南华中证杭州湾区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2号

基金管理人：南华基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
二零二零年一月
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2018年5月15日证监许可【2018】819号文注册募集。本基金基金合同于2018年12月14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。

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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是跟踪中证杭州湾区指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等。

本基金采用完全复制法跟踪标的指数“中证杭州湾区指数”，具有与标的指数相似的风险收益特征。同时，本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资人办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到影响。

投资人投资本基金时需具有上海证券交易所A股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证杭州湾区指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资人需要使用中证杭州湾区指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

投资有风险，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》等信息披露文件，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收益，由投资人自行负担。

本招募说明书所载内容截止日为2019年12月13日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年9月30日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

第一部分基金管理人

一、基金管理人概况
名称：南华基金管理有限公司
住所：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼
办公地址：北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦三层
邮政编码：100007
法定代表人：朱坚
成立日期：2016年11月17日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]2371号
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理及中国证监会许可的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：15亿元人民币
联系人：吴海燕
联系电话：4008105599
股权结构：南华期货股份有限公司占公司注册资本的100%。
存续期间：持续经营
二、主要人员情况
1、董事会成员
叶柯先生：董事长，博士。1992年参加工作，先后在中国证监会期货监管部、中国证监会稽查二局、中国证监会期货监管二部和南华期货股份有限公司工作。2016年12月加入南华基金管理有限公司。
朱坚先生：董事，硕士。1993年7月至1996年7月先后在职于浙江新华期货经纪有限公司、浙江远通期货经纪有限公司、浙江工城期货经纪有限公司；1996年7月至2002年6月任浙江金通期货经纪有限公司营业部经理；2002年6月至2004年11月任浙江新华期货经纪有限公司总经理助理；2004年11月至2008年7月在南华期货股份有限公司从事业务管理工作，自2008年7月起任南华期货股份有限公司总经理助理。2018年8月加入南华基金管理有限公司，现任南华基金管理有限公司总经理，代任督察长。
马易升先生：董事，博士。2010年参加工作，任职于横店集团控股有限公司，担任企业运营分析部部长。
陈松男先生：独立董事，博士。1978年参加工作，先后就职于马里兰大学、台湾政治大学，上海交通大学高级金融学院。历任马里兰大学教授、台湾政治大学教授兼系主任、上海交通大学高级金融学院教授。
王艳涛先生：独立董事，法学学士。1998年参加工作，先后在北京市嘉和律师事务所、国浩律师集团（北京）事务所、北京市海铭律师事务所、北京市荣诚律师事务所工作。历任北京市嘉和律师事务所律师、国浩律师集团（北京）事务所律师、北京市海铭律师事务所合伙人律师、北京市荣诚律师事务所工作主任律师。
朱国华先生：独立董事，硕士研究生。1983年参加工作，任职于上海财经大学。曾兼任上海金鹏期货经纪公司董事长、总经理。现任上海财经大学教授、博士生导师。
2、监事会成员
根据公司《章程》第六十六条规定，公司不设监事会，设一名执行监事，执行监事由职工代表连省担任。
连省先生：执行监事，大专，2000年7月至2005年10月就职于中国工商银行资产托管部，2005年11月至2006年10月就职于申万巴黎基金管理公司基金营运总部担任基金会计，2006年11月至2016年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司运作部从事注册登记。2016年12月加入南华基金管理有限公司。
3、高级管理人员
叶柯先生：董事长，简历同上。
朱坚先生：总经理，代任督察长，简历同上。
