办公室主任、深圳市投资管理公司总法律顾问、深圳市对外劳动服务有限公司党总支书记、董事长等职。2004年10月加入深圳市投资控股有限公司,历任法律事务部部长、企业一部部长职务。现任深圳市投资控股有限公司副总经理、深圳市通产集团有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司董事、深圳市城市建设开发(集团)公司董事、深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司董事。

项建国先生,董事,中共党员,高级会计师,大学本科毕业于中南财经大学财务会计专业。曾在江西财经大学任教并担任审计教研室副主任,其后在深圳蛇口信德会计师事务所、深圳市商贸投资控股公司、深圳市投资控股有限公司任职,历任深圳市投资控股有限公司投资部部长、投资发展部部长、企业一部部长、战略发展部部长、长期从事投融资、股权管理、股东事务等工作。现任深圳市投控企业园区开发运营公司副总经理、中国深圳对外贸易(集团)有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司监事、牛润五丰肉类食品(深圳)有限公司董事、深圳市建筑设计研究总院有限公司董事。

李日成先生,董事,中共党员,硕士研究生学历。历任厦门大学哲学系团总支副书记、厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、计划部经理、公司总经理助理、厦门国际信托投资有限公司副总经理、厦门国际信托有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司总经理。

庄园芳女士,董事,工商管理硕士,经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人,证券投资部副总经理、总经理,投资总监;现任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业创新资本管理有限公司董事、兴证(香港)金融控股有限公司董事。

杨小松先生,总裁,中共党员,经济学硕士,注册会计师。历任德勤国际会计师行会计专业翻译,光大银行证券部职员,美国NASDAQ实习职员,证监会处长、副主任。2012年加入南方基金,担任督察长,现任南方基金管理有限公司董事、总裁、党委副书记。

姚崽源先生,独立董事,经济学硕士。历任国家经委副处长、商业部政策研究室副处长、国际合作司处长、副司长、中国国际贸易促进会商业行业分会副会长、常务副会长、国内贸易部商业发展中心主任、中国商业联合会副会长、秘书长、安徽省政府副秘书长、安徽省阜阳市政府市长、安徽省统计局局长、党组书记、国家统计局总经济师兼新闻发言人。现任国务院参事室特约研究员,中国经济50人论坛成员,中国统计学会副会长。

李心丹先生,独立董事,金融学博士,国务院特殊津贴专家,国务院学位委员会、教育部全国金融硕士专业学位教学指导委员会委员。历任东南大学经济管理学院助教、讲师、副教授、教授,现任南京大学工程管理学院院长、金融工程研究中心主任、南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、教授、博士生导师、江苏省省委决策咨询专家、上海证券交易所上市委员会委员及公司治理委员会委员、上海证券交易所、深圳证券交易所、国信证券等单位的博士后指导导师,中国金融学年会常务理事、国家留学基金会评审专家、江苏省政本市场研究会会长、江苏省科技创新协会副会长。

周炳涛先生,独立董事,工商管理博士,香港证券及投资学会高级资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科),香港证券及期货专员办事处,及香港证券及期货事务监察委员会,退休前为该会的法规执行部总监。其后曾任该会法规执行咨顾问及香港汇业集团控股有限公司独立非执行董事。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生,独立董事,中共党员,经济学硕士,20年以上证券从业经历。毕业于财政部科研所,曾任职于北京市财政局、深圳蛇口中华会计师事务所、京都会计师事务所等机构,先后担任干部、经理、副主任等工作。现担任致同会计师事务所(特殊普通合伙)董事合伙人,中国证监会上市公司并购重组专家咨询委员会委员职务。

周蕊女士,独立董事,硕士研究生学历,曾工作于北京市万商天勤(深圳)律师事务所、北京市中伦(深圳)律师事务所、北京市信利(深圳)律师事务所,现任北京市金杜(深圳)律师事务所华南区管理合伙人,全联并购公会广东分会副会长、广东省律师协会女律师委员会副主任、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深圳市中小企业公共服务联盟副主席、深圳市易尚展示股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

骆新都女士,监事,经济学硕士,经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问;现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本姨女士,监事,15年的证券行业从业经历。毕业于杭州电子工业学院会计专业,获学士学位。曾任职于熊猫电子集团公司,担任财务处处长工作。1998年10月加入华泰证券,历任计划资金部副总经理、稽查监察部副总经理、总经理、计划财务部总经理。现任华泰证券股份有限公司财务负责人、计划财务部总经理;华泰联合证券有限责任公司监事会主席、华泰长城期货有限公司副董事长、华泰紫金投资有限责任公司董事、华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士,监事,中共党员,高级会计师,大学本科毕业于深圳广播电视大学会计学专业。曾在浙江兰溪马同专厂、浙江兰溪纺织机械厂、深圳市建筑机械动力公司、深圳市建设集团、深圳市建设投资控股公司工作,2004年深圳市投资控股有限公司成立至今,历任公司计划财务部副经理、经理,财务预算部副部长,长期从事财务管理、投融资、股权管理、股东事务等工作,现任深圳市投资控股有限公司财务部部长,深圳市科实投资发展有限公司监事,深圳市国际招标有限公司董事,中国科技开发院有限公司监事,深圳市深福保(集团)有限公司监事,深圳经济特区房地产(集团)股份有限公司董事,深圳市建安(集团)股份有限公司董事。

