

南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要
(2016 年第 2 号)

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：2016 年 12 月 24 日

重要提示

本基金经中国证监会 2015 年 5 月 27 日证监许可[2015]1051 号文注册募集，基金合同于 2015 年 6 月 24 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，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，本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。本基金是指数基金，其特定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，互联网公司未能及时、有效、准确提供数据的风险，基金管理人主动量化选股模型失效导致基金表现不佳的风险；并且，指数的历史业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

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。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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 2016 年 12 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 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：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：张海波

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

张海波先生，董事长，1963 年 9 月出生，籍贯安徽，中共党员，工商管理硕士，十八年证券从业经历，中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员，江苏省人民政府办公厅调研员。1998 年 12 月加入华泰证券，曾任总裁助理、投资银行部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务管理总部总经理、华泰证券副总裁兼华泰紫金投资有限责任公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事长、华泰证券（上海）资产管理有限公司董事长等职务，曾分管投资银行、固定收益投资、资产管理、直接投资、海外业务、计划财务、人力资源等工作。现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员、南方基金管理有限公司董事长。

王连芬女士，董事，1966 年出生，籍贯天津，中共党员，金融专业硕士，二十三年证券从业经历，中国籍。历任赛格集团销售、深圳投资基金管理公司投资一部研究室主任、大

鹏证券经纪业务部副总经理、深圳福虹路营业部总经理、南方总部总经理、总裁助理、第一证券总裁助理、华泰联合证券深圳华强北路营业部总经理、渠道服务部总经理、运营中心总经理、零售客户部总经理、执行办总经理。现任华泰证券股份有限公司总裁助理兼深圳分公司总经理。

张辉先生，董事，1975 年出生，籍贯浙江，中共党员，经济与管理专业博士，十七年证券从业经历，中国籍。历任北京东城区人才交流服务中心职员、华晨集团（香港）上海办事处项目经理、通商控股有限公司资产管理部副经理、北京联创投资管理有限公司资产管理部项目经理、华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理，综合事务部总经理。现任华泰证券股份有限公司人力资源部总经理兼党委组织部长、职工监事。

冯青山先生，董事，1966 年出生，籍贯江西，中共党员，工学学士，中国籍。历任陆军第 124 师工兵营地爆连副连职排长、代政治指导员、师政治部组织科正连职干事、陆军第 42 集团军政治部组织处副营职干事、驻香港部队政治部组织处正营职干事、驻澳门部队政治部正营职干事、陆军第 163 师政治部宣传科副科长(正营职)、深圳市纪委教育调研室主任科员、副处级纪检员、深圳市纪委办公厅副主任、深圳市纪委党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、纪委书记、深圳市投控资本有限公司监事。

李平先生，董事，1981 年出生，籍贯四川，中共党员，工商管理硕士，中国籍。历任深圳市城建集团办公室文秘、董办文秘、深圳市投资控股有限公司办公室（信访办）高级主管。现任深圳市投资控股有限公司企业三部高级主管。

李自成先生，董事，1961 年出生，籍贯福建，中共党员，近现代史专业硕士，中国籍。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、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

王斌先生，董事，1970 年出生，籍贯安徽，中共党员，临床医学博士，中国籍。历任安徽泗县人民医院临床医生、瑞金医院主治医师、兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理。现任兴业证券研究所总经理。

杨小松先生，董事，1970 年出生，籍贯四川，中共党员，会计学硕士，中国籍。曾于 1988 年至 1992 年在沈阳工业大学学习并获得经济学学士学位，于 1992 年至 1995 年在中国人民大学学习并获得经济学硕士学位。历任德勤国际会计师行会计专业翻译、光大银行证券部项目经理、中国证监会国际业务部、上市公司监管部、发行监管部副主任科员、主任科员、副处长、处长、中国证监会上海监管局党委委员、副局长、中国证监会发行监管部副主任、南方基金管理有限公司督察长。现任南方基金管理有限公司总经理、党委副书记。

姚景源先生，独立董事，1950 年出生，籍贯山东，中共党员，经济学硕士，中国籍。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，1966 年出生，籍贯湖南，中共党员，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，中国籍。历任东南大学经济管理学院教授、南京大学工程管理学院院长。现任南京大学-牛津大学金融创新研究院院长、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、交通银行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，1951 年出生，中国香港籍，工商管理博士，香港证券及投资学会高级资深会员。历任香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察、香港证券及期货专员办事处证券主任、香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，1964 年出生，籍贯北京，中共党员，经济学硕士、工商管理硕士、中国注册会计师，中国籍。历任北京市财政局主任科员、深圳蛇口中华会计师事务所经理、京都会计师事务所副主任。现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。

周蕊女士，独立董事，1971 年出生，籍贯广东，民主党派，法学硕士，中国籍。历任北京市万商天勤(深圳)律师事务所律师、北京市中伦(深圳)律师事务所律师、北京市信利(深圳)律师事务所律师、合伙人。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会长、广东省律师协会女律师工作委员会副主任、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深商联公共服务联盟副主席。

1.2.2 监事会成员

吴晓东先生，监事会主席，1969 年出生，籍贯江苏，中共党员，法律博士，中国籍。历任中国证监会法律部法规处副处长、上市公司监管部并购监管处副处长、上市公司监管部公司治理监督处处长、发行监管部发审委处长、华泰证券合规总监、华泰联合证券党委书记、副总裁、董事长。现任南方基金监事会主席。

舒本娥女士，监事，1964 年出生，籍贯江西，大学本科学历，十八年证券从业经历，中国籍。历任熊猫电子集团公司财务处处长、华泰证券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总监、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，1964 年出生，籍贯浙江，中共党员，大学本科学历，高级会计师，中国籍。历任浙江兰溪马涧米厂主管会计、浙江兰溪纺织机械厂主管会计、深圳市建筑机械动力公司会计、深圳市建设集团计划财务部助理会计师、深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理、深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长。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。

王克力先生，监事，1961 年出生，籍贯福建，船舶工程专业学士，中国籍。历任厦门造船厂技术员、厦门汽车工业公司总经理助理、厦门国际信托有限公司国际广场筹建处副主任、厦信置业发展公司总经理、投资部副经理、自有资产管理部副经理职务。现任厦门国际信托有限公司投资发展部总经理。

林红珍女士，监事，1969 年出生，籍贯福建，工商管理硕士，中国籍。历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、兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、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、风险管理部副经理(主持工作)、风险管理部总经理。现任兴业证券财务部、资金运营管理部总经理、兴业创新资本管理有限公司监事。

苏民先生，职工监事，1969 年出生，籍贯安徽，计算机硕士研究生，中国籍。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。现任南方基金风险管理部总监。

张德伦先生，职工监事，1964 年出生，籍贯山东，中共党员，企业管理硕士学历，中国籍。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。现任南方基金人力资源部总监。

林斯彬先生，职工监事，1977 年出生，籍贯广东，民商法专业硕士，中国籍。历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、银华基金监察稽核部法务主管、民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金监察稽核部执行总监。

1.2.3 公司高级管理人员

张海波先生，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, 中国籍。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。

朱运东先生, 副总裁, 中共党员, 经济学学士, 中国籍。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, 中国籍。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, 中国籍。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, 中国籍。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、首席投资官(固定收益)、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, 中国籍。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

雷俊先生, 北京大学智能科学系硕士, 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, 现任数量化投资部总监助理; 2014 年 12 月至 2016 年 4 月, 任南方恒生 ETF 基金经理; 2015 年 4 月至 2016 年 4 月, 任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF 基金经理; 2015 年 6 月至 2016 年 7 月, 任改革基金、高铁基金、南方 500 信息基金经理; 2015 年 4 月至今, 任大数据 100 基金经理; 2015 年 6 月至今, 任南方策略优化、大数据 300、南方量化成长的基金经理。

