南方全球精选配置证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：境内：中国工商银行股份有限公司 境外：纽约梅隆银行
截止日：2018年03月19日

重要提示

南方全球精选配置证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2007年8月31日证监基金字[2007]244号文核准募集，基金合同已于2007年9月19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。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。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，并承担基金投资中出现的风险，一是境外投资产品风险，包括海外市场风险、汇率风险、政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险、金融模型风险等。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2018年3月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日（未经审计）。

§ 1 基金名称

南方全球精选配置证券投资基金

§ 2 基金的类型

基金中基金

§ 3 基金的投资目标

通过基金全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，在降低组合波动性的同时，实现基金资产的最大增值。

§ 4 基金的投资范围

本基金的投资范围为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的境外交易型开放式指数基金（ETF），主动管理的股票型公募基金，在香港证券市场公开发行、上市的股票，货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合为：对基金和股票投资占本基金基金资产的目标比例为95%，可能比例为60%-100%，其中投资于基金的部分不低于本基金基金资产的60%，投资于股票的部分仅限于香港证券市场公开发行、上市的股票）不高于本基金基金资产的40%；货币市场工具及其他金融工具占本基金基金资产的0-40%。

本基金的基金资产将投资于全球主要证券市场，主要投资于与中国证监会签订了双边监管合作谅解备忘录的国家或地区，投资于与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区的证券资产不得超过基金资产净值的10%。

如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，本基金投资的主要证券市场将相应调整。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

§ 5 基金的投资策略

5.1 投资策略

本基金在基金资产的配置上采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在有效分散风险的基础上，提高基金资产的收益。

（一）战略性资产配置策略（Strategic Asset Allocation）：

1. 在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类（Asset Class）与权重，并定期进行回顾和动态调整。

2. 本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，在基金和股票投资部分，成熟市场和新兴市场资产配置的目标比例为60%-40%，可能比例为60%±15%-40%±15%。本基金根据全球经济以及区域经济发展，结合全球范围的资本流动，确定两类市场具体的资产配置比例并定期进行调整，争取加强基础上的长期发展潜力的资产组合。

（二）战术性资产配置策略（Tactical Asset Allocation）：

在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家或地区的配置比例上采用全球资产配置量化模型进行配置和调整。由于短期市场波动受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险；

1、本基金的大部分资产将投资于ETF基金和股票组基金；

由于在成熟市场，市场效率比较高，投资于ETF可以享受市场发展的平均收益，而在新兴市场中利用系统化基金新品种选流程，构建主动投资组合，创造出超额回报。

（1）ETF的选择标准：

a）指数的代表性；

b）ETF的跟踪误差；

c）流动性。

（2）主动型基金将采取定量和定性相结合的分析方式进行筛选。

a）定性选择：

对基金的选择主要考虑该基金的投资策略是否符合本基金精选配置的投资思路，包括股票和衍生品等的选择方法，以及本基金对投资的稳定性、风险和收益的要求；该基金的管理人应该有较长期良好的历史记录，并且能够即时了解公司人员的变动；该基金的管理人应该有稳健良好的财务状况，有良好的风险控制制度和记录，基金管理人目前管理2,000亿以上资产规模，其经管理念和本基金产品的目标一致或者接近。

b）定量选择：

i. 该基金的过往历史业绩在一定的时间段内好于其业绩基准，或者管理该基金的基金经理有长期优良的表现。

ii. 比较机构（如晨星等基金评级公司）对公司的评级在同类基金中处于中等（50%）以上水平。

iii. 基金的超额收益和标准差的比率（夏普比率）好于同类基金的中值。

iv. 基金买卖证券的交易成本处于同类基金中的合理水平。

2、在香港市场投资公开发行、上市的股票，选股策略为：

在扎实的基本面研究的基础上，发掘企业价值。主要选股标准有：

（1）市场及行业地位（market position）：是否拥有市场主导能力，并能获取超额利润；

（2）估值（intrinsic value）：价格是否被市场低估；

（3）盈利预期（earning surprise）：目标公司盈利稳定并持续增长，超出市场预期；

（4）良好的趋势（investment trend）：目标公司的长期成长被投资者所认同，在资产持续增值的拉动下，股价有良好的上涨趋势。

（三）全融衍生品投资策略

本基金在金融衍生品的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则：

（1）避险：主要用于市场风险大幅紧计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；

（2）有效管理：利用金融衍生品流动性好，交易成本低等特点，通过金融衍生品对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

