南方恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2015年第2号）

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
截止日：2015年12月23日

重要提示

本基金经中国证监会2014年12月2日证监许可［2014］1297号文核准募集。基金合同已于2014年12月23日正式生效。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的80%。本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力、理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。基金合同生效后，本基金的申购赎回采用全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，申购对价、赎回对价包现金替代、现金差额及其他对价。未来在上海证券交易所和登记机构系统允许的情况下，本基金将采用港股通股票申购赎回模式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。投资本基金可能遇到的主要风险包括：（1）本基金特有的风险，主要包括投资港股通股票的风险、指数下跌风险、跟踪偏离风险、流动性风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、标的指数变更的风险、第三方机构服务的风险、操作或技术风险；（2）境外投资风险，主要包括汇率风险、市场风险、法律和政治风险、会计制度风险、税务风险等；（3）投资工具的相关风险；（4）政策变更风险；（5）不可抗力风险；等等。本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金跟踪香港市场股票指数，基金净值会因香港证券市场波动等因素而产生波动，同时面临汇率风险等投资境外市场的特殊风险。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资人保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

在目前结算规则下，投资者当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回，即T日申购的基金份额，T日交收成功后，T+1日可卖出和赎回。当日买入的基金份额，当日可以赎回。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、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》、《运作办法》、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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年12月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（未经审计）。

§1基金名称

南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

§2基金的类型

股票型证券投资基金

§3基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

§4基金的投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（包括港股通股票中的标的指数成份股、备选成份股）、公募基金、依法发行上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的80%。

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

§5基金的投资策略

5.1投资策略

本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金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，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的，本基金力争年化跟踪误差控制在3%以内。本基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，如果未来出现由于港股通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时，为了更好的保护投资人的利益，实现投资目标，本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

1、股票投资组合的构建

本基金将根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

2、股票投资组合的调整

1）定期调整

本基金将依照标的指数的定期调整规则，对股票组合进行相应的调整。

2）不定期调整

A、当成份股发生并购、股份回购、增发、送配、拆股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

B、根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

C、若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

构造替代性组合的方法如下：

A、按照与被替代股票所属行业及基本面相似的原则，选取替代股票备选库。本基金投资采用与标的指数相同或类似的行业分类标准；

B、采用备选库中各股票过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代股票的相关性；

C、选取备选库中与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以模拟组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中各股票的权重。

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，以及股价及其他监管限制，决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更实施前2个工作日内在指定媒介公告，并阐明变更复制方法的原因。

3、债券和货币市场工具的配置策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

4、金融衍生产品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。

5.2投资决策依据和决策程序

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

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。基金管理人有权根据基金运作情况选择、更换或撤销境外投资顾问，为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务。

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。

（1）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、股指期货跟踪有效性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。

（2）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。

（3）组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股的方法构建组合。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。

（4）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。

（5）投资绩效评估：指数化投资团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此调整投资组合。

（6）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、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，紧密跟踪标的指数。

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体制和程序做出调整，并在更新的《招募说明书》中列示。

§6基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数（使用估值汇率调整），本基金标的指数为恒生指数。

恒生指数是由香港恒生银行全资附属的恒生指数服务有限公司编制，截至2014年10月，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。该指数于1969年11月24日首次公开发布，基期为1964年7月31日，基期指数定为100。恒生指数以港币计价。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

如果指数公司变更或停止标的指数的编制及发布，或者标的指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，通过适当的程序变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并同时更换本基金的基金名称。若标的指数和业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

§7基金的风险收益特征

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

§8基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日（未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	92,629,835.75	93.36
	其中：普通股	92,629,835.75	93.36
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	5,817,612.59	5.86
8	其他资产	772,413.85	0.78
9	合计	99,219,862.19	100.00

1.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	92,629,835.75	94.81
合计	92,629,835.75	94.81

1.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	54,272,622.89	55.55
能源	6,692,483.65	6.85
电信服务	7,288,456.65	7.46
公用事业	3,908,019.65	4.00
信息技术	10,102,230.79	10.34
工业	5,246,516.38	5.37
非必需消费品	2,471,822.43	2.53
必需消费品	2,647,683.31	2.71
合计	92,629,835.75	94.81

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	00700	香港	中国香港	90,200	9,572,992.12	9.80
2	HSBC Holdings plc	汇丰控股有限公司	00005	香港	中国香港	194,400	9,198,949.00	9.42
3	China Mobile Limited	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	102,000	7,685,736.52	7.87
4	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	01299	香港	中国香港	200,400	6,587,837.48	6.74
5	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	00939	香港	中国香港	1,400,000	5,918,040.10	6.06
6	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	中国香港	1,227,000	4,491,817.06	4.60%
7	Ck Hutchison Holdings Limited	长江和记实业有限公司	00001	香港	中国香港	44,776	3,682,609.37	3.77
8	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	1,322,000	3,613,419.03	3.70
9	Ck Hutchison Holdings Limited	香港交易及结算所有限公司	00388	香港	中国香港	18,900	2,742,753.03	2.81
10	PingAn Insurance (Group) CompanyOf China，Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	香港	中国香港	87,000	2,738,591.52	2.80

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

1.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

1.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.10.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	771,279.79
4	应收利息	1,134.06
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	772,413.85

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9基金业绩

（一）本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准（GIPS）。GIPS是一套确保公司表现得到公平报告和充分披露的投资表现报告道德标准。

