

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要
(2017年第2号)

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：海通证券股份有限公司
截止日：2017年12月03日

重要提示

本基金经中国证监会2015年5月12日证监许可[2015]886号文注册募集，基金合同于2015年6月3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投资价值和市场前景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（包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险）等，详见招募说明书“风险揭示”章节等。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；国企改革B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

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》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，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现；基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

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 2017 年 12 月 3 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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：常克川

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 年出生，籍贯安徽，工商管理硕士，十九年证券从业经历，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。现任南方基金管理有限公司党委书记、董事长。

王连芬女士，董事，1966 年出生，籍贯天津，金融专业硕士，二十四年证券从业经历，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、执行办主任、总裁助理。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，管理学博士，十九年证券从业经历，中国籍。曾任职于北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司。2003 年 2 月加入华泰证券，先后担任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董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生，董事，1966 年出生，籍贯江西，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，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、企业三部高级主管。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长、深圳市城市建设开发（集团）公司董事。

李自成先生，董事，1961 年出生，籍贯福建，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，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，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍。历任德勤国际会计师事务所会计专业翻译、光大银行证券部职员、美国 NASDAQ 实习职员、

证监会处长、副主任、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裁、党委副书记。

姚景源先生，独立董事，1950 年出生，籍贯山东，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，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教师、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，法学硕士，香港证券及投资学会杰出资深会员。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，经济学硕士、工商管理硕士、中国注册会计师，中国籍。历任北京市财政局干部、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）管理合伙人、中国证监会第三届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，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。现任金杜律师事务所合伙人、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、深圳市女企业家协会理事。

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，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。现任南方基金管理有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司董事长。

舒本娥女士，监事，1964 年出生，籍贯江西，大学本科学历，十九年证券从业经历，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，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、风险管理部副总经理（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、兴证期货管理有限公司董事、兴业创新资本管理有限公司监事。

张德伦先生，职工监事，1964 年出生，籍贯山东，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、汉唐证券人力资源管理总部总经理、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。现任南方基金管理有限公司党委组织部部长、人力资源部总经理、执行董事、南方资本管理有限公司董事。

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经理、执行董事。

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、上海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。现任南方基金管理有限公司监察稽核部董事。

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，曾任南方资本管理有限公司董事长，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

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。

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，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、南方资本管理有限公司董事，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

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

本基金历任基金经理为：2015年6月至2015年7月，雷俊；2015年7月至2016年7月，雷俊、孙伟；2016年7月至今，孙伟。

孙伟先生，管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010年2月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014年12月至2015年5月，担任南方恒生ETF的基金经理助理；2015年5月至2016年7月，任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理；2015年7月至今，任改革基金、高铁基金、500信息基金经理；2016年5月至今，任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理；2016年8月至今，任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理；2017年3月至今，任南方全指证券ETF联接、南方中证全指证券ETF基金经理；2017年6月至今，任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理。

1.2.5 投资决策委员会成员

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，首席投资官（专户）兼权益专户投资部总经理蒋峰先生，权益研究部总经理茅炜先生，交易管理部总经理王珂女士，权益投资部总经理张原先生，指数投资部兼数量化投资部总经理罗文杰女士，现金投资部总经理夏晨曦先生，固定收益投资部总经理李璇女士，固定收益专户投资部总经理乔羽夫先生，固定收益研究部总经理陶钰先生。

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

1、基本情况

名称：海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦

法定代表人：周杰

成立时间：1988年8月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复【1988】383号

组织形式：股份有限公司

注册资本：95.8472亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2013】1643号

海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）成立于1988年，是国内最早成立的大型证券公司之一。海通证券A股于2007年在上海证券交易所挂牌上市并完成定向增发，H股于2012年4月在香港联合交易所挂牌上市，公司注册资本金增至95.84亿元。

海通证券设基金托管部，现有员工具有多年金融从业经历，丰富的证券相关业务经验。全员具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，硕士以上学历占25%，专业分布合理，是一支诚实勤勉，开拓创新的资产托管从业人员团队。

2、主要人员情况

周杰先生，海通证券董事长、党委书记，上海交通大学管理学院管理工程专业工学硕士。1992年2月至1996年6月在上海万国证券有限公司投资银行部工作；1996年6月至2001年12月先后担任上海上实资产经营有限公司投资部经理、副总经理、董事长兼总经理；2001年12月至2003年4月担任上海实业医药科技（集团）有限公司董事兼总经理；2002年1月至2016年7月，先后担任上海实业控股有限公司（于香港联交所上市，股份代号：0363）执行董事兼副行政总裁、执行董事兼常务副总裁、副董事长兼行政总裁；2004年8月至2016年7月，先后担任上海上实（集团）有限公司策划总监、执行董事兼副总裁、执行董事兼常务副总裁、总裁兼党委副书记；2010年3月至2012年5月担任上海医药集团股份有限公司（于上海证券交易所上市，股份代号：601607；于香港联交所上市，股份代号：2607）监事长，2012年6月至2013年6月、2016年5月至2016年7月担任上海医药集团股份有限公司董事长兼党委书记；2009年1月至2016年7月担任中芯国际集成电路制造有限公司（于纽约证券交易所上市，股份代号：SMI；于香港联交所上市，股份代号：0981）非执行董事；2016年7月起担任海通证券党委书记，2016年10月起担任海通证券董事长。