5.2 投资决策依据和块策程序

（一）决策依据

1、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

2、全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况，各国微观经济运行环境和证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础；

3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本基金推护投资者利益的重要保障。

4、团队投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过投资团队的共同努力与分工协作，由基金经理具体执行投资计划，争取良好投资业绩。

（二）决策程序

本基金的投资管理可分为四个阶段，即资产配置阶段、交易执行阶段、业绩评价阶段和风险管理阶段。

1、资产配置阶段

基金管理人根据中国证监会有关规定、基金合同和全球证券市场的发展情况来确定各类资产配置比例和各类资产投资比例范围。在符合基金合同投资限制的前提下，基金管理人定期对资产配置比例进行调整，具体步骤如下：

（1）召开资产配置讨论会议，对国际宏观经济形势、以及各个市场情况进行分析判断；

（2）根据对各个市场的判断提出区域精选及资产配置比例；

（3）根据投资决策委员会核准的原则，基金经理对资产配置进行调整。

2、交易执行阶段

投资交易指令通过选定的交易券商的全球交易平台执行。

3、业绩评价阶段

采用归因分析等技术手段，评价业绩贡献的构成，为资产配置和组合调整提供依据。

4、风险管理阶段

风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估，并出具风险监控报告。

如果基金管理人选择、更换或撤销境外投资顾问，本基金将在遵循上述投资策略的前提下，对投资决策程序进行适当调整。

§ 6 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：60%×MSCI世界指数（MSCI World Index）+40%×MSCI新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）。

摩根士丹利资本国际指数（MSCI）是摩根士丹利资本国际公司主持开发的一系列全球性证券市场指数，是全球投资组合绩效评估及投资决策的重要参考指标。

摩根士丹利资本国际公司世界指数（MSCI World Index）：为一经市值自由浮动调整后的指数，用以衡量全球成熟市场的股票业绩表现。目前指数涵盖23个成熟市场国家地区。

摩根士丹利资本国际公司新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）：为一经市值自由浮动调整后的指数，用以衡量全球新兴市场的股票业绩表现。目前指数涵盖26个新兴市场国家地区。

本基金采取60%的摩根士丹利资本国际公司世界指数与40%摩根士丹利资本国际公司新兴市场指数之和作为基金的投资基准。指标范围已涵盖全球主要市场，包含48个国家地区市场，充分反映全球股市综合表现，市场中兼具代表性与权威性的指数。该基准不但涵盖了几乎整个全球市场，同时也是反映全球经济成长的良好指标。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

§ 7 基金的风险收益特征

本基金为基金中基金，属于中等偏高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金、高于债券基金及货币市场基金。

§ 8 基金投资组合报告

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，投资者在做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2017年12月31日（未经审计）。

（一）报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,473,926,219.41	31.23
	其中：普通股	1,473,926,219.41	31.23
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	2,857,107,882.77	60.54
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	–	–
	权证	–	–
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	38,290,383.64	0.81
7	银行存款和结算备付金合计	349,758,618.90	7.41
8	其他资产	584,220.51	0.01
9	合计	4,719,667,325.23	100.00

注：1、上述货币市场工具均为货币市场基金投资。

2、本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币1,145,030,801.15元，占基金资产净值比例24.55%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币111,080,176.20元，占基金资产净值比例2.38%。

（二）报告期末在各个国家（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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,473,926,219.41	31.61
合计	1,473,926,219.41	31.61

（三）报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	10,282,930.15	0.22
原材料	–	–
工业	34,367,862.88	0.74
非必需消费品	324,790,874.48	6.96
必需消费品	–	–
医疗保健	191,758,251.36	4.11
金融	269,367,817.95	5.78
科技	514,090,518.10	11.02
通讯	13,249,173.50	0.28
公用事业	116,018,790.99	2.49
合计	1,473,926,219.41	31.61

