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

（2019年第1号）

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
截止日：2019年06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2019年6月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31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。

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，本基金将在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、交易限制及成本，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，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市的股票，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2019年3月31日（未经审计）。

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	72,002,044.26	97.96
	其中：普通股	72,002,044.26	97.96
	存托凭证	–	–
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	1,328,241.83	1.81
8	其他资产	169,477.63	0.23
9	合计	73,499,763.72	100.00

注：股票投资中通过沪港通买入港股公允价值合计为人民币72,002,044.26元，占基金净值比为98.15%。

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	72,002,044.26	98.15
合计	72,002,044.26	98.15

3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

3.1 报告期末指数投资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（%）
能源	4,538,626.93	6.19
材料	–	–
工业	331,707.39	0.45
非必需消费品	4,128,174.41	5.63
必需消费品	3,428,184.49	4.67
医疗保健	906,786.97	1.24
金融	43,185,257.10	58.87
科技	8,143,622.37	11.10
通讯	4,166,543.37	5.68
公用事业	3,173,141.23	4.33
政府	–	–
合计	72,002,044.26	98.15

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

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

4.1 报告期末指数投资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（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	香港联合交易所	香港	23,800	7,369,960.12	10.05
2	HSBC Holdings Plc	汇丰控股有限公司	0005 HK	香港联合交易所	香港	132,400	7,257,212.20	9.89
3	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港联合交易所	香港	107,200	7,186,290.13	9.80
4	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	0939 HK	香港联合交易所	香港	955,000	5,513,145.00	7.52
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	49,500	3,732,287.18	5.09
6	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	香港联合交易所	香港	54,000	3,705,652.80	5.05
7	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	香港	646,000	3,186,260.96	4.34
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算所有限公司	0388 HK	香港联合交易所	香港	10,700	2,511,197.38	3.42
9	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	香港	701,000	2,140,666.41	2.92
10	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	香港联合交易所	香港	161,000	2,030,131.59	2.77

注：基金对以上证券代码采用当地交易市场交易代码。

4.2 报告期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

本基金本报告期末未持有基金。

10 投资组合报告附注

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。

10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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	169,189.68
4	应收利息	287.95
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	169,477.63

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未有积极投资。

§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%	0.76%	0.94%	–0.68%	–0.93%
2015.1.1–2015.12.31	–3.25%	1.31%	–1.41%	1.36%	–1.84%	–0.05%
2016.1.1–2016.12.31	8.48%	1.16%	7.19%	1.33%	1.29%	–0.17%
2017.1.1–2017.12.31	28.81%	0.74%	27.08%	0.75%	1.73%	–0.01%
2018.1.1–2018.12.31	–8.00%	1.26%	–9.44%	1.27%	1.44%	–0.01%
2019.1.1–2019.3.31	9.83%	1.03%	10.04%	1.04%	–0.21%	–0.01%
自基金成立起至今	36.72%	1.13%	34.85%	1.19%	1.87%	–0.06%

§10 基金管理人

10.1 基金管理人概况

名称：南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32–42楼

成立时间：1998年3月6日

法定代表人：张海波

注册资本：3亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：常克川

1998年，南方基金管理有限公司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1.5亿元人民币。2014年公司进行增资扩股，注册资本金达3亿元人民币。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金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

张海波先生，董事长，工商管理硕士，中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员，江苏省人民政府办公厅调研员，华泰证券总裁助理、投资银行部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务管理总部总经理，华泰证券副总裁兼华泰紫金投资有限责任公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事长、华泰证券（上海）资产管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司党委书记、董事长。

王连芬女士，董事，金融专业硕士，中国籍。曾任职赛格集团销售，深圳投资基金管理公司投资一部研究室主任，大鹏证券经纪业务部副总经理，深圳福虹路营业部总经理，南方总部总经理，总裁助理，第一证券总裁助理，华泰联合证券深圳华强北路营业部总经理、渠道服务部总经理、运营中心总经理、零售客户部总经理、执行办主任、总裁助理。现任华泰证券股份有限公司总裁助理兼深圳分公司总经理。

