（上接B054版）

| | | |
|---|---|---|
| 84 | 太平洋证券股份有限公司 | 注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层<br>办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元<br>法定代表人：李长伟<br>联系人：谢兰<br>电话：010-83321613<br>传真：010-83321763<br>客服电话：400-665-0999<br>网址：www.tpyzq.com |
| 85 | 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室<br>办公地址：中国杨浦区昆明路508号北美广场8座12F<br>法定代表人：汪静波<br>联系人：徐诚<br>电话：021-38509639<br>传真：021-38509777<br>客服电话：400-821-5399<br>网址：www.noah-fund.com |
| 86 | 深圳众禄基金销售有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、4单元<br>办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资投控置地大厦8楼<br>法定代表人：薛峰<br>联系人：童彩平<br>电话：0755-33227950<br>传真：0755-33227951<br>客服电话：4006-788-887<br>网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com |
| 87 | 上海好买基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号<br>办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室，上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼<br>法定代表人：杨文斌<br>联系人：张茹<br>电话：021-20613999<br>传真：021-68596916<br>客服电话：400-700-9665<br>网址：www.ehowbuy.com |
| 88 | 杭州数米基金销售有限公司 | 注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室<br>办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼<br>法定代表人：陈柏青<br>联系人：张裕<br>电话：021-60897840<br>传真：0571-26697013<br>客服电话：4000-766-123<br>网址：http://www.fund123.cn/ |
| 89 | 上海长量基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室<br>办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层<br>法定代表人：张跃伟<br>联系人：单丙烨<br>电话：021-20691832<br>传真：021-20691861<br>客服电话：400-089-1289<br>网址：www.erichfund.com |
| 90 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层<br>办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座8楼<br>法定代表人：其实<br>联系人：潘世友<br>电话：021-54509998<br>传真：021-64385308<br>客服电话：400-1818188<br>网址：www.1234567.com.cn |
| 91 | 北京展恒基金销售有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号<br>办公地址：北京市朝阳区建外门外华严北里2号民建大厦6层<br>法定代表人：闫振杰<br>联系人：翟飞飞<br>电话：010-62020088<br>传真：010-62020355<br>客服电话：4008980661<br>网址：www.myfund.com |
| 92 | 浙江同花顺基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室<br>办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼<br>法定代表人：凌顺平<br>联系人：杨翼<br>电话：0571-88911818-8653<br>传真：0571-86800423<br>客服电话：4008-773-772<br>网址：www.5ifund.com |
| 93 | 中期资产管理有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号<br>办公地址：北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层<br>法定代表人：朱剑林<br>联系人：侯凤建<br>电话：010-65807805<br>传真：010-65807864<br>客服电话：010-65807609<br>网址：http://www.cifcfund.com |
| 94 | 万银财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内<br>办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内<br>法定代表人：王斐<br>联系人：廉亮<br>电话：010-53300532<br>传真：010-59393074<br>客服电话：400-081-6655<br>网址：www.wy-fund.com |
| 95 | 和讯信息科技有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层<br>办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层<br>法定代表人：王莉<br>联系人：张紫薇<br>电话：0755-82021122<br>传真：0755-82029055<br>客服电话：4009200022<br>网址：licaike.hexun.com |
| 96 | 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809<br>办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809<br>法定代表人：戎伟樑<br>联系人：程刚<br>电话：010-62185713<br>传真：010-85894285<br>客服电话：4006099200<br>网址：www.yixinfund.com |
| 97 | 浙江金观诚财富管理有限公司 | 注册地址：杭州市拱墅区嘉兴东路8号3幢三楼3034室<br>办公地址：杭州市拱墅区登云路43号金诚集团（锦昌大厦）13楼<br>法定代表人：陆彬彬<br>联系人：邓秀男<br>电话：0571-88337734<br>传真：0571-88337666<br>客服电话：400-068-0068<br>网址：www.jincheng-fund.com |
| 98 | 泛华普益基金销售有限公司 | 注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室<br>办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室<br>法定代表人：于海锋<br>联系人：邓鹏<br>电话：13981713068<br>传真：028-82000996-805<br>客服电话：400-8588588<br>网址：http://www.pyfund.cn |
| 99 | 嘉实财富管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号8座46楼06-10单元<br>办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号8座46楼06-10单元<br>法定代表人：赵学军<br>联系人：景琪<br>电话：021-20289890<br>传真：021-20280110<br>客服电话：400-021-8850<br>网址：www.harvestwm.cn |
| 100 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#<br>办公地址：北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层<br>法定代表人：杨鹏<br>联系人：刘宝文<br>电话：010-58328286<br>传真：010-58328282<br>客服电话：4008707771<br>网址：https://8.jrjr.com.cn |
| 101 | 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室<br>办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层<br>法定代表人：梁静<br>联系人：陈琴<br>电话：010-57756019<br>传真：010-57756199<br>客服电话：400-786-8998-5<br>网址：www.chtfund.com |
| 102 | 北京钱景财富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012<br>办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012<br>法定代表人：赵荣春<br>联系人：魏华<br>电话：010-57418829<br>传真：010-57568671<br>客服电话：400-678-5095<br>网址：www.niujf.net |
| 103 | 深圳宜投基金销售有限公司 | 注册地址：深圳市南山区粤海兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼1815房（人社深圳市前海商务秘书有限公司）<br>办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405<br>法定代表人：毕建强 联系人：黄品龙<br>电话：0755-23601676 传真：0755-89603185 客服电话：4008958811<br>网址：www.ucfund.cn |
| 104 | 深圳前海汇联基金销售有限公司 | 注册地址：深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研究大楼1815<br>办公地址：深圳市南山区软件产业基地4栋B座三楼<br>法定代表人：万勇<br>联系人：贾莉莉<br>联系电话：0755-86722853<br>传真：0755-86725180<br>客服电话：0755-86722851<br>网址：http://www.dyingfund.com.cn |
| 105 | 中国国际期货有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、3层、11层-12层<br>办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层<br>法定代表人：王兵<br>联系人：赵微<br>电话：010-59539864<br>传真：010-59539985<br>客服电话：95162，400-8888-160<br>网址：www.cifco.net |
| 106 | 北京创金启富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A<br>办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A<br>法定代表人：梁蓉<br>联系人：张丽丽<br>电话：010-66154828-809<br>传真：010-88067526<br>客服电话：010-88067525<br>网址：www.5irich.com |
| 107 | 海银基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东南路2250号2幢三层B367室<br>办公地址：上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼<br>法定代表人：刘世灌<br>联系人：刘艳妮<br>电话：021-80133827<br>传真：021-80133413<br>客服电话：4008081016<br>网址：www.fundhaiyin.com |
| 108 | 其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。 | |

