上证380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：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
截止日：2015年09月16日

重要提示

本基金经中国证监会2011年7月14日证监许可[2011]1096号文核准募集。本基金基金合同于2011年9月16日生效。

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。

在投资本基金前，投资者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，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，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。

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2015年9月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日（未经审计）。

§1基金管理人

1.1基金管理人概况

名称：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六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

成立时间：1998年3月6日

法定代表人：吴万善

注册资本：3亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：鲍文革

南方基金管理有限公司是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。2010年，经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。2014年公司进行增资扩股，注册资本金达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%。

1.2主要人员情况

1.2.1董事会成员

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁。现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

张涛先生，董事，中共党员，毕业于河海大学技术经济及管理专业，获博士学位。1994年8月加入华泰证券，历任总裁秘书、投资银行一部业务经理、上海总部投资银行业务部副总经理、公司董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任、副总裁、党委委员。现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员；华泰长城期货有限公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

姜健先生，董事，中共党员，毕业于南京林业大学经济及管理专业，获硕士学位。1994年12月加入华泰证券并一直在华泰证券工作，历任人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行总部股票事务部副总经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部经理、资产管理总部总经理、投资银行总部业务总监、总裁助理、副总裁、董事会秘书等职务。现任华泰证券股份有限公司的副总裁、党委委员、董事会秘书；华泰联合证券有限责任公司董事、华泰紫金投资有限责任公司董事、江苏股权交易中心有限责任公司董事长、华泰瑞通投资管理有限公司董事、江苏银行股份有限公司董事、证通股份有限公司董事。

夏桂英女士，董事，中共党员，高级经济师，26年法律公司管理经济工作从业经历。毕业于中国政法大学法律专业，获法学硕士学位。曾先后担任中国政法大学中国法制研究所教师、深圳市人大法工委办公室主任科员、深圳市光通发展有限公司办公室主任、深圳市投资管理公司总法律顾问、深圳市对外劳动服务有限公司党总支书记、董事长等职。2004年10月加入深圳市投资控股有限公司，历任法律事务部部长、企业一部部长职务。现任深圳市投资控股有限公司副总经理、深圳市通产集团有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司董事、深圳市城市建设开发（集团）公司董事、深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司董事。

项建国先生，董事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于中南财经大学财务会计专业。曾在江西财经大学任教并担任审计教研室副主任，其后在深圳蛇口信德会计师事务所、深圳市商贸投资控股公司、深圳市投资控股有限公司任职，历任深圳市投资控股有限公司投资部部长、投资发展部部长、企业一部部长、战略发展部部长，长期从事投融资、股权管理、股东事务等工作。现任深圳市投控产业园区开发运营公司副总经理、中国深圳对外贸易（集团）有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司监事、华润五丰肉类食品（深圳）有限公司董事、深圳市建筑设计研究总院有限公司董事。

李自成先生，董事，中共党员，硕士研究生学历。历任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、厦门国际信托有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司总经理。

庄园芳女士，董事，工商管理硕士，经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人，证券投资部副总经理、总经理，投资总监；现任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业创新资本管理有限公司董事、兴证（香港）金融控股有限公司董事。

杨小松先生，总裁，中共党员，经济学硕士，注册会计师。历任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。2012年加入南方基金，担任督察长，现任南方基金管理有限公司董事、总裁、党委副书记。

姚景源先生，独立董事，经济学硕士。历任国家经委副处长、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，国务院学位委员会、教育部全国金融硕士专业学位教学指导委员会委员。历任东南大学经济管理学院助教、讲师、副教授、教授，现任南京大学工程管理学院院长、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、江苏省省委决策咨询专家、上海证券交易所上市委员会委员及公司治理委员会委员、上海证券交易所、深圳证券交易所、国信证券等单位的博士后指导导师，中国金融学年会常务理事、国家留学基金会评审专家、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，香港证券及投资学会高级资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)，香港证券及期货专员办事处，及香港证券及期货事务监察委员会，退休前为该会的法规执行部总监。其后曾任该会法规执行部顾问及香港汇业集团控股有限公司独立非执行董事。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，中共党员，经济学硕士，20年以上证券从业经历。毕业于财政部科研所，曾任职于北京市财政局、深圳蛇口中华会计师事务所、京都会计师事务所等机构，先后担任干部、经理、副主任等工作。现担任致同会计师事务所（特殊普通合伙）董事合伙人，中国证监会上市公司并购重组专家咨询委员会委员职务。

周蕊女士，独立董事，硕士研究生学历，曾工作于北京市万商天勤（深圳）律师事务所、北京市中伦（深圳）律师事务所、北京市信利（深圳）律师事务所，现任北京市金杜（深圳）律师事务所华南区管理合伙人，全联并购公会广东分会副会长、广东省律师协会女律师委员会副主任、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深圳市中小企业公共服务联盟副主席、深圳市易尚展示股份有限公司独立董事。