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

（四）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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港联合交易所	香港	1,608,500	187,431,836.16	4.02
2	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	香港	453,600	153,942,523.06	3.30
3	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	长飞光纤光缆股份有限公司	6869 HK	香港联合交易所	香港	2,517,000	75,533,078.37	1.62
4	Ping An Insurance (Group) Company Of China，Ltd.	中国平安保险集团(股份)有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	1,099,000	74,733,405.07	1.60
5	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	香港	2,777,000	62,907,828.10	1.35
6	China Everbright International Limited	中国光大国际有限公司	257 HK	香港联合交易所	香港	6,340,000	59,144,310.50	1.27
7	Fuyao Glass Industry Group Co.，Ltd.	福耀玻璃工业集团股份有限公司	3606 HK	香港联合交易所	香港	1,738,000	47,870,141.56	1.03
8	The People's Insurance Company (group) Of China Limited	中国人民保险集团股份有限公司	1339 HK	香港联合交易所	香港	14,550,000	46,825,588.43	1.00
9	Beijing Enterprises Water Group Limited	北控水务集团有限公司	371 HK	香港联合交易所	香港	9,252,000	46,789,727.89	1.00
10	Nexteer Automotive Group Limited	耐世特汽车系统集团有限公司	1316 HK	香港联合交易所	香港	2,828,000	44,016,813.80	0.94

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

（七）报告期末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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）报告期末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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

（九）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

金额单位：人民币元

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	WELLINGTON GLOBAL QUALITY GROWTH FUND(威灵顿环球质量成长基金)	股票型基金	开放式	Wellington Management Group LLP(威灵顿管理公司)	481,618,239.66	10.33
2	ROBO GLOBAL ROBOTICS AND AUTOMATION INDEX ETF(Robo全球机器人与自动化指数ETF)	ETF基金	开放式	Exchange Traded Concepts LLC(交易所交易概念公司)	269,993,144.00	5.79
3	WELLINGTON GLOBAL HEALTH CARE EQUITY FUND(威灵顿全球医疗保健股票基金)	股票型基金	开放式	Wellington Management Co LLP(威灵顿管理公司)	210,552,702.76	4.51
4	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF-HK(恒生H股指数上市基金)	ETF基金	开放式	Hang Seng Investment Management Ltd(恒生投资管理有限公司)	197,609,124.00	4.24
5	T.ROWE PRICE FUNDS SICAV-GLOBAL FOCUSED GROWTH EQUITY FUND(T.ROWE PRICE全球焦点成长股票基金)	股票型基金	开放式	T Rowe Price Luxembourg Management Sarl(T Rowe Price卢森堡管理公司)	197,465,614.94	4.23
6	WELLINGTON STRATEGIC EUROPEAN EQUITY FUND(威灵顿战略欧洲资产基金)	股票型基金	开放式	Wellington Management Co LLP(威灵顿管理公司)	173,352,326.00	3.72
7	T ROWE PRICE FUNDS SICAV-GLOBAL TECHNOLOGY EQUITY FUND(T ROWE PRICE全球科技股票基金)	股票型基金	开放式	T Rowe Price Luxembourg Management Sarl(T Rowe Price卢森堡管理公司)	169,268,451.00	3.63
8	INVESCO GLOBAL LEISURE FUND(景顺环球休闲基金)	股票型基金	开放式	INVESCO Management SA (景顺资产管理公司)	163,367,676.35	3.50
9	ALLIANZ JAPAN EQUITY(安联日本股票)	股票型基金	开放式	Allianz Global Investors GmbH (德国安联资产管理公司)	147,568,372.80	3.16
10	ISHARES U.S. AEROSPACE & DEFENSE ETF (iShares安硕美国航空航天与国防ETF)	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors(贝莱德基金管理公司)	122,914,836.20	2.64

（十）投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

3、其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	1,880.80
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	410,477.49
4	应收利息	64,221.76
5	应收申购款	107,640.46
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	584,220.51

4、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。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金业绩