（二）、登记机构

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6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

法定代表人：吴万善

电话：（0755）82763849

传真：（0755）82763889

联系人：古和鹏

（三）、律师事务所和经办律师

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：韩炯

联系人：黎明

电话：（86 21）3135 8666

传真：（86 21）3135 8600

经办律师：吕红 黎明

（四）、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号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办会计师：薛竞、陈熹

四、基金的名称

南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类别

股票型证券投资基金、联接基金

六、基金的投资目标

通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、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、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、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）。

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。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

八、基金的投资策略

本基金以目标ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。

（一）资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。

（二）目标ETF投资策略

本基金投资目标ETF的两种方式如下：

（1）申购和赎回：目标ETF开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。

（2）二级市场方式：目标ETF上市交易后，在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

本基金将在目标ETF上市交易、开放申购赎回3个月内，使得本基金投资目标ETF的比例满足基金合同有关投资比例的要求。

（三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即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动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（四）债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时着重考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

（五）股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

九、标的指数和基金的业绩比较基准

本基金标的指数为中证指数有限公司所编制并发布的沪深300指数及其未来可能发生的变更。

本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止沪深300指数的编制、发布或授权，或沪深300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沪深300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，或目标ETF标的指数发生变更，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，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，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。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。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司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，投资者在作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2014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（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 34,933,262.32 | 3.01 |
| | 其中：股票 | 34,933,262.32 | 3.01 |
| 2 | 基金投资 | 1,059,934,908.01 | 91.47 |
| 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 | 55,283,443.69 | 4.77 |
| 8 | 其他资产 | 8,601,364.76 | 0.74 |
| 9 | 合计 | 1,158,752,978.78 | 100.00 |

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 115,980.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 2,736,632.24 | 0.24 |
| C | 制造业 | 11,146,293.99 | 0.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,122,542.35 | 0.10 |
| E | 建筑业 | 1,687,767.67 | 0.15 |
| F | 批发和零售业 | 850,619.14 | 0.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,448,647.50 | 0.13 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,893,413.06 | 0.25 |
| J | 金融业 | 9,945,377.15 | 0.86 |
| K | 房地产业 | 1,301,741.69 | 0.11 |
| L | 租赁和商务服务业 | 287,653.75 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 951,418.20 | 0.08 |
| 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 | 288,365.58 | 0.03 |
| S | 综合 | 156,810.00 | 0.01 |
| | 合计 | 34,933,262.32 | 3.03 |

1.3 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

| 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 | 002065 | 东华软件 | 49,400 | 1,033,448.00 | 0.09 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 23,969 | 990,878.46 | 0.09 |
| 3 | 600637 | 百视通 | 29,000 | 927,710.00 | 0.08 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 82,666 | 858,899.74 | 0.07 |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 135,876 | 847,866.24 | 0.07 |
| 6 | 600705 | 中航资本 | 44,200 | 832,286.00 | 0.07 |
| 7 | 600832 | 东方明珠 | 72,500 | 791,700.00 | 0.07 |
| 8 | 600018 | 上港集团 | 147,465 | 781,564.50 | 0.07 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 57,296 | 585,565.12 | 0.05 |
| 10 | 601669 | 中国电建 | 188,500 | 550,420.00 | 0.05 |