1.2.5 投资决策委员会成员

总裁杨小松先生, 副总裁兼首席投资官(固定收益)、南方东英资产管理有限公司(香港)董事李海鹏先生, 总裁助理兼首席投资官(权益)史博先生, 交易管理部总监王珂女士, 专户投资管理部总监蒋峰先生, 数量化投资部总监刘治平先生, 研究部总监茅炜先生, 投资部副总监张原先生, 固定收益部副总监夏晨曦先生, 固定收益部副总监李璇女士。

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。本行于 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)。

2015 年末, 本集团资产总额 18.35 万亿元, 较上年增长 9.59%; 客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元, 增长 10.67%; 客户存款总额 13.67 万亿元, 增长 5.96%。净利润 2,289 亿元, 增长 0.28%; 营业收入 6,052 亿元, 增长 6.09%, 其中, 利息净收入增长 4.65%, 手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%, 加权平均净资产收益率 17.27%, 成本收入比 26.98%, 资本充足率 15.39%, 主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展, 综合性网点数量达 1.45 万个, 综合营销团队 2.15 万个, 综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠

道全面转型创新试点, 智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显, 电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%, 较上年提升 7.55 个百分点; 同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式, 成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张, 消费交易额 2.22 万亿元, 多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%, 客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元, 承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元, 增长 67.36%; 托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破, 继伦敦之后, 再获任瑞士、智利人民币清算行资格; 上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年, 本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项, 并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中, 以一级资本总额位列全球第二; 在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部, 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、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 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, 资产托管业务部总经理, 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。

张军红, 资产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。

张力争, 资产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, 资产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 2016 年一季度末,中国建设银行已托管 584 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 年至今连续六年被国际权威杂志《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。资产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

资产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等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,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,对指令要素等内容进行核查。

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和投资独立性等方面进行评价,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 直销机构

南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

法定代表人:张海波

电话:0755-82763905、82763906

传真:0755-82763900

联系人:张锐珊

3.1.2 代销机构

代销银行:

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国建设银行股份有限公司	注册地址: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 电话:010-66275654 传真:010-66275654 联系人:王嘉朔 客服电话:95533

		网址: www.ccb.com
2	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 法定代表人: 易会满 联系人: 陶仲伟 客服电话: 95588 网址: www.icbc.com.cn
3	中国农业银行股份有限公司	注册地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人: 周慕冰 客服电话: 95599 网址: www.abchina.com
4	中国银行股份有限公司	注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人: 田国立 客服电话: 95566 网址: www.boc.cn
5	交通银行股份有限公司	办公地址: 上海市银城中路 188 号 法定代表人: 牛锡明 联系人: 张宏革 联系电话: 021-58781234 客服电话: 95559 网址: www.bankcomm.com
6	招商银行股份有限公司	注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 法定代表人: 李建红 联系人: 邓炯鹏 客服电话: 95555 网址: www.cmbchina.com
7	中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址: 北京市西城区金融大街 3 号 办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号 法定代表人: 李国华 客户服务电话: 95580 联系人: 王硕 传真: (010) 68858117 网址: www.psbc.com
8	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号 办公地址: 上海市中山东一路 12 号 法定代表人: 吉晓辉 联系人: 高天、虞谷云 联系电话: 021-61618888 客服电话: 95528 网址: www.spdb.com.cn

9	广发银行股份有限公司	注册地址: 广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人: 董建岳 联系电话: 0571-96000888, 020-38322222 客服电话: 400-830-8003 网址: www.cgbchina.com.cn
10	中国民生银行股份有限公司	注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人: 洪崎 联系人: 穆婷 电话: 010-58560666 传真: 010-57092611 客服电话: 95568 网址: www.cmbc.com.cn
11	兴业银行股份有限公司	注册地址: 福州市湖东路 154 号 办公地址: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 联系人: 李博 联系电话: 021-52629999-218966 客服电话: 95561 网址: www.cib.com.cn
12	平安银行股份有限公司	地址: 深圳市深南东路 5047 号 法定代表人: 孙建一 联系人: 张莉 联系电话: 021-38637673 客服电话: 95511-3 网址: bank.pingan.com
13	杭州银行股份有限公司	办公地址: 杭州庆春路 46 号 法定代表人: 陈震山 联系人: 严峻 联系电话: 0571-85108309 客服电话: 95398 网址: www.hzbank.com.cn
14	上海银行股份有限公司	注册地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人: 金煜 联系人: 汤征程 联系电话: 021-68475521 客服电话: 95594 网址: www.bankofshanghai.com

15	北京银行股份有限公司	注册地址: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层 办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号 法定代表人: 闫冰竹 联系人: 赵姝 传真: 010-66225309 客户服务电话: 95526 网址: www.bankofbeijing.com.cn
16	北京农村商业银行股份有限公司	注册地址: 北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 办公地址: 北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 法定代表人: 王金山 联系人: 李小鹏 电话: 010-85605054 传真: 010-85605340 客服电话: 96198; 400-88-96198; 400-66-96198 网址: www.bjrcb.com
17	烟台银行股份有限公司	注册地址: 山东省烟台市芝罘区海港路 25 号 办公地址: 山东省烟台市芝罘区海港路 25 号 法定代表人: 叶文君 联系人: 王淑华 电话: 0535-6699660 传真: 0535-6699884 客服热线: 4008-311-777 网址: http://www.yantaibank.net/
18	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址: 上海市浦东新区银城中路 8 号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 8 号 法定代表人: 冀光恒 联系人: 施传荣 联系电话: 021-38523692 客服电话: 021-962999、4006962999 网址: www.srcb.com
19	江苏银行股份有限公司	注册地址: 南京市中华路 26 号 办公地址: 南京市中华路 26 号 法定代表人: 夏平 联系人: 田春慧 电话: 025-58587018 客服电话: 95319 网址: www.jsbchina.cn

20	东莞银行股份有限公司	注册地址: 东莞市莞城区体育路 21 号 办公地址: 东莞市莞城区体育路 21 号 法定代表人: 卢国锋 联系人: 吴照群 联系电话: 0769-22119061 客服电话: 4001196228 网址: www.dongguanbank.cn
21	青岛银行股份有限公司	注册地址: 山东省青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦 办公地址: 山东省青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦 法定代表人: 郭少泉 联系人: 叶旻 联系电话: 0532-68609960 客服电话: (青岛) 96588, (全国) 400-66-96588 网址: www.qdccb.com
22	宁波银行股份有限公司	注册地址: 浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号 办公地址: 浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号 法定代表人: 陆华裕 联系人: 于波涛 联系电话: 0574-87050038 客服电话: 95574 网址: www.nbcb.com.cn
23	汉口银行股份有限公司	注册地址: 武汉市江汉区建设大道 933 号汉口银行大厦 办公地址: 武汉市江汉区建设大道 933 号汉口银行大厦 法定代表人: 陈新民 联系人: 曾武 联系方式: 027-82656704 客服电话: 96558 (武汉)、40060-96558 (全国) 网址: www.hkbchina.com
24	重庆银行股份有限公司	注册地址: 重庆市渝中区邹容路 153 号 办公地址: 重庆市渝中区邹容路 153 号 法定代表人: 甘为民 联系人: 孔文超 电话: 023-63799379 传真: 023-63792412 客服电话: 400-70-96899 网址: www.cqcbank.com