（一）本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准（GIPS）。GIPS是一套确保公司表现得到公平报告和充分披露的投资表现报告道德标准。

1、在业绩表述中采用统一的货币；

2、按既GIPS的相关规定和标准进行计算；

3、如果GIPS的标准与国内现行要求不符时，同时公布不同标准下的计算结果，并说明其差异；

4、对外披露时，需要注明业绩计算标准是符合GIPS要求的。

（二）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。

本投资组合报告所载数据截至2017年12月31日（未经审计）。

（一）报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,473,926,219.41	31.23
	其中：普通股	1,473,926,219.41	31.23
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	2,857,107,882.77	60.54
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	–	–
	权证	–	–
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	38,290,383.64	0.81
7	银行存款和结算备付金合计	349,758,618.90	7.41
8	其他资产	584,220.51	0.01
9	合计	4,719,667,325.23	100.00

注：1、上述货币市场工具均为货币市场基金投资。

2、本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币1,145,030,801.15元，占基金资产净值比例24.55%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币111,080,176.20元，占基金资产净值比例2.38%。

（二）报告期末在各个国家（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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,473,926,219.41	31.61
合计	1,473,926,219.41	31.61

（三）报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	10,282,930.15	0.22
原材料	–	–
工业	34,367,862.88	0.74
非必需消费品	324,790,874.48	6.96
必需消费品	–	–
医疗保健	191,758,251.36	4.11
金融	269,367,817.95	5.78
科技	514,090,518.10	11.02
通讯	13,249,173.50	0.28
公用事业	116,018,790.99	2.49
合计	1,473,926,219.41	31.61

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

（四）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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港联合交易所	香港	1,608,500	187,431,836.16	4.02
2	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	香港	453,600	153,942,523.06	3.30
3	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	长飞光纤光缆股份有限公司	6869 HK	香港联合交易所	香港	2,517,000	75,533,078.37	1.62
4	Ping An Insurance (Group) Company Of China，Ltd.	中国平安保险集团(股份)有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	1,099,000	74,733,405.07	1.60
5	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	香港	2,777,000	62,907,828.10	1.35
6	China Everbright International Limited	中国光大国际有限公司	257 HK	香港联合交易所	香港	6,340,000	59,144,310.50	1.27
7	Fuyao Glass Industry Group Co.，Ltd.	福耀玻璃工业集团股份有限公司	3606 HK	香港联合交易所	香港	1,738,000	47,870,141.56	1.03
8	The People's Insurance Company (group) Of China Limited	中国人民保险集团股份有限公司	1339 HK	香港联合交易所	香港	14,550,000	46,825,588.43	1.00
9	Beijing Enterprises Water Group Limited	北控水务集团有限公司	371 HK	香港联合交易所	香港	9,252,000	46,789,727.89	1.00
10	Nexteer Automotive Group Limited	耐世特汽车系统集团有限公司	1316 HK	香港联合交易所	香港	2,828,000	44,016,813.80	0.94

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

2018年第1号）

理；2018年1月至今，任南方香港成长基金经理。

10.2.5 OD投决会

副总裁兼首席投资官（权益）史博先生、总裁助理兼国际业务部总经理、南方资本管理有限公司董事长刘秀敏女士、南方东英资产管理有限公司总裁丁晨女士、国际业务部董事黄亮先生。

10.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系

§ 11 基金托管人

（一）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：易会满

注册资本：人民币35,640,625.7万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2017年末，中国工商银行资产托管部共有员工230人，平均年龄33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。

（三）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、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII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2017年末，中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、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54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。

（四）基金托管人的职责

1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

9、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11、保存基金管理人就基金投资运作所发出的全部指令的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

12、建立并保存基金份额持有人名册；

13、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14、依据基金管理人的指令或者有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

17、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19、因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20、按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

21、执行法律法规和基金合同赋予基金托管人的其他权利；

22、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。

（五）、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2006、2007、2008、2009、2010、2011、2012、2013、2014年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2015年、2016年中国工商银行资产托管部均通过ISAE3402（原SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责风险控制工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应当涵盖到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告各项管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和风险最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构上、实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，涵盖各项业务。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行开办的一项业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工