南方恒生交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

一、重要声明与提示

《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，南方恒生交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人南方基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者阅读刊登在《证券时报》等报刊及南方基金管理有限公司网站（www.nffund.com）上的《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金
2、基金二级市场交易简称：恒指ETF
3、二级市场交易代码：513600
4、基金申购、赎回简称：恒指ETF
5、申购、赎回代码：513601
6、截至公告日前两个工作日即2015年1月19日基金份额总额：148,829,500.00份
7、截至公告日前两个工作日即2015年1月19日基金份额净值：1.8780元
8、本次上市交易份额：148,829,500.00份
9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
10、上市交易日期：2015年1月26日
11、基金管理人：南方基金管理有限公司
12、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
13、上市推荐人：中信证券股份有限公司
14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银证券有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、上海证券有限责任公司、海证券有限责任公司、西南证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2014年12月2日证监许可[2014]1297号。
2、基金运作方式：交易型开放式。
3、基金合同期限：不定期。
4、发售日期：2014年12月9日至2014年12月17日。其中，网下现金发售的日期为2014年12月9日至2014年12月17日，网上现金发售的日期为2014年12月15日至2014年12月17日。
5、发售价格：人民币1.00元。
6、发售期限：网下网上发售认购7个工作日，网上现金认购3个工作日。
7、发售方式：基金管理人可以开通网上现金认购和网下现金认购2种方式。
8、发售机构：
（1）直销机构
投资者可以通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。
（2）代销机构
网下现金发售代理机构：华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、山西证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、中航证券有限公司、新时代证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、天源证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司。
网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、诚信证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、开源证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、天源证券有限公司、万和证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西南证券股份有限公司、西藏同信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。
上述销售机构标准不分先后。
（二）基金的司法效
本基金根据中国证监会证监许可[2014]1297号文批准，自2014年12月9日起公开募集，截止2014年12月17日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为286,959,921.00元人民币，折合基金份额286,959,921.00份；经基金登记结算机构确认转转为基金份额的募集期间认购资金利息共计9,921.00元人民币，折合基金份额9,921.00份，归基金份额持有人所有；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息共计70,220.25元，计入基金财产。募集资金已于2014年12月23日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购总户数为2864户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计286,959,921.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本基金管理人南方基金管理有限公司基金从业人员投有认购本基金，本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和基金经理认购本基金份额总量的数量区间为0。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。
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》以及《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2014年12月23日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。
（三）基金份额折算
根据《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，南方基金管理有限公司（下简称“本基金管理人”）确定2015年1月15日为南方恒生交易型开放式指数证券投资基金的份额折算日。当日恒生指数收盘值为24,350.91点，估值汇率为0.78918，本基金资产净值为286,012,480.64元，折算前基金份额总额为286,959,921.00份。
根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.51864772，折算后基金份额总额为148,829,500.00份，折算后基金份额净值为1.9217元。
本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司于2015年1月16日完成了变更登记。折算后的基金份额计算至整数位（小数部分舍去，舍去部分计入基金财产）。
（四）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2015】6号
2、上市交易日期：2015年1月26日
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
4、基金二级市场交易简称：恒指ETF
5、二级市场交易代码：513600
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。
6、基金申购、赎回简称：恒指ETF
7、申购、赎回代码：513601
本基金管理人自2015年1月26日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。
目前本基金的一级交易商包括：华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、上海证券有限责任公司、西南证券股份有限公司。上述排名不分先后。本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时公告。
8、本次上市交易份额：148,829,500.00份
9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2015年1月19日，本基金份额持有人户数为2864户，平均每户持有的基金份额为51,965.61份。
（二）持有人结构
截至2015年1月19日，本基金份额持有人结构如下：
机构投资者持有的基金份额为63,958,028.00份；占基金总份额的42.97%；个人投资者持有的基金份额为84,871,472.00份，占基金总份额的57.03%。
（三）前十名基金份额持有人情况
截至2015年1月19日，前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额的比例(%)
1	生命人寿保险股份有限公司-投连-进取1号	10,376,267.00	6.97%
2	山东世界贸易中心	10,372,954.00	6.97%
3	浙商证券-农行-浙商汇金1号集合资产管理计划	10,372,954.00	6.97%
4	王安成	7,779,715.00	5.23%
5	宏信证券有限责任公司	4,149,976.00	2.79%
6	中信证券股份有限公司	4,149,184.00	2.79%
7	安信证券股份有限公司	4,149,181.00	2.79%
8	国泰君安证券股份有限公司	3,630,534.00	2.44%
9	江苏恒生工贸实业有限公司	3,630,534.00	2.44%
10	上海证券有限责任公司	3,111,886.00	2.09%
	合计	61,723,182.00	41.47%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：南方基金管理有限公司
2、法定代表人：吴万善
3、总裁：杨小松
4、注册资本：3亿元人民币
5、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
6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301103129537
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
9、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%；兴业证券股份有限公司10%。
10、内部组织结构及职能：