25	深圳农村商业银行股份有限公司	注册地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 办公地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 法定代表人: 李光安 联系人: 王璇 联系电话: 0755-25188269 传真: 0755-25188785 客服电话: 4001961200 网址: www.4001961200.com
26	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 办公地址: 东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦 法定代表人: 何沛良 联系人: 杨亢 电话: 0769-22866270 传真: 0769-22866282 客服电话: 0769-961122 网址: www.drcbank.com
27	哈尔滨银行股份有限公司	注册地址: 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 办公地址: 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 法定代表人: 郭志文 联系人: 吴昊 电话: 0451-87792450 传真: 0451-87792450 客服电话: 95537, 400-60-95537 网址: www.hrbb.com.cn
28	乌鲁木齐银行股份有限公司	注册地址: 乌鲁木齐市新华北路 8 号 办公地址: 乌鲁木齐市新华北路 8 号 法定代表人: 杨黎 联系人: 余戈 电话: 0991-4525212 传真: 0991-8824667 客服电话: 0991-96518 网址: www.uccb.com.cn
29	渤海银行股份有限公司	注册地址: 天津市河东区海河东路 218 号 办公地址: 天津市河东区海河东路 218 号 法定代表人: 李伏安 联系人: 王宏 电话: 022-58316666 传真: 022-58316569 客服电话: 95541 网址: www.cbhb.com.cn

30	河北银行股份有限公司	注册地址: 石家庄市平安北大街 28 号 办公地址: 石家庄市平安北大街 28 号 法定代表人: 乔志强 联系人: 郑夏芳 电话: 0311-67807030 传真: 0311-88627027 客服电话: 400-612-9999 网址: www.hebbank.com
31	大连银行股份有限公司	注册地址: 大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 办公地址: 大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 法定代表人: 陈占维 联系人: 李格格 电话: 0411-82356627 传真: 0411-82356590 客服电话: 400-664-0099 网址: www.bankofd1.com
32	徽商银行股份有限公司	注册地址: 安徽合肥安庆路 79 号天徽大厦 A 座 办公地址: 合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座 法定代表人: 李宏鸣 联系人: 叶卓伟 电话: 0551-62667635 传真: 0551-62667684 客服电话: 4008896588 (安徽省外)、96588 (安徽省内) 网址: www.hsbank.com.cn
33	广东顺德农村商业银行股份有限公司	注册地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号 办公地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号 法定代表人: 姚真勇 联系人: 胡健强 电话: 0757-22386489 传真: 0757-22388235 客服电话: 0757-22223388 网址: www.sdebank.com

34	天津银行股份有限公司	注册地址: 天津市河西区友谊路 15 号 办公地址: 天津市河西区友谊路 15 号 法定代表人: 李宗唐 联系人: 李岩 电话: 022-28405684 传真: 022-28405631 客服电话: 4006-960296 网址: www.bank-of-tianjin.com
35	重庆农村商业银行股份有限公司	注册地址: 重庆市江北区洋河东路 10 号 办公地址: 重庆市江北区洋河东路 10 号 法定代表人: 刘建忠 联系人: 范亮 电话: 023-67637962 传真: 023-67637909 客服电话: 023-966866 网址: www.cqrcb.com
36	包商银行股份有限公司	注册地址: 内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号 办公地址: 内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号 法定代表人: 李镇西 联系人: 张建鑫 联系电话: 010-64816038 传真: 010-64596546 客服电话: 95352 网址: www.bsb.com.cn
37	广州农村商业银行股份有限公司	注册地址: 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 办公地址: 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 法定代表人: 王继康 联系人: 卢媛薇 电话: 020-28852729 传真: 020-22389031 客服电话: 95313 网址: www.grcbank.com
38	珠海华润银行股份有限公司	注册地址: 广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号 办公地址: 广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号 法定代表人: 刘晓勇 联系人: 钟春苗 电话: 0756-8121095 传真: 0756-8121775

		<p>客服电话: 96588 (广东省外加拨 0756), 4008800338 网址: www.crbank.com.cn</p>
39	江苏江南农村商业银行股份有限公司	<p>注册地址: 常州市天宁区延宁中路 668 号 办公地址: 常州市天宁区延宁中路 668 号 法定代表人: 陆向阳 联系人: 包静 电话: 0519-80585939 传真: 0519-89995066 客服电话: 96005 网址: www.jnbank.cc</p>
40	吉林银行股份有限公司	<p>注册地址: 吉林省长春市东南湖大路 1817 号 办公地址: 吉林省长春市东南湖大路 1817 号 法定代表人: 张宝祥 联系人: 孙琦 电话: 0431-84999627 传真: 0431-84992649 客服电话: 400-88-96666 (全国), 96666 (吉林省) 网址: www.jlbank.com.cn</p>
41	威海市商业银行股份有限公司	<p>注册地址: 威海市宝泉路 9 号 办公地址: 济南市经十路奥体金融中心 d 栋 法定代表人: 谭先国 联系人: 武芳 电话: 0531-68978175 传真: 0531-68978176 客服电话: 省内 96636、境内 4000096636 网址: www.whccb.com/www.whccb.com.cn</p>
42	浙江温州龙湾农村商业银行股份有限公司	<p>注册地址: 浙江省温州市龙湾区永中街道永宁西路 555 号 办公地址: 浙江省温州市龙湾区永中街道永宁西路 555 号 法定代表人: 刘少云 联系人: 胡俊杰 电话: 0577-86923223 传真: 0577-86921250 客服电话: 4008296596 网址: www.lwrcb.com</p>

43	西安银行股份有限公司	注册地址: 中国陕西西安高新路 60 号 办公地址: 西安市雁塔区高新路 60 号 法定代表人: 郭军 联系人: 白智 电话: 029-88992881 传真: 029-88992891 客服电话: 4008696779 网址: www.xacbank.com
44	苏州银行股份有限公司	注册地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号 办公地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号 法定代表人: 王兰凤 联系人: 朱瑞良 电话: 0512-69868364 传真: 0512-69868370 客服电话: 96067 网址: www.suzhoubank.com
45	晋商银行股份有限公司	注册地址: 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座 办公地址: 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座 法定代表人: 阎俊生 联系人: 杨瑞 电话: 0351-6819926 传真: 0351-6819926 客服电话: 9510-5588 网址: www.jshbank.com
46	龙江银行股份有限公司	注册地址: 黑龙江哈尔滨市道里区友谊路 436 号 办公地址: 黑龙江哈尔滨市道里区友谊路 436 号 法定代表人: 张建辉 联系人: 闫勇 电话: 0451-85706107 传真: 0451-85706036 客服电话: 4006458888 网址: www.lj-bank.com

47	桂林银行股份有限公司	注册地址: 桂林市中山南路 76 号 办公地址: 桂林市中山南路 76 号 法定代表人: 王能 联系人: 周佩玲 电话: 0773-3810130 传真: 0773-3851691 客服电话: 400-86-96299 网址: www.guilinbank.com.cn.
48	泉州银行股份有限公司	注册地址: 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号 办公地址: 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号 法定代表人: 傅子能 联系人: 陈铮泓 电话: 0595-22551071 传真: 0595-22558871 客服电话: 96312 网址: http://www.qzccb.com/
49	长安银行股份有限公司	注册地址: 西安市高新技术产业开发区高新四路 13 号 1 幢 1 单元 10101 室 办公地址: 西安市高新技术产业开发区高新四路 13 号 法定代表人: 毛亚社 联系人: 闫石 传真: 029-88609566 客服电话: (029) 96669、400-05-96669 网址: www.ccabchina.com
50	锦州银行股份有限公司	注册地址: 辽宁省锦州市松山新区科技路 68 号 办公地址: 辽宁省锦州市松山新区科技路 68 号 法定代表人: 张伟 联系人: 庞璐璐 电话: 0416-3220085 传真: 0416-3220186 客服电话: 400-66-96178 网址: www.jinzhoubank.com
51	浙江乐清农村商业银行股份有限公司	注册地址: 浙江省乐清市城南街道伯乐西路 99 号 办公地址: 浙江省乐清市城南街道伯乐西路 99 号 法定代表人: 高剑飞 联系人: 金晓娇 电话: 0577-61566028 传真: 0577-61566063 客服电话: 4008896596