张辉先生，董事，管理学博士，中国籍。曾任职北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司干部，华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理。现任华泰证券股份有限公司董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生，董事，工学学士，中国籍。曾任职陆军第124师工兵营地爆连副连职排长、代政治指导员、师政治部组织科正连职干事，陆军第42集团军政治部组织处副营职干事，驻香港部队政治部组织处正营职干事，驻澳门部队政治部正营职干事，陆军第163师政治部宣传科副科长(正营职)，深圳市纪委教育调研室主任科员、副处级纪检员、办公厅副主任、党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、纪委书记，深圳市投控资本有限公司监事。

李平先生，董事，工商管理硕士，中国籍。曾任职深圳市城建集团办公室文秘、董办文秘，深圳市投资控股有限公司办公室（信访办）高级主管、企业三部高级主管。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长，深圳市城市建设开发（集团）公司董事。

李自成先生，董事，近现代史专业硕士，中国籍。曾任职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、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

王斌先生，董事，临床医学博士，中国籍。曾任职安徽泗县人民医院临床医生，瑞金医院主治医师，兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理。现任兴业证券研究所总经理。

杨小松先生，董事，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍。曾任职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，南方基金管理有限公司督察长。现任南方基金管理股份有限公司总裁、党委副书记，南方东英资产管理有限公司董事。

姚景源先生，独立董事，经济学硕士，中国籍。曾任职国家经委副处长，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，中国籍。曾任职东南大学经济管理学院教授，南京大学工程管理学院院长。现任南京大学–牛津大学金融创新研究院院长、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，中国金融学年会常务理事，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，法学硕士，香港证券及投资学会杰出资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察，香港证券及期货专员办事处证券主任，香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，经济学硕士，工商管理硕士，中国注册会计师，中国籍。曾任职北京市财政局干部，深圳蛇口中华会计师事务所经理，京都会计师事务所副主任。现任致同会计师事务所（特殊普通合伙）管理合伙人，中国证监会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。

周蕊女士，独立董事，法学硕士，中国籍。曾任职北京市万商天勤（深圳）律师事务所律师，北京市中伦（深圳）律师事务所律师，北京市信利（深圳）律师事务所律师、合伙人。现任金杜律师事务所合伙人，全联并购公会广东分会会长，广东省律师协会女律师工作委员会副主任，深圳市中小企业改制专家服务团专家，深圳市女企业家协会理事。

10.2.2 监事会成员

吴晓东先生，监事会主席，法律博士，中国籍。曾任职中国证监会副处长、处长，华泰证券合规总监，华泰联合证券副总裁、党委书记、董事长，南方股权投资基金管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司监事。

舒本娥女士，监事，大学本科学历，中国籍。曾任职熊猫电子集团公司财务处处长，华泰证券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总监，华泰联合证券有限责任公司监事会主席，华泰期货有限公司副董事长。

姜丽花女士，监事，大学本科学历，高级会计师，中国籍。曾任职浙江兰溪马涧米厂主管会计，浙江兰溪纺织机械厂主管会计，深圳市建筑机械动力公司会计，深圳市建设集团计划财务部助理会计师，深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理，深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长、考核分配部部长。现任深圳市投资控股有限公司财务部部长、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。

王克力先生，监事，船舶工程专业学士，中国籍。曾任职厦门造船厂技术员，厦门汽车工业公司总经理助理，厦门国际信托有限公司国际广场筹建处副主任，厦信置业发展公司总经理、投资部副经理、自有资产管理部副经理职务。现任厦门国际信托有限公司投资发展部总经理。

林红珍女士，监事，工商管理硕士，中国籍。曾任职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，兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、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）、风险管理部总经理、财务部总经理、资金运营管理部总经理。现任兴业证券计划财务部总经理，兴证期货有限公司董事，兴证创新资本管理有限公司监事。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，中国籍。曾任职金杜律师事务所证券业务部实习律师，上海浦东发展银行深圳分行资产保全部职员，银华基金监察稽核部法务主管，民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金管理股份有限公司监察稽核部执行董事。