委员会名称	职责
投资决策委员会	指导基金管理的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则
风险控制委员会	研究制定风险管理政策和制度，提出重大风险的解决方案，指导和监督各职能部门开展风险管理工作
估值委员会	负责公司估值原则的确定及调整；对特殊品种及特殊情况的估值予以确定。
信息技术治理委员会	负责公司中长期信息技术的规划及信息技术治理工作。
市场营销与产品委员会	审议公司营销、宣传、产品设计等方案；督促并指导市场体系各部门的工作；
年金投资决策委员会	对年金大类资产配置进行决策。

部门名称	职能定位
投资部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
专户投资管理部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作
数量化投资部	负责数量化基金、指数基金的投资运作及数量化投资策略、金融工程的研究
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
养老金业务部	负责企业年金基金的市场开拓与服务
机构业务部	负责机构直销及一对一专户产品的业务拓展及服务工作
会员部	负责品牌及产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护
市场管理部	负责对各分公司监督管理、代销渠道总部的开发及维护、渠道经理的培训等
北京分公司	
上海分公司	负责所辖片区的渠道、机构销售业务及政府部门、监管机构、行业协会的公共关系维护和相关接待及后勤服务工作
合肥分公司	
成都分公司	
深圳分公司	
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
客户服务部	为基金持有人提供专业服务及投资理财资讯服务
合肥理财中心	CALL-CENTER，客户营销及服务中心
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理
风险管理部	负责投资风险识别、评估、控制，应急处理及业绩归因分析
交易管理部	负责执行基金、组合交易指令，实施一线风险监控
信息技术部	负责信息技术平台建设、保障业务开展
远作保障部	负责投资交易与产品销售的后台清算、核算及投资运作的定期信息披露
人力资源部	负责人力资源管理与服务，使公司获取并保持人力资源竞争优势
综合管理部	负责办公管理、后勤保障及公司社会公益事业建设，党务及共青团、工会工作
基建办	负责公司办公大楼的基建工作

11、人员情况：
截止到2014年12月，我公司共有员工417人，博士19人、硕士229人、本科149人、其他20人。
12、信息披露负责人：鲍文革
咨询电话：400-889-8899
13、基金管理业务情况简介：
截至2014年12月底，南方基金管理有限公司旗下共管理57只开放式基金及多只专户产品，社保投资组合和企业年金投资组合，管理总资产规模约2800亿元人民币，旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南方多利、南稳成号、南方绩优、南方隆元、南方成份、南方价值、南方盛元、南方恒元、南方300联接、南方500、深成ETF、南方深成、南方全球、南方策略、小康ETF、南方小康、南方广利、南方金砖、南方成长、南方50债、南方保本、380ETF、南方380、南方沪深300、南方中国、南方消费、南方金利、南方两元、南方理财14天、南方金粮油、南方理财60天、南方安心、南方收益宝、500ETF、300ETF、南方永利、南方中票、南方稳利、南方丰元、南方聚利、南方医保、南方现金通、南方新优享、南方通利、中国梦基金、南方新金宝、南方天元、南方启元、南方绝对收益、南方恒指ETF、南方医药ETF、南方理财金；以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。
7、本基金基金经理简介
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，任南方恒生基金经理。
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16月至今，南方恒生ETF基金经理。
（二）基金托管人
1、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：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010-66105799
信息披露负责人：赵会军
2、主要人员情况
截至2014年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工207人，平均年龄30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。
3、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、安心账户资金、企业年金基金、OFII资产、ODII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2014年9月，中国工商银行共托管证券投资基金393只，自2003年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《金球托管人》、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45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。
（三）上市推荐人
公司名称：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
法定代表人：王东明
联系人：顾凌
联系电话：010-60838696
传真：010-60833739
客服电话：95555
公司网站：www.cs.ecitic.com
（四）一级交易商

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：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦 法定代表人：吴万善 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 公司网站：http://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号国际企业大厦C座 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：陈有安 联系人：宋朋 联系电话：010-66568450 客服电话：4008-888-888 公司网站：www.chinastock.com.cn
3	齐鲁证券有限公司	注册地址：山东省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：吴阳 电话：0531-68889155 传真：0531-68889185 客服电话：95538 网址：www.qlzq.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：北京市朝阳区安立路66号4号楼 法定代表人：王常青 联系人：权唐 联系电话：010-85130588 客服电话：4008888108 公司网站：www.csc108.com
5	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：王东明 联系人：顾凌 电话：010-60838696 传真：010-60833739 客服电话：95558 公司网站：www.cs.ecitic.com
6	申银万国证券股份有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层 法定代表人：储晓明 联系人：曹晔 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523或4008895523 网址：www.swsc.com
7	中信证券(浙江)有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层 办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层 法人代表：沈强 邮政编码：310016 联系人：王丽萍 联系电话：0571-87112507 公司网站：www.bigsun.com.cn 客户服务中心电话：95548
8	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风华大厦16号 法定代表人：牛冠兴 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 公司网站：www.essence.com.cn
9	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：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层 法定代表人：杨宝林 联系人：吴忠超 联系电话：0532-85022326 客服电话：95548 公司网站：www.citicsd.com
10	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市西藏中路336号 法定代表人：奚迪雄 联系电话：021-53519888 联系人：许俊华 公司网站：www.shzq.com 客服电话：4008918918，021-962518
11	西南证券股份有限公司	注册地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 法定代表人：余维佳 联系人：张煜 电话：023-63786633 传真：023-63786212 客服电话：4008-096-096 网址：www.swc.com.cn