		网址: www.yqbank.com
52	德州银行股份有限公司	注册地址: 山东省德州市三八东路 1266 号 办公地址: 山东省德州市三八东路 1266 号 法定代表人: 孙玉芝 联系人: 王方震 电话: 0534-2297326 传真: 0534-2297327 客服电话: 40084-96588 网址: www.dzbchina.com
53	潍坊银行股份有限公司	注册地址: 山东省潍坊市胜利东街 5139 号 办公地址: 山东省潍坊市胜利东街 5139 号 法定代表人: 史跃峰 联系人: 张永财 电话: 0536-8050039 传真: 0536-8051916 客服电话: 400-61-96588 网址: www.bankwf.com
54	浙江泰隆商业银行股份有限公司	注册地址: 浙江省台州市路桥区南官大道 188 号 办公地址: 浙江省台州市路桥区南官大道 188 号 法定代表人: 王钧 联系人: 陈妍宇 电话: 0571-87219677 传真: 0576-82453522 客服电话: 400-88-96575 网址: www.zjtlcb.com
55	浙江杭州余杭农村商业银行股份有限公司	注册地址: 浙江省杭州市余杭区南苑街道南大街 72 号 办公地址: 浙江省杭州市余杭区南苑街道南大街 72 号 法定代表人: 来煜标 联系人: 蔡亮 电话: 0571-86209980 传真: 0571-86137150 客服电话: 96596, 4008896596 网址: www.yhrcb.com

56	浙江富阳农村商业银行股份有限公司	注册地址: 杭州市富阳区鹿山街道依江路 501 号第 1 幢 办公地址: 杭州市富阳区鹿山街道依江路 501 号第 1 幢 法定代表人: 马富华 联系人: 陈硕 电话: 0571-63280253 传真: 0571-63360418 客服电话: 4008896596 网址: www.fyrcbk.com
57	长春农村商业银行股份有限公司	注册地址: 吉林省长春市二道区自由大路 5755 号 办公地址: 吉林省长春市绿园区正阳街 4288 号 法定代表人: 马铁刚 联系人: 高然巍 电话: 0431-89115152 传真: 0431-89115154 客服电话: 96888-0-1 网址: http://www.cccb.cn
58	齐商银行股份有限公司	注册地址: 山东省淄博市张店区金晶大道 105 号 办公地址: 山东省淄博市张店区金晶大道 105 号 法定代表人: 杲传勇 联系人: 焦浦 电话: 0533-2178888-9907 传真: 0533-6120373 客服电话: 96588 网址: www.qsbank.cc

代销券商及其他代销机构:

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: 南京市江东中路 228 号 法定代表人: 周易 联系人: 庞晓芸 联系电话: 0755-82492193 客服电话: 95597 网址: 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：柯延超 联系电话：0591-38507950 客服电话：95562 网址：www.xyzq.com.cn
3	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人：何如 联系人：周杨 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
4	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：邓颜 联系电话：010-66568292 客服电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn
5	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：杨德红 联系人：芮敏祺 电话：021-38676666 客服电话：4008888666 网址：www.gtja.com
6	中泰证券股份有限公司	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：许曼华 电话：021-20315290 传真：021-20315137 客服电话：95538 网址：www.zts.com.cn

7	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：周杰 电话：021-23219000 传真：021-23219100 联系人：李笑鸣 客服电话：95553 网址：www.htsec.com
8	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：北京市朝阳区门内大街 188 号 法定代表人：王常青 联系人：权唐 联系电话：010-85130588 客服电话：4008888108 网址：www.csc108.com
9	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、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：丁益 联系人：金夏 联系电话：021-62821733 客服电话：0755-33680000 4006666888 网址：www.cgws.com
10	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层 法定代表人：宫少林 联系人：黄婵君 联系电话：0755-82960167 客服电话：95565、4008888111 网址：www.newone.com.cn
11	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：山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层 法定代表人：张佑君 联系人：顾凌 电话：010-60838696 传真：010-60833739 客服电话：95558 网址：www.cs.ecitic.com

12	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 网址:www.swhysc.com
13	光大证券股份有限公司	注册地址:上海市静安区新闻路 1508 号 办公地址:上海市静安区新闻路 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 网址:www.ebscn.com
14	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 法定代表人:高涛 联系人:万玉琳 联系电话:0755-82026907 传真 0755-82026539 客服电话:400-600-8008、95532 网址:www.china-invs.cn
15	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:李玉婷 客户服务电话:400-800-0562 网址:www.hysec.com
16	湘财证券股份有限公司	办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 楼 法定代表人:林俊波 联系人:李欣 联系电话:021-38784580-8918 客服电话:400-888-1551 网址:www.xcsc.com

17	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：山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层 法定代表人：杨宝林 联系人：赵艳青 联系电话：0532-85023924 客服电话：95548 网址：www.citicssd.com
18	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：尹旭航 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：95321 网址：www.cindasc.com
19	华融证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号 中国人保寿险大厦 12-18 层 法定代表人：祝献忠 基金业务联系人：李慧灵 联系电话：010-85556100 传真：010-85556088 客服电话：400-898-9999 网址：www.hrsec.com.cn
20	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦 办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦 法定代表人：杨炯洋 联系人：谢国梅 联系电话：010-52723273 客服电话：95584 网址：www.hx168.com.cn
21	长江证券股份有限公司	注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 法定代表人：杨泽柱 客户服务热线：95579 或 4008-888-999 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 长江证券客户服务网址：www.95579.com

22	世纪证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40/42 层 办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40/42 层 法定代表人：姜昧军 联系人：袁媛 联系电话：0755-83199511 客服电话：4008323000 网址：www.csc.com.cn
23	东北证券股份有限公司	注册地址：长春市生态大街 6666 号 办公地址：长春市净月区生态大街 6666 号 法定代表人：李福春 联系人：安岩岩 联系电话：0431-85096517 客服电话：95360 网址：www.nesc.cn
24	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼 办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼 法定代表人：李俊杰 联系人：邵珍珍 联系电话：021-53686262 客户服务电话：021-962518 传真：021-53686277 或 021-53686100-7008 网址：www.962518.com
25	江海证券有限公司	注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 法定代表人：孙名扬 联系人：周俊 电话：0451-85863726 传真：0451-82337279 客服电话：400-666-2288 网址：www.jhzq.com.cn
26	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

		网址:www.glsc.com.cn
27	东莞证券股份有限公司	注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 联系人:李荣 联系电话:0769-22115712 传真:0769-22115712 客服电话:95328 网址:www.dgzq.com.cn
28	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.ewww.com.cn
29	平安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 办公地址:深圳市福田区中心区金田路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 网址:stock.pingan.com
30	国都证券股份有限公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 法定代表人:王少华 联系人:黄静 电话:010-84183333 传真:010-84183311-3389 客服电话:400-818-8118 网址:www.guodu.com