徐刚，职工监事，硕士学历，中国籍。1995年7月专科毕业于山东理工大学机电专业，2010年6月研究生毕业于兰州大学工商管理专业。1995年11月参加工作，就职于深圳期货投资公司，任职职员、项目经理，2003年6月加入公司，先后任职上海分公司职员、机构业务部职员、养老金业务部主管、上海分公司高级经理、副总经理，目前任职上海分公司董事。

董星华，职工监事，硕士学历，中国籍。1991年7月专本科毕业于华中理工大学机械工程专业，2002年6月研究生毕业于中国人民大学政治经济学专业。其1991年11月参加工作，先后就职于中国人保武汉分公司、中国人寿再保险公司、中国再保险公司、深圳证券通信公司，任职科员、主任科员、经理，2011年2月加入公司，先后任职综合管理部经理、办公室高级经理，现任办公室高级副总裁。

10.2.3 公司高级管理人员

张海波先生，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，工商管理硕士，经济师，中国籍。曾任职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，南方资本管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

朱运东先生，副总裁，经济学学士，高级经济师，中国籍。曾任职财政部地方预算司及办公厅秘书，中国经济开发信托投资公司综合管理部总经理，南方基金管理有限公司北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

常克川先生，副总裁，EMBA工商管理硕士，中国籍。曾任职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，华泰联合证券董事会秘书、合规总监等职务，南方资本管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。曾任职美国AXA Financial公司投资部高级分析师，南方基金管理有限公司高级研究员、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、总裁助理兼固定收益投资总监，南方东英资产管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（固定收益）。

史博先生，副总裁，经济学硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍。曾任职博时基金管理有限公司研究员、市场部总助，中国人寿资产管理有限公司股票部高级投资经理，泰达宏利基金管理有限公司投资副总监、研究总监、首席策略分析师、基金经理，南方基金管理有限公司基金经理、研究部总监、总裁助理兼首席投资官（权益）。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（权益）。

鲍文革先生，督察长，经济学硕士，中国籍。曾任职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，南方基金管理有限公司运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理。现任南方基金管理股份有限公司督察长，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2016年3月，杨德龙、雷俊、罗文杰；2016年3月至2016年4月，雷俊、罗文杰；2016年4月至今，罗文杰。

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，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，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4月起担任数量化投资部基金经理；现任指数投资部总经理。2013年5月至2015年6月，任南方策略基金经理；2017年11月至2019年1月，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016年12月至2019年4月，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2013年4月至今，任南方500、南方500ETF基金经理；2013年5月至今，任南方300、南方300联接基金经理；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；2017年7月至今，任恒生联接基金经理；2017年8月至今，任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理；2018年2月至今，任H股ETF、南方H股ETF联接基金经理；2018年4月至今，任MSCI基金基金经理；2018年6月至今，任MSCI联接基金经理。

10.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官（权益）史博先生，南方东英资产管理有限公司总裁丁晨女士，国际业务部总经理黄亮先生，国际业务部董事苏炫纲先生，国际业务部高级副总裁毕凯先生。

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、顾问费等；

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：

$H = E \times 0.5\% \div$ 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：

$H = E \times 0.1\% \div$ 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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外托管人，其中可以部分作境外托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外托管人在有关协议中进行约定。

3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费；

本基金作为指数基金，需要根据与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。指数许可使用费自基金首次挂牌之日起累计，计算方法如下：

$H = E \times 0.04\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

若一个季度累计计提指数许可使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于季末最后一日补提指数许可使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

指数许可使用费每日计提，按季支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后，基金托管人于次季度首日起15日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述"一、基金费用的种类中第4－15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。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

基金管理人与基金托管人协商一致调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

11.2 与基金销售有关的费用

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价或现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价或现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、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。

3、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，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

§12 基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币34,932,123.46万元

联系电话：010–66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2018年12月，中国工商银行资产托管部共有员工202人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年12月，中国工商银行共托管证券投资基金923只。自2003年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的64项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的职责