王明德先生：硕士，现任南华基金管理有限公司副总经理，1999年至2000年任职于北京中怡康经济咨询有限责任公司，担任研究员。2000年至2002年任职于北京国际信托投资公司，担任研究员。2002年至2011年任职于国都证券有限责任公司，历任研究所副所长、所长。2011年至2015年任职于东兴证券股份有限公司，担任研究所所长。2015年至2017年任职于弘德基金管理有限公司，担任总经理助理兼投研总监。2017年4月加入南华基金管理有限公司，现任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年4月10日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019年4月11日起任职）。
曾媛：学士学位，现任南华基金管理有限公司副总经理。2003年7月至2006年12月于招商银行深圳上步支行，任客户经理；2007年1月至2010年7月于华泰柏瑞基金管理有限公司，任商极渠道经理。2010年8月至2012年4月于上投摩根基金管理有限公司，任华南区域中心代销总监。2014年1月至2015年6月于圆信永丰基金管理有限公司，任金融渠道总监兼华南区总经理。2015年8月至2019年9月于信达澳银基金管理有限公司，任销售总监。2019年9月加入南华基金管理有限公司。
蔡晓永先生：大专，现任南华基金管理有限公司首席信息官。2006年8月至2019年7月，在南华期货股份有限公司网络工程部工作，2009年7月起先后任该部门副经理、经理职务。2019年8月入职南华基金管理有限公司。
周昱峰先生：经济学硕士，主册会计师。现任南华基金管理有限公司总经理助理，量化投资与产品负责人。历任华夏证券有限公司交易部、经纪业务管理总部高级经理。华泰柏瑞基金管理有限公司销售理总部总监。方正富邦基金管理有限公司产品总监。方元富邦创赢资产管理有限公司副总经理，投资经理。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年12月14日起任职）。
蔡峰先生：经济学博士，现任南华基金管理有限公司总经理助理。2010年至2016年任职于国元证券股份有限公司金融工程部；2016年至2018年任职于华商基金管理有限公司机构投资二部，2018年7月加入南华基金管理有限公司。
4、基金经理
周昱峰先生：经济学硕士，主册会计师。现任南华基金管理有限公司总经理助理，量化投资与产品负责人。历任华夏证券有限公司交易部、经纪业务管理总部高级经理。华泰柏瑞基金管理有限公司销售理总部总监。方正富邦基金管理有限公司产品总监。方元富邦创赢资产管理有限公司副总经理，投资经理。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年12月14日起任职）。
莫志刚先生：硕士，6年以上基金从业经验，4年以上ETF投资研究经验。2013年加入万家基金管理有限公司，先后任职信息技术部系统工程师、量化投资部量化研究员，参与多只指数产品的研究开发工作。2018年9月加入南华基金管理有限公司，担任量化投资部基金经理助理，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019年1月18日起任职）。
5、量化投资决策委员会成员
主席：
王明德先生：副总经理，简历同上。
成员：
朱坚先生：总经理，代任督察长，简历同上。
周昱峰先生：经济学硕士，主册会计师。现任南华基金管理有限公司总经理助理，量化投资与产品负责人。历任华夏证券有限公司交易部、经纪业务管理总部高级经理。华泰柏瑞基金管理有限公司销售理总部总监。方正富邦基金管理有限公司产品总监。方元富邦创赢资产管理有限公司副总经理，投资经理。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年12月14日起任职）。
蔡峰先生：经济学博士，现任南华基金管理有限公司总经理助理。2010年至2016年任职于国元证券股份有限公司金融工程部；2016年至2018年任职于华商基金管理有限公司机构投资二部，2018年7月加入南华基金管理有限公司。
莫志刚先生：硕士，5年以上基金从业经验，3年以上ETF投资研究经验。2013年加入万家基金管理有限公司，先后任职信息技术部系统工程师、量化投资部量化研究员，参与多只指数产品的研究开发工作。2018年9月加入南华基金管理有限公司，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019年1月18日起任职）。
上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分基金托管人

一、基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：刘连舸
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人：许俊
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566
二、基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。
三、证券投资基金托管情况
截至2019年9月30日，中国银行已托管721只证券投资基金，其中境内基金681只，QDII基金40只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
四、托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。
2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。
五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第三部分相关服务机构