31	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: 95330 网址: www.dwzq.com.cn
32	广州证券股份有限公司	注册地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 法定代表人: 邱三发 联系人: 梁微 联系电话: 95396 客服电话: 95396 网址: www.gzs.com.cn
33	南京证券股份有限公司	注册地址: 南京市玄武区大钟亭 8 号 办公地址: 南京市玄武区大钟亭 8 号 法定代表人: 步国旬 联系人: 王万君 联系电话: 025-83367029 客服电话: 95386 网址: www.njzq.com.cn
34	华安证券股份有限公司	注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座 法定代表人: 李工 联系人: 范超 联系电话: 0551-65161821 客服电话: 95318 网址: www.hazq.com
35	浙商证券股份有限公司	办公地址: 杭州杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6-7 楼 法定代表人: 吴承根 联系人: 周存华 电话: 021-80106041 传真: 021-80106010 客服电话: 95345 网址: www.stocke.com.cn

36	华宝证券有限责任公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层 法定代表人：陈林 联系人：刘闻川 电话：021-20515589 传真：021-20515593 客服电话：4008209898 网址：www.cnhbstock.com
37	山西证券股份有限公司	注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 联系人：郭熠 联系电话：0351-8686659 客服电话：400-666-1618, 95573 网址：www.i618.com.cn
38	第一创业证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼 法定代表人：刘学民 联系人：毛诗莉 联系电话：0755-23838750 客服电话：95358 网址：www.firstcapital.com.cn
39	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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼 法定代表人：黄金琳 联系人：郭相兴 电话：021-20655175 传真：021-20655196 客服电话：96326（福建省外请先拨 0591） 网址：www.hfzq.com.cn

40	中山证券有限责任公司	注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层 办公地址：深圳市华侨城深南大道 9010 号 法定代表人：黄扬录 联系人：罗艺琳 联系电话：0755-82570586 客服电话：4001022011 网址： http://www.zszq.com
41	中原证券股份有限公司	注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 法定代表人：菅明军 联系人：程月艳 范春艳 电话：0371-69099882 传真：0371-65585899 客服电话：95377 网址： www.ccnew.com
42	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 法定代表人：吴坚 联系人：张煜 联系电话：023-63786633 客服电话：4008096096 网址： www.swsc.com.cn
43	财达证券股份有限公司	注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层 办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层 法定代表人：翟建强 联系人：马辉 联系电话：0311-66006342 客服电话：4006128888 网址： www.S10000.com
44	德邦证券股份有限公司	注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼 办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼 法定代表人：姚文平 联系人：朱磊 电话：021-68761616 传真：021-68767032 客服电话：4008888128 网址： www.tebon.com.cn

45	中航证券有限公司	<p>注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 办公地址：北京市朝阳区安立路 60 号润枫德尚 6 号楼 3 层中航证券 法定代表人：王宜四 联系人：史江蕊 电话：010-64818301 传真：010-64818443 客服电话：400-8866-567 网址：http://www.avicsec.com/</p>
46	国盛证券有限责任公司	<p>注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 法定代表人：马跃进 联系人：俞驰 联系电话：0791-86283080 客服电话：4008222111 网址：www.gszq.com</p>
47	中国国际金融股份有限公司	<p>注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 办公地址：北京市建国门外甲 6 号 SK 大厦 法定代表人：丁学东 联系人：杨涵宇 联系电话：010-65051166 客服电话：400-910-1166 网址：www.cicc.com.cn</p>
48	大同证券有限责任公司	<p>注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人：董祥 联系人：薛津 电话：0351-4130322 传真：0351-4192803 客服电话：4007121212 网址：http://www.dtsbc.com.cn</p>
49	东海证券股份有限公司	<p>注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼 办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 法定代表人：赵俊 联系人：王一彦 客服电话：95531；400-888-8588</p>

		网址: www.longone.com.cn
50	西部证券股份有限公司	注册地址: 陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层 办公地址: 陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 6 楼 616 室 法定代表人: 刘建武 联系人: 梁承华 电话: 029-87406168 传真: 029-87406710 客服电话: 95582 网址: http://www.westsecu.com/
51	新时代证券股份有限公司	注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法定代表人: 田德军 联系人: 田芳芳 联系电话: 010-83561146 客服电话: 4006989898 网址: www.xsdzq.cn
52	金元证券股份有限公司	注册地址: 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼 办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层 法定代表人: 王作义 联系人: 马贤清 联系电话: 0755-83025022 客服电话: 4008-888-228 网址: www.jyzq.cn
53	万联证券有限责任公司	注册地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层 办公地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层 法定代表人: 张建军 联系人: 王鑫 联系电话: 020-38286651 客服电话: 400-8888-133 网址: www.wlzq.com.cn
54	国金证券股份有限公司	注册地址: 成都市东城根上街 95 号 办公地址: 成都市东城根上街 95 号 法定代表人: 冉云 联系人: 刘婧漪、贾鹏 联系电话: 028-86690057、028-86690058 传真: 028-86690126 客服电话: 95310

		网址: www.gjq.com.cn
55	财富证券有限责任公司	注册地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 办公地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 法定代表人: 蔡一兵 联系人: 郭磊 联系电话: 0731-84403319 客服电话: 400-88-35316 (全国) 网址: www.cfzq.com
56	华龙证券股份有限公司	注册地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 办公地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 4 楼 法定代表人: 李晓安 联系人: 范坤 电话: 0931-4890208 传真: 0931-4890628 客服电话: 95368 网址: www.hlzq.com
57	华鑫证券有限责任公司	注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元 办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号 法定代表人: 俞洋 联系人: 王道 电话: 021-64339000 传真: 021-54967293 客服电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918 网址: www.cfsc.com.cn
58	中天证券股份有限公司	注册地址: 沈阳市和平区光荣街 23 甲 办公地址: 沈阳市和平区南五马路 121 号万丽城晶座 4 楼中天证券经纪事业部 法定代表人: 马功勋 联系人: 王力华 联系电话: 024-23280810 客服电话: 4006180315 网址: www.stockren.com

59	五矿证券有限公司	注册地址: 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元 办公地址: 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元 法定代表人: 赵立功 联系人: 马国栋 电话: 0755-83252843 传真: 0755-82545500 客服电话: 40018-40028 网址: www.wkzq.com.cn
60	大通证券股份有限公司	注册地址: 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层 办公地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层 法定代表人: 赵玺 联系人: 谢立军 电话: 0411-39991807 传真: 0411-39673219 客服电话: 4008-169-169 网址: www.daton.com.cn
61	天相投资顾问有限公司	注册地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 办公地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 法定代表人: 林义相 联系人: 谭磊 客服电话: 010-66045678 传真: 010-66045518 网址: http://www.txsec.com 公司基金网网址: www.jjm.com.cn
62	联讯证券股份有限公司	注册地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 法定代表人: 徐刚 联系人: 郭晴 电话: 0752-2119391 传真: 0752-2119369 客服电话: 95564 网址: www.lxzq.com.cn

63	开源证券股份有限公司	注册地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层 办公地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层 法定代表人: 李刚 联系人: 袁伟涛 电话: 029-63387289 传真: 029-88447611 客服电话: 400-860-8866 网址: www.kysec.cn
64	中国民族证券有限责任公司	注册地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F 办公地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F 法定代表人: 赵大建 联系人: 齐冬妮 电话: 010-59355807 传真: 010-56437030 客服电话: 4008895618 网址: www.e5618.com
65	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 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 法定代表人: 李长伟 联系人: 唐昌田 电话: 010-88321717 传真: 010-88321763 客服电话: 400-665-0999 网址: www.tpyzq.com
66	宏信证券有限责任公司	注册地址: 四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 办公地址: 四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼 法定代表人: 吴玉明 联系人: 张鋈 电话: 010-64083702 传真: 028-86199382 客服电话: 4008366366 网址: www.hxzq.cn