1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3、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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4、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，不得委托第三人托管基金财产；

5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7、保守基金商业秘密，除《基金法》、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予以保密，不得向他人泄露；

8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

9、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

12、建立并保存基金份额持有人名册；

13、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

17、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；

18、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和银行监管机构，并通知基金管理人；

19、因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20、按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

21、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22、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。

（五）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部"一手抓业务拓展，一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017、2018共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照"内控优先"的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立"以人为本"的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

六、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

§13 境外托管人

本基金目前不设境外托管人。基金托管人有权选择、聘任、更换或撤销境外托管人，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

§14 相关服务机构

14.1 销售机构

14.1.1 申购赎回代理证券公司

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路228号 法定代表人：周易 联系人：庞晓芸 联系电话：0755–82492193 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
2	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街35号2–6层 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人：陈共炎 联系人：辛国政 联系电话：010–83574507 客服电话：4008–888–888或95551 网址：www.chinastock.com.cn
3	中泰证券股份有限公司	注册地址：济南市市中区经七路86号 办公地址：山东省济南市市中区经七路86号 法定代表人：李玮 联系人：许曼华 电话：021–20315290 传真：021–20315137 客服电话：95538 网址：www.zts.com.cn
4	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址：北京市朝阳门内大街188号 法定代表人：王常青 联系人：刘畅 联系电话：010–65608231 客服电话：4008888108 网址：www.csc108.com
5	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层 办公地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦14、16、17层 法定代表人：丁益 联系人：金夏 联系电话：0755–83516289 客服电话：0755–33680000 4006666888 网址：www.cgws.com
6	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区福华一路111号 办公地址：深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼 法定代表人：霍达 联系人：黄婵君 联系电话：0755–82960167 客服电话：95565、4008888111 网址：www.newone.com.cn
7	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人：张佑君 联系人：王一通 电话：010–60838888 传真：010–60833739 客服电话：95558 网址：www.cs.ecitic.com
8	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号40层 法定代表人：李梅 联系人：李玉婷 电话：021–33389888 传真：021–33388224 客服电话：95523或4008895523 网址：www.swhysc.com
9	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755–82825551 客服电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn
10	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层 办公地址：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层 法定代表人：姜晓林 联系人：焦刚 联系电话：0531–89606166 客服电话：95548 网址：sd.citics.com
11	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人：杨炯洋 联系人：谢国梅 客服电话：95584 网址：www.hx168.com.cn
12	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼 办公地址：上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼 法定代表人：李俊杰 联系人：邵珍珍 联系电话：021–53686888 传真：021–53686100–7008 客服电话：4008918918 网址：www.shzq.com
13	国都证券股份有限公司	注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 联系人：黄静 电话：010–84183333 传真：010–84183311–3389 客服电话：400–818–8118 网址：www.guodu.com
14	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区星阳街5号 办公地址：苏州工业园区星阳街5号 法定代表人：范力 联系人：陆晓 电话：0512–62938521 传真：0512–65588021 客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn
15	西南证券股份有限公司	注册地址：重庆市江北区桥北苑8号 法定代表人：廖庆轩 联系人：周青 联系电话：023–63786633 客服电话：4008096096 网址：www.swsc.com.cn
16	中航证券有限公司	注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区2号中航资本大厦35层 法定代表人：王晓峰 联系人：王紫雯 电话：010–59562468 传真：010–59562637 客服电话：95335 网址：http://www.avicsec.com/
17	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