一、基金份额销售机构
1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）
（1）中国国际金融股份有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：毕建明（代）
联系人：罗文雯
客户服务电话：010-65051166
网址：http://www.cicc.com/
（2）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：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座18层
法定代表人：王常青
联系人：刘芸
电话：010-85156310
客户服务电话：400-888-8108
（3）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人：陈共炎
联系人：辛国政
电话：010-83574507
客户服务电话：4008-888-888或95551
网址：www.chinastock.com.cn
（4）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45层（邮编200031）
法定代表人：李梅
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客服电话：95523或4008895523
国际互联网网址：www.swhysc.com
联系人：陈宇
联系电话：021-33388214
（5）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼
法定代表人：李琦
传真：0991-2301927
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com
联系人：陈宇
联系电话：021-33388214
（6）首创证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
办公地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
法定代表人：毕劲松
联系人：刘宇
电话：010-59366070
客户服务电话：400-620-0620
网址：http://www.sczq.com.cn/
（7）财通证券股份有限公司
住所：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
法定代表人：陆建强
联系人：陶志华
电话：0571-87789160
客户服务电话：95336
网址：http://www.ctsec.com/
（8）浙商证券股份有限公司
住所：浙江省杭州市江干区五星路201号
办公地址：浙江省杭州市江干区五星路201号
法定代表人：吴承根
联系人：张颖超
电话：0571-87001306
客户服务电话：95345
网址：https://www.stocke.com.cn
（9）湘财证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：孙永祥
联系人：江恩前
电话：021-38784580
客户服务电话：95351
网址：http://www.xcsc.com/
（10）国泰君安股份有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨德红
联系人：钟怡凝
电话：021-38676666
客户服务电话：95521/400-8888-666
网址：http://www.gtja.com/
（11）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
联系人：乔琳雪
电话：021-38565547
客户服务电话：95562
网址：http://www.xyzq.com.cn/
（12）华宝证券有限责任公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
电话：021-20657517
客服电话：400-820-9898
网址：https://www.cnhhstock.com/
（13）广发证券股份有限公司
注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场18楼
法定代表人：孙树明
电话：020-87555888
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn
（14）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市益田路江苏大厦38-46层
办公地址：中国深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼
法定代表人：霍达
联系人：黄婵君
电话：0755-82960167
客户服务电话：95565
（15）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：周杰
联系人：徐步夷
电话：021-23154405
客户服务电话：95553/400-8888001
（16）江海证券有限公司
住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号
法定代表人：赵洪波
联系人：姜志伟
电话：0451-87765732
客服电话：400-666-2288
公司网址：www.jhzq.com.cn
（17）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：李颖
联系电话：0755-82130833
客服电话：95536
网址：www.guosen.com.cn
2、二级市场交易代理券商
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。
3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。
二、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：徐一文
电话：010-50938931
传真：010-50938907
三、律师事务所及经办律师
名称：浙江天册律师事务所
住所：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座11楼
办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座8楼、11楼
负责人：章靖忠
电话：0571-87901111
传真：0571-87901501
经办律师：俞晓瑜、刘森
四、会计师事务所及经办注册会计师
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：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
经办注册会计师：张勇、郭慧心
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：张勇

第四部分 基金的名称

南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金

第五部分 基金的类型

股票型、指数型证券投资基金
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

第六部分 基金的投资目标

第七部分基金的投资方向

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）、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）、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、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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90%，且不低于非现金基金资产的80%。因法律法规的规定而受限制的情形除外。
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。

第八部分基金的投资策略

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。
本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金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，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
1、资产配置策略
本基金管理人完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的90%，股指期货、权证、国债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。
2、债券投资策略
本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。
3、资产支持证券投资策略
本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。
4、股指期货投资策略
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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。
5、权证投资策略
本基金将通过对权证标的证券的基本面进行研究，结合多种定价模型和投资策略，根据基金资产组合情况适度进行权证的投资。
6、国债期货投资策略
本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。
未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标及本基金风险收益特征的前提下，根应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。

第九部分基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证杭州湾区指数。
中证杭州湾区指数由中证指数有限公司发布。如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的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原标的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人合法权益的原则，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，并提交中国证监会备案且在指定媒介公告。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。