1、在业绩表述中采用统一的货币；

2、按照GIPS的相关规定和标准进行计算；

3、如果GIPS的标准与国内现行要求不符时，同时公布不同标准下的计算结果，并说明其差异；

4、对外披露时，需要注明业绩计算标准是符合GIPS要求的。

（二）基金管理人依照恪尽职守，诚实信用，勤勉尽责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。基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（2）	业绩比较基准收益率（3）	业绩比较基准收益率标准差（4）	（1）-（3）	（2）-（4）
2014.12.23-2014.12.31	0.08%	0.01%	0.86%	0.73%	-0.78%	-0.72%
2015.1.1-2015.9.30	-9.31%	1.31%	-8.12%	1.37%	-1.19%	-0.06%
自基金成立起至今	-9.24%	1.29%	-7.42%	1.36%	-1.82%	-0.07%

§10基金管理人

10.1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15亿元人民币。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，注册资本金达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%。

10.2主要人员情况

10.2.1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，中国籍。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辽宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记结算公司副经理、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，硕士研究生学历，经济师，中国籍。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处、证券处处长、南京市证券管理委员会秘书、南京证券有限责任公司董事、华泰证券股份有限公司董事兼党委副书记、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。

姜健先生，董事，中共党员，硕士研究生学历，高级经济师，中国籍。历任中国人民银行南京市分行辽宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记结算公司副经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

张国锋先生，董事，中共党员，硕士研究生学历，工商管理硕士，高级经济师，中国籍。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辽宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记结算公司副经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事、华泰证券投资有限责任公司董事、华泰紫金投资有限责任公司董事、华泰证券投资管理有限公司董事、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，中国籍。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、战略发展部部长，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，中国籍。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。现任深圳市投控产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、华润五丰肉类食品（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。

李石先生，董事，中共党员，硕士研究生学历，中国籍。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、计财部经理、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，中国籍。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，中国籍。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。

姚景源先生，独立董事，经济学硕士，中国籍。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、安徽省省长助理、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，中国籍。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、江苏省资本市场研究会会长、江苏省科技创新协会副会长。

周锦涛先生，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，中国香港籍。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部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，中国籍。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，中国籍。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、北京市信和（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。

10.2.2监事会成员

舒本娥女士，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，中国籍。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，硕士研究生学历，工商管理硕士，高级会计师，中国籍。曾在浙江兰溪马涧米厂、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考核办配部部长，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、深圳市国际招标有限公司董事、深圳市深投物业发展有限公司董事。

苏荣坚先生，监事，中共党员，学士学位，高级经济师，中国籍。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。

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，中国籍。曾任厦门对外供应总公司会计、厦门大发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董事、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，中国籍。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，中国籍。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。

徐超先生，职工监事，工商管理硕士，中国籍。曾担任建设银行深圳分行科技部开发中心副经理，2000年10月加入南方基金管理有限公司，历任信息技术部主管、总监助理、副总监、执行总监，现任运作保障部总监。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，中国籍。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资产保全部职员、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职员，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、副总监，现任监察稽核部执行总监。

10.2.3公司高级管理人员

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，中国籍。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，中国籍。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，历任国投投资经理、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，中国籍。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，中国籍。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。

常克川先生，副总裁，中共党员，EMBA工商管理硕士，中国籍。历任中国农业银行副处级秘书、南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理，联合证券（现为华泰联合证券）董事会秘书、合规总监等职务；2011年加入南方基金，任职董事会秘书、纪委书记，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记、南方资本管理有限公司董事。

李湘鹏先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。曾任美国AXA Financial 公司投资部高级分析师，2002年加入南方基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、总经理助理兼固定收益投资总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士，中国籍。历任财政部财政部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。

10.2.4基金经理

本基金历任基金经理为：2014年12月至2015年2月，杨德龙、雷俊；2015年2月至今，杨德龙、雷俊、罗文杰。

杨德龙先生，北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010年8月至2013年4月，任小康ETF及南方小康基金经理；2011年9月至今，任南方上证380ETF及联接基金基金经理；2013年3月至今，任南方策略基金基金经理；2013年4月至今，任南方300基金经理；2013年4月至今，任南方开元沪深300ETF基金经理；2014年12月至今，任南方恒生ETF基金经理。

雷俊先生，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ETF基金经理；2015年4月至今，任南方中证500工业ETF基金经理；2015年4月至今，任南方中证500原材料ETF基金经理；2015年4月至今，任大数据100基金经理；2015年6月至今，任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据300、南方500信息、南方量化成长的基金经理。

罗文杰女士，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国Open Link Financial公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013年5月至2015年6月，任南方策略基金经理；2013年4月至今，任南方500基金经理；2013年4月至今，任南方500ETF基金经理；2013年5月至今，任南方300基金经理；2013年5月至今，任南方开元沪深300ETF基金经理；2014年10月至今，任500医药基金经理；2015年2月至今，任南方恒生ETF基金经理。

10.2.5投资决策委员会成员

总裁杨小松先生，副总裁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，国际业务部副总监黄亮先生。

10.2.6上述人员之间不存在近亲属关系。

§11基金的费用概览

11.1与基金运作有关的费用

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、基金上市费及年费；

5、基金的指数许可使用费；

6、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees）；

7、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

8、基金份额持有人大会费用；

9、基金进行外汇兑换交易的相关费用；

10、基金的证券、期货交易费用、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；

11、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”）；

12、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；

13、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、赎回费等；

14、更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新托管人所引起的费用，但因基金管理人或基金托管人自身原因导致被更换的情形除外；

15、基金的银行汇划费用；

16、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

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×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

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5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。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配；如果委托境外投资顾问，基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用，具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进行约定。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的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

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