1.2.2监事会成员

舒本娥女士，监事，15年的证券行业从业经历。毕业于杭州电子工业学院会计专业，获学士学位。曾任职于熊猫电子集团公司，担任财务处处长工作。1998年10月加入华泰证券，历任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负责人、计划财务部总经理；华泰联合证券有限责任公司监事会主席、华泰长城期货有限公司副董事长、华泰紫金投资有限责任公司董事、华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士，监事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于深圳广播电视大学会计学专业。曾在浙江兰溪马涧米厂、浙江兰溪纺织机械厂、深圳市建筑机械动力公司、深圳市建设集团、深圳市建设投资控股公司工作，2004年深圳市投资控股有限公司成立至今，历任公司计划财务部副经理、经理，财务预算部副部长，长期从事财务管理、投融资、股权管理、股东事务等工作，现任深圳市投资控股有限公司考核分配部部长，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、深圳市国际招标有限公司董事、深圳市深投物业发展有限公司董事。

苏荣坚先生，监事，中共党员，学士学位，高级经济师。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务总监兼财务部总经理。

林红珍女士，监事，投资经济管理专业学士学位，后参加人民大学金融学院研究生进修班。曾任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，1994年进入兴业证券，先后担任计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、财务会计部计划财务部经理、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）、兴业证券风险管理部总经理，现任兴业证券股份有限公司财务部总经理、兴业创新资本管理有限公司监事。

苏民先生，职工监事，博士研究生，工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师，华夏证券深圳分公司电脑部经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监；现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

张德伦先生，职工监事，中共党员，硕士学历。历任北京邮电大学副教授、华为技术有限公司处长、汉唐证券人力资源部总经理、海王生物人力资源总监、华信惠悦咨询公司副总经理、首席顾问，2010年1月加入南方基金管理有限公司，现任人力资源部总监。

徐超先生，职工监事，工商管理硕士。曾担任建设银行深圳分行科技部开发中心副经理，2000年10月加入南方基金管理有限公司，历任信息技术部主管、总监助理、副总监、执行总监，现任运作保障部总监。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，先后担任金杜律师事务所证券业务部实习律师、浦东发展银行深圳分行资产保全部职员、银华基金管理有限公司监察稽核部法务主管、民生加银基金管理有限公司监察稽核部职员，2008年12月加入南方基金管理有限公司，历任监察稽核部经理、高级经理、总监助理，现任监察稽核部执行总监。

1.2.3公司高级管理人员

吴万善先生，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，中共党员，工商管理硕士，经济师，历任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。2003年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员、南方资本管理有限公司董事长兼总经理。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000年加入南方基金，历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司，2002年加入南方基金，历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员，华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理、投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005年加入南方基金，曾任督察长兼监察稽核部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委委员。

常克川先生，副总裁，中共党员，EMBA工商管理硕士。历任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，联合证券（现为华泰联合证券）董事会秘书、合规总监等职务；2011年加入南方基金，任职董事会秘书、纪委书记，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记、南方资本管理有限公司董事。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士。曾任美国AXA Financial 公司投资部高级分析师，2002年加入南方基金管理有限公司，历任高级研究员、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、总经理助理兼固定收益投资总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士。历任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，1998年加入南方基金，历任运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总经理助理，现任南方基金管理有限公司督察长、南方资本管理有限公司董事。

1.2.4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12月至今，任南方恒生ETF基金经理。

柯晓先生，美国纽约大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006年加入南方基金，任首席产品设计师；2010年8月至今，任小康ETF及南方小康基金经理；2013年4月至今，任南方深成及南方深成ETF的基金经理；2013年5月至今，任南方上证380ETF及联接基金的基金经理；2015年7月至今，任南方互联基金的基金经理。

1.2.5投资决策委员会成员

总裁杨小松先生，副总裁兼固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司（香港）董事李海鹏先生，总裁助理兼权益投资总监史博先生，交易管理部总监王珂女士，投资部总监陈键先生，专户投资管理部总监蒋峰先生，固定收益部总监韩亚庆先生。

1.2.6上述人员之间不存在近亲属关系。

§2基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。于2014年末，中国建设银行市值约为2,079亿美元，居全球上市银行第四位。

于2014年末，本集团资产总额167,441.30亿元，较上年增长8.99%；客户贷款和垫款总额94,745.23亿元，增长10.30%；客户存款总额128,986.75亿元，增长5.53%。营业收入5,704.70亿元，较上年增长12.16%；其中，利息净收入增长12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%；成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元，较上年增长6.89%；净利润2,282.47亿元，增长6.10%。资本充足率14.87%，不良贷款率1.19%，拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户，个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到1.37万个，综合柜员占比达到80%，综合营销团队1.75万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销3,989.83亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破1万个、结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量6,593万张，消费交易额16,580.81亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长14.18%，金融资产增长18.21%。

2014年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2；在英国《金融时报》全球500强排名第29位，新兴市场500强排名第3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部、长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末，中国建设银行已托管514只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、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