第十部分基金的风险收益特征

本基金属于股票基金，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。

第十一部分基金的投资组合报告

本投资组合的报告期为2019年7月1日起至2019年9月30日止（财务数据未经审计）。
（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	100,012,533.17	97.87
	其中：股票	100,012,533.17	97.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	770,367.67	0.75
8	其他资产	1,406,055.78	1.38
9	合计	102,188,956.62	100.00

注：股票投资中包含可退替代款估值增值。
（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1.报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	237,534.00	0.24
C	制造业	56,793,830.23	56.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,561,146.60	1.55
E	建筑业	359,234.44	0.36
F	批发和零售业	3,387,756.04	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	7,747,095.08	7.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,497,574.20	11.45
J	金融业	5,797,041.90	5.77
K	房地产业	2,364,997.81	2.35
L	租赁和商务服务业	1,273,814.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	75,810.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,519,966.85	6.49
R	文化、体育和娱乐业	2,120,576.24	2.11
S	综合	-	-
	合计	99,736,367.39	99.28

注：上述股票投资组合不包含可退替代款估值增值。
2.报告期末（非权投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,036.38	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,129.40	0.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	276,165.78	0.27

3.报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期未持有港股通股票投资。
（三）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投资明细
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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	173,017	5,588,449.10	5.56
2	002142	宁波银行	204,080	5,144,856.80	5.12
3	600570	恒生电子	63,040	4,660,547.20	4.64
4	600009	上海机场	56,499	4,507,490.22	4.49
5	600104	上汽集团	177,774	4,227,465.72	4.21
6	300347	泰格医药	59,007	3,661,384.35	3.64
7	600352	浙江龙盛	255,400	3,590,924.00	3.57
8	603806	福斯特	68,846	3,125,608.40	3.11
9	002236	大华股份	176,750	3,052,472.50	3.04
10	002001	新 和 成	126,640	2,708,829.60	2.70

2.积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688368	晶丰明源	2,557	144,930.76	0.14
2	603927	中科软	884	78,198.64	0.08
3	300790	宇瞳光学	671	31,094.14	0.03
4	603786	科博达	816	21,942.24	0.02

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末，本基金未持有债券。
（五）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
报告期末，本基金未持有债券。
（六）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
报告期末，本基金未持有资产支持证券。
（七）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贵金属投资明细
报告期末，本基金未持有贵金属投资。
（八）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权证投资明细
报告期末，本基金未持有权证。
（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内，本基金未参与股指期货交易。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内，本基金未参与国债期货交易。
（十一）投资组合报告附注
1.报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
2、本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。
3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	65,097.19
2	应收证券清算款	1,339,796.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,162.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,406,055.78

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。
（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位：人民币元

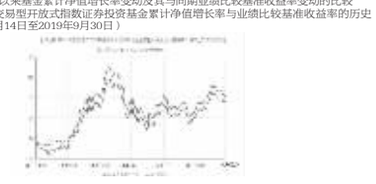
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688368	晶丰明源	144,930.76	0.14	新股流通受限
2	603786	科博达	21,942.24	0.02	新股流通受限

第十二部分基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2019.7.1-2019.9.30	3.70%	1.10%	2.91%	1.13%	0.79%	-0.03%

二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2018年12月14日至2019年9月30日）



注：
（1）本基金基金合同生效日为2018年12月14日，截至本报告披露时点，本基金基金合同生效尚不满1年；
（2）本基金的建仓期为2018年12月14日至2019年6月13日，截至本报告期末，本基金建仓期已结束；建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

第十三部分费用概览

一、与基金运作相关的费用
（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；
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金场内份额收益分配中发生的费用；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、基金上市费及年费；
11、基金相关账户的开户及维护费用；
12、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。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
（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
基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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、公休日、支付日期顺延。
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
基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。
3、C类基金份额的销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.25%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
C类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起5个工作日内或不可抗力