67	天风证券股份有限公司	注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼 办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼 法定代表人：余磊 联系人：杨晨 电话：027-87107535 传真：027-87618863 客服电话：4008005000 网址：www.tfzq.com
68	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：吴涛 联系人：张蕴璞 电话：010-59366245 传真：010-59366055 客服电话：400-620-0620 网址：www.sczq.com.cn
69	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 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋 法定代表人：汪静波 联系人：张裕 电话：021-80359127 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
70	深圳众禄金融控股股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

71	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 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 法定代表人: 杨文斌 联系人: 张茹 电话: 021-20613999 传真: 021-68596916 客服电话: 400-700-9665 网址: www.ehowbuy.com
72	蚂蚁 (杭州) 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 办公地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人: 陈柏青 联系人: 韩爱彬 客服电话: 4000-766-123 网址: www.fund123.cn
73	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 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 法定代表人: 张跃伟 联系人: 余晓峰 电话: 021-20691832 传真: 021-20691861 客服电话: 400-820-2899 网址: www.erichfund.com
74	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 办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3 号楼 C 座 7 楼 法定代表人: 其实 联系人: 黄妮娟 电话: 021-54509998 传真: 021-64385308 客服电话: 400-1818188 网址: www.1234567.com.cn

75	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层 法定代表人: 闫振杰 联系人: 翟文、马林 电话: 010-59601366 传真: 010-62020355 客服电话: 4008188000 网址: www.myfund.com
76	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 办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层 法定代表人: 凌顺平 联系人: 吴强 电话: 0571-88911818-8653 传真: 0571-86800423 客服电话: 4008-773-772 网址: www.5ifund.com
77	众升财富(北京)基金销售有限公司	注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室 办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人: 李招娣 联系人: 李艳 电话: 010-59497361 传真: 010-64788016 客服电话: 400-059-8888 网址: www.zscffund.com
78	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 办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 法定代表人: 王莉 联系人: 刘洋 电话: 010-85650628 传真: 010-65884788 客服电话: 4009200022 网址: licaike.hexun.com

79	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 办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 法定代表人: 戎兵 联系人: 魏晨 电话: 010-52413385 传真: 010-85894285 客服电话: 4006099200 网址: www.yixinfund.com
80	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址: 杭州市拱墅区登云路 45 号 (锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室 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 法人: 徐黎云 联系人: 来舒岚 电话: 0571-88337888 传真: 0571-88337666 客服电话: 400-068-0058 网址: www.jincheng-fund.com
81	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 办公地址: 四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室 法定代表人: 于海锋 联系人: 邓鹏 电话: 13981713068 传真: 028-82000996-805 客服电话: 400-8588588 网址: http://www.pyfund.cn
82	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 B 座 46 楼 06-10 单元 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元 法定代表人: 赵学军 联系人: 景琪 电话: 021-20289890 传真: 021-20280110 客服电话: 400-021-8850 网址: www.harvestwm.cn

83	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	<p>注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 办公地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层 法定代表人: 张彦 联系人: 张燕 电话: 010-83363099 传真: 010-83363072 客服电话: 400-166-1188 网址: https://8.jrj.com.cn</p>
84	北京恒天明泽基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 办公地址: 北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室 法定代表人: 李悦 联系人: 张晔 电话: 010-56642600 传真: 010-56642623 客服电话: 4007868868 网址: www.chtfund.com</p>
85	北京钱景财富投资管理有限公司	<p>注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 法定代表人: 赵荣春 联系人: 高静 电话: 010-59158281 传真: 010-57569671 客服电话: 400-893-6885 网址: www.qianjing.com</p>
86	北京创金启富投资管理有限公司	<p>注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 办公地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 法定代表人: 梁蓉 联系人: 李婷婷 电话: 010-66154828 -801 传真: 010-63583991 客服电话: 400-6262-818 网址: www.5irich.com</p>

87	海银基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元 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 6 楼 法定代表人：刘惠 联系人：刘艳妮 电话：021- 80133827 传真：021-80133413 客服电话：400-808-1016 网址：www.fundhaiyin.com
88	上海大智慧财富管理有限公司	注册地址：上海浦东杨高南路 428 路 1 号楼 10-11 层 办公地址：上海浦东杨高南路 428 路 1 号楼 10-11 层 法定代表人：申健 联系人：印强明 电话：021-20219536 传真：021-20219923 客服电话：021-20219931 网址：http://8.gw.com.cn
89	上海联泰资产管理有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室 办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层 法定代表人：燕斌 联系人：陈东 电话：021-52822063 传真：021-52975270 客服电话：400-166-6788 网址：http://www.66zichan.com
90	北京增财基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 法定代表人：罗细安 联系人：史丽丽 电话：010-67000988-6028 传真：010-67000988-6000 客服电话：010-67000988 网址：www.zcvc.com.cn

91	上海利得基金销售有限公司	注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼 法定代表人: 李兴春 联系人: 曹怡晨 电话: 021-50583533 传真: 021-50583633 客服电话: 4000676266 网址: www.leadfund.com.cn
92	上海汇付金融服务有限公司	注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层 办公地址: 上海市徐汇区虹梅路 1801 号 7 层 法定代表人: 金佶 联系人: 陈云卉 电话: 021-33323999 传真: 021-33323837 客服电话: 400-821-3999 网址: http://tty.chinapnr.com
93	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504 办公地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504 法定代表人: 陈洪生 联系人: 梁云波 电话: 0592-3122757 传真: 0592-3122701 客服电话: 400-918-0808 网址: www.xds.com.cn
94	中信建投期货有限公司	注册地址: 重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B, 名义层 11-A, 8-B4, 9-B、C 办公地址: 渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B, 名义层 11-A, 8-B4, 9-B、C 法定代表人: 彭文德 联系人: 万恋 电话: 021-68762007 传真: 021-68763048 客服电话: 400-8877-780 网址: www.cfc108.com

95	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 法定代表人：鲍东华 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com
96	中经北证（北京）资产管理有限公司	注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层 办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层 法定代表人：徐福贺 联系人：李美 电话：18810595051 传真：010-68292964 客服电话：400-600-0030 网址：www.bzfund.com
97	中信期货有限公司	注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层 办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层 法定代表人：张皓 联系人：韩钰 电话：0755-23953913 传真：0755-83217421 客服电话：400-990-8826 网址：http://www.citicsf.com
98	北京乐融多源投资咨询有限公司	注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室 办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层 法定代表人：董浩 联系人：陈铭洲 电话：18513699505 客服电话：400-068-1176 网址：www.hongdianfund.com

99	北京新浪仓石基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 法定代表人: 李昭琛 联系人: 付文红 电话: 010-62676405 客服电话: 010-62675369 网址: http://www.xincai.com</p>
100	珠海盈米财富管理有限公司	<p>注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 室 法定代表人: 肖雯 联系人: 黄敏嫦 电话: 020-89629099 传真: 020-89629011 客服电话: 020-89629066 网址: www.yingmi.cn</p>
101	深圳富济财富管理有限公司	<p>注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室 办公地址: 深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室 法定代表人: 齐小贺 联系人: 杨涛 电话: 0755-83999907-811 传真: 0755-83999926 客服电话: 0755-83999907 网址: www.jinqianwo.cn</p>
102	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	<p>注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室 办公地址: 北京朝阳区亮马桥路 40 号二十一世纪大厦 A 座 303 法定代表人: 张鑫 联系人: 刘美薇 电话: 010-53570572/13121820670 传真: 010-59200800 客服电话: 400-819-9868 网址: http://www.tdyhfund.com/</p>