陈春钱先生，海通证券总经理助理，负责公司经纪业务。陈先生还兼任公司经纪业务委员会主任、国际业务协调委员会委员、战略发展与IT治理委员会委员和中国证券业协会证券经纪业专业委员会委员。陈先生于1988年7月获安徽财经学院经济学硕士学位并于1995年7月获厦门大学经济学博士学位，拥有17年的证券业工作及管理经验。1997年10月至1998年1月，担任公司深圳分公司业务部负责人；1998年1月至2000年3月，担任国际业务部副总经理；2000年3月至2000年12月，担任深圳分公司副总经理；2000年12月至2006年5月，担任投资管理部（深圳）总经理；2006年5月至2013年2月，担任销售交易总部总经理，其间2007年11月至2009年3月兼任机构业务部总经理。

凌如水先生，海通证券基金托管部总经理，本科学历，拥有23年证券业工作及管理经验。1992年8月加入海通证券，曾任海通证券绍兴营业部业务经理，2001年5月起任海通

证券上虞营业部总经理，2013年3月起任海通证券企业及私人客户部副总经理，2015年8月起任海通证券基金托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

海通证券于2013年12月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司，海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”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。

二、基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，确保托管资产的完整和安全，切实保护基金份额持有人权益，确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定，查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制原则：

（1）全面性原则。内部控制应当渗透到基金托管业务的决策、执行、监督的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门和岗位，并由全体人员参与，任何决策或操作均应当有案可查；

（2）重要性原则。基金托管业务的内部控制应当在全面控制的基础上，关注基金托管业务运作的重要业务事项和高风险领域；

（3）制衡性原则。岗位设置应权责分明、相对独立、相互制衡，通过切实可行的措施来消除内部控制的盲点。

（4）适应性原则。内部控制体系应同基金托管业务规模、业务范围、竞争状况和风险水平及业务其他环境相适应，内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有超出内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当得到及时反馈和纠正；

（5）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营、保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新增业务时，先做好相关制度建设；

（6）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的负责人进行问责。

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》第 92 号令、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《海通证券证券投资基金托管业务管理办法》、《海通证券证券投资基金托管业务内部控制管理办法》、《海通证券证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《海通证券证券投资基金托管业务保密管理规定》、《海通证券证券投资基金托管业务印章及加密设备管理规定》、《海通证券基金托管业务从业人员行为规范》、《海通证券证券投资基金托管业务档案管理规定》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请立信会计师事务所（特殊普通合伙）对基金托管业务运行进行内部控制评审。

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

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

§ 3 相关服务机构

3.1 销售机构

3.1.1 场外销售机构

3.1.1.1 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

3.1.1.2 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
2	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：陈四清 客服电话：95566 网址：www.boc.cn
3	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
4	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
5	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 联系人：王硕 传真：(010) 68858057 客服电话：95580 网址：www.psbc.com
6	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：高国富 联系人：吴斌 联系电话：021-61618888 客服电话：95528

		网址： www.spdb.com.cn
7	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
8	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
9	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：谢永林 联系人：施艺帆 联系电话：021-50979384 客服电话：95511-3 网址： bank.pingan.com
10	杭州银行股份有限公司	注册地址：杭州市下城区庆春路46号杭州银行大厦 办公地址：杭州市下城区庆春路46号杭州银行大厦 法定代表人：陈震山 联系人：金超龙 联系电话：0571-85157105 客服电话：95398 网址： www.hzbank.com.cn
11	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：陈玲 联系电话：021-38576830 客服电话：021-962999、4006962999 网址： www.srcb.com
12	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：张洪玮 电话：025-58587036 客服电话：95319 网址： www.jsbchina.cn

13	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：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
14	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东路 345 号 法定代表人：陆华裕 联系人：胡技勋 联系电话：0574-89068340 客服电话：95574 网址：www.nbcb.com.cn
15	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：周田 联系方式：027-82656785 客服电话：96558（武汉）、40060-96558（全国） 网址：www.hkbchina.com
16	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：王耀球 联系人：杨亢 电话：0769-22866270 传真：0769-22866282 客服电话：0769-961122 网址：www.drcbank.com
17	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