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

1.5 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

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 南方300 | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理有限公司 | 1,059,934,908.01 | 91.98 |

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

1.12 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

1.13 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

1.14 投资组合报告附注

1.15

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。

1.15.1

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。

1.16 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 109,598.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,996,709.47 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 8,612.66 |
| 5 | 应收申购款 | 486,444.36 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 8,601,364.76 |

1.17 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处于转股期的可转换债券。

1.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002065 | 东华软件 | 1,033,448.00 | 0.09 | 重大事项 |
| 2 | 600637 | 百视通 | 927,710.00 | 0.08 | 重大资产重组 |
| 3 | 600705 | 中航资本 | 832,286.00 | 0.07 | 重大资产重组 |
| 4 | 600832 | 东方明珠 | 791,700.00 | 0.07 | 重大资产重组 |
| 5 | 600018 | 上港集团 | 781,564.50 | 0.07 | 重大事项 |

十三、基金的业绩

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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2009.3.25--2009.12.31 | 38.03% | 1.80% | 46.40% | 1.86% | –8.37% | –0.06% |
| 2010.1.1--2010.12.31 | –12.31% | 1.51% | –11.73% | 1.50% | –0.58% | 0.01% |
| 2011.1.1--2011.12.31 | –23.89% | 1.24% | –23.73% | 1.23% | –0.16% | 0.01% |
| 2012.1.1--2012.12.31 | 8.28% | 1.21% | 7.43% | 1.22% | 0.85% | –0.01% |
| 2013.1.1--2013.12.31 | –6.12% | 1.33% | –7.05% | 1.33% | 0.93% | 0.00% |
| 2014.1.1--2014.9.30 | 7.28% | 0.95% | 5.08% | 0.94% | 2.2% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.49% | 1.37% | 3.43% | 1.37% | –2.94% | 0.00% |

注：根据2013年5月16日中国证监会《关于核准南方沪深300指数证券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金投资范围等事项决议的批复》（证监许可[2013]674号），变更了投资范围并更名为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

十三、基金费用概览

一、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、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金的指数使用费；

9、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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）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扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分基金资产，若为负数，则E取0

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2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。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）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扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分基金资产，若为负数，则E取0

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2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。

3、如将来本基金收取指数使用费，本基金管理人将根据与指数许可方签订的指数许可使用协议，从基金财产中计提指数使用费。具体费率及计提方式，将在更新的招募说明书中规定。

上述“（一）、基金费用的种类”中第3－9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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

（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。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金提供两种申购费用的支付模式。本基金在申购时收取的申购费用称为前端申购费用，在赎回时收取的申购费用称为后端申购费用。基金投资者可以选择支付前端申购费用或后端申购费用。

本基金前端申购费率最高不高于1.2%，且随申购金额的增加而递减，后端申购费率最高不高于1.4%，且随持有时间的增加而递减，如下表所示：

前端收费：

| 购买金额（M） | 申购费率 |
|---|---|
| M＜100万 | 1.2% |
| 100万≤M＜500万 | 0.7% |
| 500万≤M＜1000万 | 0.2% |
| M≥1000万 | 每笔1000元 |

后端收费（其中1年为365天）：

| 购买金额（M） | 申购费率 |
|---|---|
| N＜1年 | 1.4% |
| 1年≤N＜2年 | 1.2% |
| 2年≤N＜3年 | 1.0% |
| 3年≤N＜4年 | 0.7% |
| 4年≤N＜5年 | 0.4% |
| N≥5年 | 0 |

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费?

本基金赎回费率不高于0.5%，随申请份额持有时间增加而递减（其中1年为365天）。具体如下表所示：

| 申请份额持有时间（N） | 赎回费率 |
|---|---|
| N＜1年 | 0.5% |
| 1年≤N＜2年 | 0.3% |
| N≥2年 | 0 |

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于25%。

3、?本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

三、其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它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“基金管理人”部分，对基金管理人主要情况进行了更新。

2、在“基金托管人”部分，对基金托管人的主要情况进行了更新。

3、在“相关服务机构”部分，对本基金的代销机构和其他相关服务机构进行了更新。

4、在“基金的投资”部分，对本基金最近一期投资组合报告和基金的业绩进行了更新。

5、在“风险揭示”部分，增加投资股指期货的风险提示。

6、在“基金份额持有人服务”部分，对部分服务内容进行了更新。

7、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。

南方基金管理有限公司

二〇一四年十二月二十七 日