103	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室 办公地址: 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼 法定代表人: 陈继武 联系人: 王哲宇 电话: 021-63333389-611 传真: 021-63333390 客服电话: 4006-433-389 网址: www.lingxianfund.com
104	大泰金石基金销售有限公司	注册地址: 南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室 办公地址: 上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼 法定代表人: 袁顾明 联系人: 何庭宇 电话: 13917225742 传真: 021-22268089 客服电话: 400-928-2266/021-22267995 网址: www.dtfunds.com
105	济安财富(北京)资本管理有限公司	注册地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室 办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号 财富中心 A 座 46 层 济安财富 法定代表人: 杨健 联系人: 付志恒 电话: 010-65309516-802 传真: 010-65330699 客服电话: 400-075-6663 网址: http://www.jianfortune.com
106	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室 办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F 法定代表人: 彭运年 联系人: 孙雯 电话: 010-59336519 传真: 010-59336500 客服电话: 4008-909-998 网址: www.jnlc.com

107	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	注册地址: 北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室 办公地址: 北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室 法定代表人: 齐凌峰 联系人: 阮志凌 电话: 010-82151989 传真: 010-82158631 客服电话: 400-158-5050 网址: www.9ifund.com
108	徽商期货有限责任公司	注册地址: 安徽省合肥市芜湖路 258 号 办公地址: 安徽省合肥市芜湖路 258 号 法定代表人: 吴国华 联系人: 蔡芳 电话: 0551-62862801 传真: 0551-62865899 客服电话: 4008-878-707 网址: www.hsqh.net
109	北京汇成基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 1108 办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 1108 法定代表人: 王伟刚 联系人: 丁向坤 电话: 010-56282140 传真: 010-62680827 客服电话: 4006199059 网址: www.fundzone.cn
110	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人: 钱燕飞 联系人: 王锋 电话: 025-66996699-887226 传真: 025-66996699 客服电话: 95177 网址: www.snjijin.com

111	北京广源达信投资管理有 限公司	注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中 心 B 座 19 层 法定代表人：齐剑辉 联系人：姜英华 电话：4006236060 传真：010-82055860 客服电话：4006236060 网址：www.niuniufund.com
112	上海万得投资顾问有限公 司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福 山路 33 号 11 楼 B 座 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福 山路 33 号 8 楼 法定代表人：王廷富 联系人：姜吉灵 电话：021-51327185 传真：021-50710161 客服电话：400-821-0203
113	北京蛋卷基金销售有限公 司	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 法定代表人：钟斐斐 联系人：吴季林 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客服电话：4000618518 网址： https://www.danjuanapp.com
114	上海云湾投资管理有限公 司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金 桥路 27 号 13 号楼 2 层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金 桥路 27 号 13 号楼 2 层 法定代表人：戴新装 联系人：江辉 电话：021-20538888 传真：021-20538999 客服电话：400-820-1515 网址：www.zhengtongfunds.com

115	上海中正达广投资管理有 限公司	注册地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 办公地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 法定代表人:黄欣 联系人:戴珉微 电话:021-33768132 传真:021-33768132-802 客服电话:400-6767-523 网址:www.zzwealth.cn
116	南京途牛金融信息服务有 限公司	注册地址:南京市玄武区玄武大道 699-1 号 办公地址:南京市玄武区玄武大道 699-1 号 法定代表人:宋时琳 联系人:贺杰 电话:025-86853969-66727 客服电话:4007-999-999 网址:http://jr.tuniu.com
117	东海期货有限责任公司	注册地址:江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号 办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼 法定代表人:陈太康 联系人:李天雨 电话:021-68757102 传真:021-68757102 客服电话:95531/4008888588 网址:www.qh168.com.cn
118	弘业期货股份有限公司	注册地址:南京市秦淮区中华路 50 号 办公地址:南京市秦淮区中华路 50 号弘业大厦 2-10 楼 法定代表人:周剑秋 联系人:孙朝旺 电话:025-52278870 传真:025-52250114 客服电话:4008281288 网址:www.ftol.com.cn

119	上海基煜基金销售有限公司	注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发 展区) 办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号 太平金融大厦 1503 室 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客服电话：400-820-5369 网址：www.jiyufund.com.cn
120	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	

注：中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、德州银行股份有限公司、潍坊银行股份有限公司仅销售 A 类份额。

3.2 登记机构

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

法定代表人：张海波

电话：(0755) 82763849

传真：(0755) 82763889

联系人：古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所

上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：黎明

电话：(021) 3135 8666

传真：(021) 3135 8600

经办律师：黎明、孙睿

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

经办注册会计师: 薛竞、陈熹

§ 4 基金名称

南方大数据 300 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

本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求与业绩比较基准相似的回报。

§ 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)、债券 (包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但需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。

基金的投资组合比例为:

本基金 80% 以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 85%, 且不低于非现金基金资产的 80%。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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

§ 8 基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，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，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的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 0.5%，年跟踪误差不超过 6%。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。

（一）投资策略原理

南方大数据 300 指数基金是跟踪大数据 300 指数的普通指数基金。大数据 300 指数为策略指数，对样本空间的股票，按照财务因子得分、市场驱动因子得分和大数据因子得分进行模型优化，然后将计算的综合得分从高到低排序，选取排名在前 300 名的股票构成大数据 300 指数初始样本股。具体来看，财务因子主要包括最新市净率 PB、市盈率 PE、净资产收益率 ROE、年度营业收入同比增长率、年度净利润同比增长率，剔除 PE、ROE 排名靠后的股票、剔除营业收入同比增长为负和年度净利润同比增长为负的股票；计算净利润的一致预期变化率和一致预期的 PEG（市盈率相对盈利增长比率）得分作为财务一致预期指标得分，通过因子模型计算上述得分作为财务因子总得分。市场驱动因子主要包括最近一个月股票换手率、波动率、价格变化率、流动性因子，通过量化因子模型计算得分作为市场驱动因子的总得分。大数据因子主要包括根据新浪财经频道下的股票页面访问热度计算单个股票的热度得分、根据财经频道下的新闻报道正负面影响计算单个股票新闻报道得分、根据股票在微博上的正负面文章影响计算单个股票微博得分，综合上述得分并根据历史回测优化结果作为大数据得分。最后，在指数编制方案约定的规则下进行调整与等权重计算，最终确定指数成份股与权重。南方大数据 300 指数基金则通过复制法进行被动式指数化投资，紧密跟踪大数据 300 指数。若将来大数据 300 指数编制方案发生调整，届时将根据调整后方案更新招募说明书中相关内容。

（二）资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法，按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

（三）股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

1、股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。特殊情况下，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

2、股票投资组合的调整

（1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

（2）不定期调整

1) 当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

2) 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

3) 特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股长期停牌；③标的指数成份股流动性严重不足；④成份股上市公司存在重大违规行为，有可能面临重大的处罚或诉讼。

（四）债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

（五）权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

（六）股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（六）资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

§ 9 基金业绩比较基准

1、本基金的标的指数：大数据 300 指数，及其未来可能发生的变更。

大数据 300 指数由深圳证券信息有限公司与南方基金管理有限公司、北京新浪互联网信息服务有限公司联合编制，是基于财经媒体与社交平台挖掘投资情绪并应用于指数选样的策略指数。大数据 300 指数通过对财经领域的“大数据”进行定性与定量分析，同时考量股票基本面与市场驱动情况，精选出综合排名靠前的 300 只股票组成指数样本股。根据合作方签署的合作协议及其补充协议，南方基金管理有限公司有权收取指数使用许可费总额的三分之一。北京新浪互联网信息服务有限公司在大数据 300 指数的合作中负责大数据原始数据的提供，提供了如网页点击量、个股页面点击率、个股新闻点击率、个股新闻微博提及率等互联网数据；南方基金负责原始数据（包括互联网数据、财务数据、市场驱动数据）的整理和加工，研究策略模型和确定编制指数的策略；深圳证券信息有限公司负责具体指数编制和指数点位计算、发布等日常运维工作。