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

§3相关服务机构

3.1销售机构

3.1.1申购赎回代理证券公司

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：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	兴业证券股份有限公司	注册地址：福州市湖东路268号 办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层 法定代表人：兰荣 联系人：夏中苏 联系电话：0591-38281963 客服电话：95562 公司网站：www.xyzq.com.cn
3	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：邓颤 联系电话：010-66568292 客服电话：4008-888-888 公司网站：www.chinastock.com.cn
4	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：王开国 电话：021-23219000 传真：021-23219100 联系人：李笑鸣 客服电话：95553 公司网站：www.htsec.com
5	广发证券股份有限公司	注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房） 办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄岚 统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点 公司网站：广发证券网http://www.gf.com.cn
6	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦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：黄耀华 联系人：刘阳 联系电话：0755-83516289 客服电话：0755-33680000 4006666888 公司网站：www.cgws.com
7	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 公司网站：www.swhysc.com
8	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闸路1508号 办公地址：上海市静安区新闸路1508号 法定代表人：薛峰 联系人：刘晨 联系电话：021-22169999 客服电话：95525，10108998 公司网站：www.ebscn.com
9	中国中投证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元 办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层 联系人：刘毅 联系电话：0755-82023442 传真0755-82026539 客服电话：400-600-8008、95532 公司网站：www.china-invs.cn
10	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2005室 法定代表人：李季 电话：010-88085858 传真：010-88085195 联系人：李巍 客户服务电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com
11	湘财证券股份有限公司	办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层 法定代表人：林俊波 联系人：吴昊 联系电话：021-68634510-8620 客服电话：400-888-1551 公司网站：www.xcsc.com
12	信达证券股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 法定代表人：张志刚 联系人：唐静 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：400-800-8899 公司网站：www.cindasc.com
13	东方证券股份有限公司	注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层 办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层 法定代表人：潘鑫军 联系人：胡月茹 联系电话：021-63325888 客服电话：95503 公司网站：www.dfzq.com.cn
14	东北证券股份有限公司	注册地址：长春市自由大路1138号 办公地址：长春市自由大路1138号 法定代表人：杨树财 联系人：安岩岩 联系电话：0431-85096517 客服电话：4006000686，0431-85096733 公司网站：www.nesc.cn
15	国联证券股份有限公司	注册地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 办公地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 法定代表人：姚志勇 联系人：沈刚 联系电话：0510-82831662 客服电话：95570 公司网站：www.glsc.com.cn
16	渤海证券股份有限公司	注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址：天津市南开区宾水西道8号 法定代表人：王春峰 联系人：蔡霆 电话：022-28451991 传真：022-28451892 客服电话：400-651-5988 网址：www.bhzq.com
17	平安证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 法定代表人：谢永林 联系人：石静武 联系电话：021-38631117 客服电话：95511-8 公司网站：stock.pingan.com
18	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：方晓丹 电话：0512-65581136 传真：0512-65588021 客服电话：4008601555 网址：http://www.dwjq.com.cn/
19	红塔证券股份有限公司	注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼 办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼 法定代表人：况雨林 联系人：高国泽 联系电话：0871-63577946 公司网站：http://www.hongtastock.com
20	华宝证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼 法定代表人：陈林 联系人：刘闻川 电话：021-68778790客服电话：4008209898 公司网站：www.cnhbstock.com
21	华福证券有限责任公司	注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层 办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层 法定代表人：黄金琳 联系人：张宗锐 电话：0591-87383600 传真：0591-87383610 客服电话：96326（福建省外请先拨0591） 公司网站：www.hfzq.com.cn
22	国元证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路179号 办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座25层 法定代表人：蔡咏 联系电话：0551-2634400 客服电话：全国统一热线95578，4008888777，安徽省内热线96888 公司网站：www.gyzq.com.cn
23	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层 办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层 法定代表人：何其聪 联系人：高洋 联系电话：010-68546709 客服电话：95571 公司网站：www.foundersc.com
24	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	

3.1.2二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

3.2登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：010-59378982

传真：010-59378907

联系人：程爽

3.3出具法律意见书的律师事务所

名称：广东华瀚律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室

负责人：李兆良

电话：(0755)82687860

传真：(0755)82687861

经办律师：杨忠、戴瑞冬

3.4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号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈熹

经办会计师：薛竟、陈熹

§4基金名称

上证380交易型开放式指数证券投资基金

§5基金的类型

股票型证券投资基金

§6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。

§7基金的投资范围

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券、股指期货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95%，权证、股指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。

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。

§8基金的投资策略

8.1投资策略

（一）投资策略

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，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。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

（二）投资管理体制和程序

（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

本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、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

（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。

研究支持：金融工程小组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。

投资决策：投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告，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。

组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成份股重的方法构建组合。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。

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。

投资绩效评估：金融工程小组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、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

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、基金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，密切跟踪标的指数。

基金管理人