（五）验资机构
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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
执行事务合伙人：杨绍信
联系人：陈寨
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办注册会计师：汪楗　陈寨

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
截至公告前两个工作日即2015年1月19日，本基金资产负债表如下：

金额单位：人民币元

资产	2015年1月19日
资产：	
银行存款	27,989,559.40
结算备付金	8,233,487.16
存出保证金	4,592,265.28
交易性金融资产	253,997,975.78
其中：股票投资	253,997,975.78
基金投资	–
债券投资	–
资产支持证券投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	–
应收证券清算款	–
应收利息	79,852.20
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	294,893,139.82
负债和所有者权益	2015年1月19日
负债：	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	15,032,594.48
应付赎回款	–
应付管理人报酬	105,942.73
应付托管费	21,188.55
应付销售服务费	–
应付交易费用	208,982.33
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	28,256.32
负债合计	15,396,964.41
所有者权益：	
实收基金	286,959,921.00
未分配利润	-7,463,745.59
所有者权益合计	279,496,175.41
负债和所有者权益总计	294,893,139.82

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2015年1月19日，本基金的投资组合情况如下：
（一）基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	253,997,975.78	86.13
	其中：普通股	253,997,975.78	86.13
	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	–	–
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	36,223,046.56	12.28
8	其他各项资产	4,672,117.48	1.58
9	合计	294,893,139.82	100.00

（二）在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	253,997,975.78	90.88
合计	253,997,975.78	90.88

（三）按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	146,268,017.08	52.33%
能源	20,265,874.58	7.25%
电信服务	21,667,075.97	7.75%
公用事业	12,823,405.26	4.59%
信息技术	24,547,132.80	8.78%
工业	12,235,316.06	4.38%
非必需消费品	8,386,345.22	3.00%
必需消费品	7,804,808.81	2.79%
合计	253,997,975.78	90.88%

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。
（四）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

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值比例(%)
1	HSBC Holdings plc	汇丰控股有限公司	00005	香港	中国香港	549,600	30,370,017.46	10.87%
2	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	00700	香港	中国香港	232,700	22,610,600.34	8.09%
3	China Mobile Limited	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	253,000	19,386,633.77	6.94%
4	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	01299	香港	中国香港	498,800	17,672,561.06	6.32%
5	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	00939	香港	中国香港	3,485,000	16,903,699.06	6.05%
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	3,055,000	13,152,803.01	4.71%
7	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	3,290,000	10,863,825.43	3.89%
8	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	02628	香港	中国香港	308,000	7,201,998.50	2.58%
9	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	108,000	6,927,720.91	2.48%
10	Hutchison Whampoa Limited	和记黄埔有限公司	00013	香港	中国香港	88,000	6,777,942.60	2.43%

注：所用证券代码采用当地市场代码。
（五）按债券信用等级分类的债券投资组合
本基金于2015年1月19日未持有债券。
（六）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
本基金于2015年1月19日未持有债券。
（七）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
本基金于2015年1月19日未持有资产支持证券。
（八）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
本基金于2015年1月19日未持有金融衍生品。
（九）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
本基金于2015年1月19日未持有基金。
（十）投资组合报告附注
1、本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。
2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3、其他资产构成如下：

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,592,265.28
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	79,852.20
4	应收股利	–
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,672,117.48

4、持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金于2015年1月19日未持有处于转股期的可转换债券。
5、前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金于2015年1月19日前十名股票中不存在流通受限情况。
6、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将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将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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，基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为中信证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资人可在办公时间免费查阅。
（一）中国证监会准予本基金注册的文件；
（二）《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
（三）《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
（四）《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
（五）法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件和营业执照
（七）基金托管人业务资格批件和营业执照
风险提示：本基金上市首日开盘参考价为上市首日前两个工作日的基金份额净值。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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

南方基金管理有限公司
2015年1月21日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
（一）基金份额持有人的权利与义务
基金投资人持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人权利包括但不限于：
（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
（7）监督基金管理人的投资运作；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：
（1）认真阅读并遵守《基金合同》，招募说明书等信息披露文件；
（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
（4）缴纳基金认购款项、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
（9）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。
（二）基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
（7）根据相关市场规则，为基金开设证券、期货账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；
（8）选择