苏荣坚先生,监事,中共党员,学士学位,高级经济师。历任三明市财政局、财委,厦门信达股份有限公司财务部,厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理,自营业务部经理;现任厦门国际信托有限公司财务总监兼财务部总经理、南方基金管理有限公司监事。

林红珍女士,监事,投资经济管理专业学士学位,后参加人民大学金融学院研究生进修班。曾任厦门对外供应总公司会计、厦门中友贸易联合公司财务部副经理、厦门外供房地产开发公司财务部经理,1994年进入兴业证券,先后担任计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、财务会计部计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副总经理(主持工作)、兴业证券风险管理部总经理,现任兴业证券股份有限公司财务部总经理、兴业创新资本管理有限公司监事。

苏民先生,职工监事,博士研究生,工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师,华夏证券深圳分公司电脑部经理助理,南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监;现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

张德伦先生,职工监事,中共党员,硕士学历。历任北京邮电大学副教授、华为技术有限公司处长、汉唐证券人力资源部总经理、海王生物人力资源总监、华信惠悦咨询公司副总经理、首席顾问,2010年1月加入南方基金管理有限公司,现任人力资源部总监。

林斯彬先生,职工监事,民商法专业硕士,先后担任金杜律师事务所证券业务部实习律师、浦东发展银行深圳分行营产保全部职员、银华基金管理有限公司监察稽核部法务主管、民生加银基金管理有限公司监察稽核部副总监,2008年12月加入南方基金管理有限公司,历任监察稽核部经理、高级经理、总监助理,现任监察稽核部副总监。

3、公司高管人员

吴万善先生,董事长,简历同上。

杨小松先生,总裁,简历同上。

俞文宏先生,副总裁,中共党员,工商管理硕士,经济师,历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003年加入南方基金,现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员、南方资本管理有限公司董事长兼总经理。

郑文祥先生,副总裁,工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000年加入南方基金,历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监,现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生,副总裁,中共党员,经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司,2002年加入南方基金,历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官,现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生,副总裁,中共党员,工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员,华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理,投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005年加入南方基金,曾任督察长兼监察稽核部总监,现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委委员。

鲍文革先生,督察长,中国民主同盟盟员,经济学硕士。历任财政部冶中华会计师事务所审计师,南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理,1998年加入南方基金,历任运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总经理助理,现任南方基金管理有限公司督察长、南方资本管理有限公司董事。

4、基金经理

雷俊,北京大学工学硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员;2014年12月至今,任南方恒生基金经理;2015年4月至今,任南方中证500原材料ETF基金经理。

5、投资决策委员会成员

总裁杨小松先生,总裁助理兼固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司(香港)董事李海鹏先生,总裁助理兼权益投资总监史博先生,交易管理部总监王珂女士,投资部总监陈键先生,专户投资管理部总监蒋峰先生,固定收益部总监韩亚庆先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

(1)依法募集资金、办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算南方国企改革份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定南方国企改革份额申购、赎回的价格、国企改革A份额和国企改革B份额的基金份额参考净值;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基法法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(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;

(25)执行生效的基金份额持有人的大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)侵占、挪用基金财产;

(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,从事以下活动:

(1)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职守、滥用职权;

(7)泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(8)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

(9)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(10)贬损同行,以提高自己;

(11)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

(12)以不正当手段谋求业务发展;

(13)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(14)法律、行政法规和中国证监会禁止的行为。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;

(2)违反规定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,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5)向基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

六、基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作,有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险,确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整,从而最大程度地保护基金份额持有人的利益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总揽和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分设。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡,并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性,运用科学化的方法尽量降低经营运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、主要内部控制制度

(1)内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

(2)风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定,风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

(3)监察稽核制度

公司设立督察长,负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名,董事会聘任,并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外,督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要,有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门,具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员,明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立,检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况;检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

四、基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称:海通证券股份有限公司
住所:上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
成立时间:1988年8月15日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行银复【1988】383号
组织形式:股份有限公司
注册资本:95.8472亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可【2013】1643号

海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”)成立于1988年,是国内最早成立的大型证券公司之一。海通证券A股于2007年在上海证券交易所挂牌上市并完成定向增发,H股于2012年4月在香港联合交易所挂牌上市,公司注册资本增至95.84亿元。

海通证券设基金托管部,现有员工具有多年金融从业经历,丰富的证券相关业务经验。全员具备基金从业资格,员工的学历均在本科以上,硕士以上学历占25%,专业分布合理,