

## 南华基金管理有限公司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

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  
二零二零年六月

## 重要提示

本基金经中国证监会委员会2018年5月15日证监许可【2018】819号文批准募集。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,基金管理人在基金投资管理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,基金分级二级市场交易价格折溢价的风险、参考LOFV/决策和LOFV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、退伙基金替代方式的风险、基金份额赎回对价的实现风险、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”,具有与标的指数相同的收益特征。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。

投资者申购的基金份额当日可卖出,投资者赎回获得的股票当日可卖出。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赎,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,基金运行状况、基金份额净值、交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2020年6月13日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2020年3月31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:1.5亿元人民币  
联系人:吴海燕  
联系电话:4008105699  
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、董事及高级管理人员  
叶柯先生:董事、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月先后任职于浙江新华期货经纪有限公司、浙江汇诚期货经纪有限公司,2000年7月至2002年6月任浙江金迪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月任南华期货股份有限公司从事业务管理工作,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。

马易先生:董事、博士。2010年参加工作,任职于横店集团控股有限公司,担任企业运营部副总经理。

陈松先生:独立董事,博士。1970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主任、上海交通大学高级金融学院教授。

王艳鸿先生:独立董事,法学硕士。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)律师事务所、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)律师事务所律师、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。曾兼任上海金朋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管理部,2005年11月至2006年10月就职于申万巴黎基金管理公司基金运营总监担任基金会计,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,简历同上。

朱坚先生:总经理,简历同上。

路秀妍女士:汉语言文学专业,学士学位,现任南华基金管理有限公司,1992年参加工作,先后在北京建行信托投资公司、浙江钱塘航空集团有限公司、信达期货有限公司、南华期货股份有限公司工作。2017年9月29日至2018年12月3日担任南华基金管理有限公司总经理。

曾智:硕士,现任南华基金管理有限公司副总经理。2003年7月至2006年12月于招行深圳上步支行,任客户经理;2007年1月至2010年7月于华泰瑞基金投资管理有限公司,任高级渠道经理。2010年8月至2013年6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月于广发永丰基金管理有限公司,任全国渠道总监兼华南区总经理。2015年8月至2019年9月于信达瑞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。

周昱峰先生:经济学硕士,注册会计师。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、华泰瑞基金投资管理有限公司营销管理总部总监、工银瑞信基金管理有限公司产品总监。2017年3月加入南华基金管理有限公司。

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年任职于华泰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  
莫坚刚先生:硕士,现任南华基金管理有限公司量化投资部基金经理。2013年4月1日至2018年8月30日在国泰基金管理有限公司量化投资部任职研究员,于2018年9月5日入职南华基金管理有限公司量化投资部,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)、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金链接基金经理(2020年4月23日起任职)。

5、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,简历同上。

曹进先生:硕士,注册会计师,现任南华基金管理有限公司固定收

益部基金经理。2008年至2010年任职于毕马威华振会计师事务所,担任审计师。2010年至2015年任职于泰康资产管理有限责任公司,担任年金投资部投资经理。2015年至2017年任职于泓德基金管理有限公司交易部,担任中央交易员、债券交易主管。2017年3月加入南华基金管理有限公司,现任南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理(2019年1月19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)、南华价值航纯债债券型证券投资基金基金经理(2019年11月22日起任职)、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理(2020年1月19日起任职)。

徐超先生:硕士,现任南华基金管理有限公司基金经理。2006年7月至2008年11月任中美大都会人寿保险股份有限公司顾问行销市场部高级助理;2008年11月至2012年6月任中信国寿国际评级有限公司金融评级部总经理助理/高级分析师;2012年9月至2015年6月任泰达宏利基金管理有限公司固定收益部高级研究员;2015年6月至2019年4月任方正富邦基金管理有限公司基金投资部任职,期间曾任基金经理;2019年4月加入南华基金管理有限公司,现任南华瑞恒混合型发起式证券投资基金基金经理(2019年9月10日起任职)、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理(2020年1月17日起任职)。

莫坚刚先生:硕士,现任南华基金管理有限公司基金经理,2006年7月至2008年11月任中美大都会人寿保险股份有限公司顾问行销市场部高级助理;2008年11月至2012年6月任中信国寿国际评级有限公司金融评级部总经理助理/高级分析师;2012年9月至2015年6月任泰达宏利基金管理有限公司固定收益部高级研究员;2015年6月至2019年4月任方正富邦基金管理有限公司基金投资部任职,期间曾任基金经理;2019年4月加入南华基金管理有限公司,现任南华瑞恒混合型发起式证券投资基金基金经理(2019年9月10日起任职)、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理(2020年1月17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:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾柒万零壹仟肆佰

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:信息部联系人: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及以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,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、OPII、ROPII、ODII、境外三类机构、券商资管计划、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,是国内领先的大型托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至2020年3月31日,中国银行已托管780只证券投资基金,其中境内基金35只,OPII基金45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

中国银行托管业务风险管理与控制工作是中国银行全面风险管理工作的组成部分,秉承中国银行风险管理理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务风险管理控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施制定及制度建设、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师对托管业务部开展托管业务内部控制评价工作。先于获得基于“SAS70”、“AAFO106”、“IAEA3402”和“SSAE16”的国际内部控制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“IAEA3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内部控制完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

五、托管人的内部风险控制制度

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法反律、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。基金管理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法反律、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)中国银河金融股份有限公司

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:罗文霞

客户服务电话:010-65051166

网址: http://www.ciccc.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号号楼

办公地址:北京市朝阳区朝内大街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:010-85163101

客户服务电话:400-988-9108

(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:400-888-8888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:021-33399888

客户服务电话:021-33398224

客服电话:95523或4008895623

国际互联网网址: www.swwhysccom

联系人:陈宇

联系电话:021-33382124

(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:021-33382124

(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:毕海松

联系人:刘宇

电话:010-59366070

客户服务电话:400-620-0620

网址: http://www.szcq.com