14.1.2 二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司

14.2 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系人：陈文祥

电话：021–68419095

传真：021–68870311

14.3 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系人：黎明

电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

经办律师：黎明、孙睿

14.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：曹阳

联系电话：021–23238888

传真：021–23238800

经办注册会计师：薛竞、曹阳

§15 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"重要提示"部分，对"重要提示"进行了更新。

2、在"基金的投资"部分，对"基金投资组合报告"进行了更新，对"基金业绩"进行了更新。

3、在"基金管理人"部分，对"基金管理人概况"进行了更新，对"主要人员情况"进行了更新。

4、在"基金托管人"部分，对"基金托管人"进行了更新。

5、在"相关服务机构"部分，对"销售机构"进行了更新。

6、在"基金份额持有人服务"部分，对"基金份额持有人服务"进行了更新。

7、在"其他应披露事项"部分，对"其他应披露事项"进行了更新。

8、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理股份有限公司
2019年7月31日

南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金赎回费率优惠活动的公告

2019–7–31

南方基金管理股份有限公司(以下简称"本公司")直销柜台自2015年10月14日至2019年7月31日开展了本公司旗下部分指数型证券投资基金赎回费率的优惠活动。为更好的满足投资者的理财需求，本公司决定自2019年8月1日起，继续开展部分指数型基金在本公司直销柜台的赎回费率优惠活动。现将有关事宜公告如下：

一、适用基金

南方300联接A（基金代码：202015）、南方500A（基金代码：160119）、南方深成A（基金代码：202017）、南方小康A（基金代码：202021）、南方380（基金代码：202025）、南方中证500增强A（基金代码：002906 ）、南方创业板ETF联接A（基金代码：002656）、南方中证500信息技术ETF联接A（基金代码：002900）、南方中证全指证券公司ETF联接A （基金代码：004069）、南方中证申万有色金属ETF联接A（基金代码：004432）、南方中证银行ETF联接A（基金代码：004597）、南方中证全指房地产ETF联接A（基金代码：004642）、南方恒生H股联接A（基金代码：005554）、南方MSCI中国A股ETF联接A（基金代码：005788）、南方中证100A（基金代码：202211）和南方恒生ETF联接A（基金代码：501302）。

二、适用渠道

南方基金管理股份有限公司直销柜台

办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32–42楼 邮编：518017

全国统一客户服务电话：400 889 8899

传真：0755–82763900

公司网站：www.nffund.com

该业务暂不适用本基金其他销售渠道。

三、适用时间

自2019年8月1日起继续开展费率优惠活动。该费率优惠活动如有变化，将另行公告。

四、费率优惠情况

活动期间，凡通过本公司直销柜台申请赎回的投资者，在赎回时，赎回费享有如下优惠：

费用种类	基金名称	持有期限	原赎回费率	优惠赎回费率
赎回费	南方300联接A 南方500A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.50% 0.50% 0.30% 0%	1.50% 0.1251% 0.0751% 0%
	南方深成A 南方小康A 南方380	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.50% 0.50% 0.25% 0%	1.50% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证500增强A	持有期<7日 7日≤持有期<30日 30日≤持有期<3个月 3个月≤持有期<6个月 6个月≤持有期<1年 持有期≥1年	1.50% 0.75% 0.50% 0.50% 0.50% 0%	1.50% 0.75% 0.3751% 0.2501% 0.1251% 0%
	南方创业板ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证500信息技术ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证全指证券公司ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证申万有色金属ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证银行ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证全指房地产ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方恒生H股联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方MSCI中国A股ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<1年 1年≤持有期<2年 持有期≥2年	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%
	南方中证100A	持有期<7天 7天≤持有期<30天 30天≤持有期<3个月 3个月≤持有期<6个月 6月≤持有期<1年 持有期≥1年	1.5% 0.75% 0.5% 0.5% 0.3% 0%	1.5% 0.75% 0.3751% 0.2501% 0.0751% 0%
	南方恒生ETF联接A	持有期<7天 7天≤持有期<180天 180天≤持有期<365天 持有期≥365天	1.5% 0.5% 0.25% 0%	1.5% 0.1251% 0.06252% 0%

本次活动仅适用于在费率优惠期间、通过直销柜台赎回的投资者，不适用于基金份额的转换转出业务。

五、重要提示

1、投资者可通过以下途径咨询详情：

南方基金管理股份有限公司

客户服务电话：400 889 8899

公司网站：www.nffund.com

2、风险提示

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，也不保证最低收益。基金的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，投资有风险，投资人在投资本公司旗下基金前请仔细阅读基金的法律文件。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司
2019年7月31日