如果指数编制单位变更或停止大数据 300 指数的编制、发布或授权，或大数据 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大数据 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，本基金管理人可以依据

维护投资人合法权益的原则, 变更本基金的标的指数。若标的指数变更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, 报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更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机构变更、指数更名等), 则无需召开基金份额持有人大会, 在报中国证监会备案后及时公告。

2、本基金业绩比较基准:

大数据 300 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率 (税后) \times 5%

若本基金标的指数发生变更, 基金业绩比较基准随之变更。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更而由此引起的业绩比较基准的变更, 则基金管理人应就变更标的指数及业绩比较基准召开基金份额持有人大会, 报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更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机构变更、指数更名等) 而由此引起的业绩比较基准的变更, 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。

§ 10 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金, 其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金, 具有与标的指数相似的风险收益特征。

§ 11 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 2016 年 9 月 30 日 (未经审计)。

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	1, 149, 831, 273. 97	85. 65
	其中: 股票	1, 149, 831, 273. 97	85. 65
2	基金投资	-	-

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	107,826,726.84	8.03
8	其他资产	84,893,867.94	6.32
9	合计	1,342,551,868.75	100.00

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	9,219,082.00	0.69
B	采矿业	1,617,369.00	0.12
C	制造业	316,368,605.86	23.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,460,813.60	1.15
E	建筑业	13,947,943.61	1.04
F	批发和零售业	38,559,092.64	2.88
G	交通运输、仓储和邮政业	7,762,859.00	0.58
H	住宿和餐饮业	2,125,425.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,739,557.48	4.99
J	金融业	415,286,472.31	31.02
K	房地产业	203,365,115.93	15.19
L	租赁和商务服务业	16,798,824.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	6,043,517.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	12,588,660.00	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,361,248.00	0.10
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,586,688.54	1.69
S	综合	-	-
	合计	1,149,831,273.97	85.89

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	600036	招商银行	3,183,800	57,308,400.00	4.28
2	601166	兴业银行	3,529,833	56,371,433.01	4.21
3	000002	万科 A	2,098,379	54,914,578.43	4.10
4	601328	交通银行	9,463,700	52,334,261.00	3.91
5	600000	浦发银行	2,741,396	45,205,620.04	3.38
6	601169	北京银行	4,325,509	39,362,131.90	2.94
7	601398	工商银行	8,467,100	37,509,253.00	2.80
8	601988	中国银行	8,047,000	27,118,390.00	2.03
9	000001	平安银行	2,988,152	27,102,538.64	2.02
10	601818	光大银行	6,092,700	23,091,333.00	1.72

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF1610	IF1610	124	120,803,280.00	1,354,021.45	-
公允价值变动总额合计 (元)					1,354,021.45
股指期货投资本期收益 (元)					10,579,978.55
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-1,511,278.55

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，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。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1

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。

11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	24, 295, 780. 71
2	应收证券清算款	60, 175, 939. 48
3	应收股利	-
4	应收利息	52, 934. 64
5	应收申购款	369, 213. 11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84, 893, 867. 94

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 12 基金业绩

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。

大数据 300A

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

2015. 6. 24-2015. 12. 31	-0. 63%	2. 21%	-16. 65%	2. 82%	16. 02%	-0. 61%
2016. 1. 1-2016. 9. 30	-2. 68%	3. 60%	-3. 98%	1. 41%	-1. 30%	2. 19%
自基金成立至今	-3. 29%	5. 73%	-19. 97%	2. 11%	16. 68%	3. 62%

大数据 300C

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
2015. 6. 24-2015. 12. 31	-0. 74%	2. 21%	-16. 65%	2. 82%	15. 91%	-0. 61%
2016. 1. 1-2016. 9. 30	-2. 91%	3. 60%	-3. 98%	1. 41%	-1. 07%	2. 19%
自基金成立至今	-3. 63%	5. 73%	-19. 97%	2. 11%	16. 34%	3. 62%

§ 13 基金的费用概览

13.1 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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费；
- 4、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

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 5 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、公休日等, 支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

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 5 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、指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法从基金财产中支付指数使用许可费。指数使用许可费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的资产净值

自基金成立的下一季度 (自然季度) 起, 指数使用许可费收取下限为每季度 (自然季度) 5 万元, 即不足 5 万元时按照 5 万元收取。基金成立日所在季度, 若按规模计提的指数使用许可费超过 5 万元, 则按实际天数计提; 若按规模计提的指数使用许可费不足 5 万元, 则:

$$\text{当季指数使用许可费} = 50,000 \text{ 元} \times \text{基金当季存续天数} \div \text{当季天数}$$

指数使用许可费每日计算, 逐日累计, 按季度支付。基金管理人应于每个季度 (自然季度) 结束后 10 个工作日内与标的指数许可方结算该季度的指数使用费。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整, 本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

4、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算, 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销售服务费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 5 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。

上述“一、基金费用的种类中第 5—10 项费用”, 根据有关法规、招募说明书及相应协议规定, 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;
- 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可根据基金规模等因素协商一致, 酌情调低基金管理费率、托管费率、销售服务费, 无需召开基金份额持有人大会。除根据法律法规要求提高该等报酬标准以外, 提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

13.2 与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金 A 类基金份额收取申购费用, C 类基金份额不收取申购费用。

申购本基金 A 类基金份额的投资人, 其申购费率最高不高于 1.2%, 且随申购金额的增加而递减, 如下表所示:

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 300 万	0.8%
300 万 ≤ M < 500 万	0.4%
M ≥ 500 万	每笔 1,000 元

投资人重复申购, 须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担, 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、赎回费用

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额在投资人赎回时收取赎回费。

(1) A 类基金份额赎回费用

A 类基金份额赎回费率最高不超过 0.5%, 随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示 (其中 1 年指 365 天) :

申请份额持有时间 (N)	赎回费率
$N < 1$ 年	0.5%
$1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年	0.25%
$N \geq 2$ 年	0

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产, 其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(2) C 类基金份额赎回费用

C 类基金份额赎回费率最高不超过 1.5%, 随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示 (其中 1 年指 365 天) :

申请份额持有时间(N)	赎回费率
$N < 7$ 日	1.5%
$7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日	0.75%
$30 \text{ 日} \leq N < 1$ 年	0.5%
$1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年	0.25%
$N \geq 2$ 年	0

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费, 赎回费用全额归入基金财产; 对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费, 赎回费用 75% 归入基金财产; 对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费, 赎回费用 50% 归入基金财产; 对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费, 赎回费用 25% 归入基金财产。

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介公告。

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。

§ 14 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他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“重要提示”部分,对“重要提示”进行了更新。
- 2、在“基金管理人”部分,对“基金管理人概况”进行了更新,对“主要人员情况”进行了更新。
- 3、在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。
- 4、在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新,对“登记机构”进行了更新。
- 5、在“基金的投资”部分,对“基金投资组合报告”进行了更新,对“基金业绩”进行了更新。
- 6、在“基金份额持有人服务”部分,对“基金份额持有人服务”进行了更新。
- 7、在“其他应披露事项”部分,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
2017 年 1 月 26 日