18	广州银行股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江东路 30 号广州银行大厦 办公地址：广州市天河区珠江东路 30 号广州银行大厦 法定代表人：姚建军 联系人：唐荟 电话：020-28302742 传真：020-28302021 客服电话：020-96699 网址：www.gzcb.com.cn
19	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
20	江苏江南农村商业银行股份有限公司	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
21	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：傅彩芬 电话：0595-22551071 传真：0595-22578871 客服电话：96312 网址：http://www.qzccb.com/

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：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券

		大厦 20 楼 法定代表人：兰荣 联系人：乔琳雪 联系电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：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 2-6 层 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：陈共炎 联系人：辛国政 联系电话：010-83574507 客服电话：4008-888-888 或 95551 网址：www.chinastock.com.cn
4	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
5	中泰证券股份有限公司	注册地址：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
6	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
7	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：刘畅 联系电话：010-65608231 客服电话：4008888108

		网址： www.csc108.com
8	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：0755-83516289 客服电话：0755-33680000 4006666888 网址： www.cgws.com
9	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：霍达 联系人：黄婵君 联系电话：0755-82960167 客服电话：95565、4008888111 网址： www.newone.com.cn
10	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：张佑君 联系人：郑慧 电话：010-60834817 传真：010-60833739 客服电话：95558 网址： www.cs.ecitic.com
11	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
12	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：何耀 联系电话：021-22169999 客服电话：95525 网址： www.ebscn.com
13	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、

		<p>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</p>
14	申万宏源西部证券有限公司	<p>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：韩志谦 电话：0991-5801913 传真：0991-5801466 联系人：王怀春 客服电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com</p>
15	湘财证券股份有限公司	<p>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：95351 网址：www.xcsc.com</p>
16	安信证券股份有限公司	<p>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凤凰大厦 1 栋 9 层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn</p>
17	中信证券（山东）有限责任公司	<p>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：姜晓林 联系人：刘晓明 联系电话：0531-89606165 客服电话：95548</p>

		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：尤习贵 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 客服电话：95579 或 4008-888-999 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：王雯 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 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：021-53686888 传真：021-53686100-7008 客服电话：021-962518 网址：www.962518.com
25	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：祁昊 联系电话：0510-82831662 客服电话：95570 网址：www.glsc.com.cn
26	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
27	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：天津市南开区滨水西道 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

28	平安证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 法定代表人：刘世安 联系人：石静武 联系电话：021-38631117 客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com
29	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 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
30	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
31	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
32	南京证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路 389 号 办公地址：南京市江东中路 389 号 法定代表人：步国旬 联系人：王万君 联系电话：025-58519523 客服电话：95386 网址：www.njzq.com.cn

33	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
34	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：021-20657517 传真：021-68408217-7517 客服电话：4008209898 网址：www.cnhbstock.com
35	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
36	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

37	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：王虹 电话：021-20655183 传真：021-20655196 客服电话：96326（福建省外请先拨 0591） 网址：www.hfzq.com.cn
38	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：95329 网址：http://www.zszq.com
39	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 李盼盼 电话：0371-69099882 传真：0371-65585899 客服电话：95377 网址：www.ccnew.com
40	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
41	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

42	中航证券有限公司	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/
43	国盛证券有限责任公司	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：徐丽峰 联系人：周欣玲 联系电话：0791-86281305 客服电话：4008222111 网址： www.gszq.com
44	中国国际金融股份有限公司	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：北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 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
45	大同证券有限责任公司	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
46	东海证券股份有限公司	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 网址： www.longone.com.cn

47	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/
48	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：叶顺德 联系人：田芳芳 联系电话：010-83561146 客服电话：95399 网址： www.xsdzq.cn
49	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
50	万联证券股份有限公司	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 13 号高德置地广场 E 栋 12 层 法定代表人：张建军 联系人：甘蕾 联系电话：020-38286026 客服电话：400-8888-133 网址： www.wlzq.cn
51	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.gjzq.com.cn

52	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：郭静 联系电话：0731-84403347 客服电话：95317 网址： www.cfzq.com
53	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 号兰州财富中心 21 楼 办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 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
54	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：上海市徐汇区肇嘉浜路 750 号 法定代表人：俞洋 联系人：杨莉娟 电话：021-54967552 传真：021-54967032 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918 网址： www.cfsc.com.cn
55	国融证券股份有限公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路 18 号 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西座 11 层 法定代表人：张智河 联系人：虞哲维 客服电话：400-660-9839 网址： www.grzq.com
56	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：李泓灏 联系电话：024-23280806 客服电话：024-95346 网址： http://www.iztzq.com

57	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：0755-82560892 传真：0755-82545500 客服电话：40018-40028 网址：www.wkzq.com.cn
58	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：0411-39991833 客服电话：4008-169-169 网址：www.daton.com.cn
59	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：http://jijin.txsec.com/
60	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

61	太平洋证券股份有限公司	<p>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：马焮 电话：010-88321967 传真：010-88321763 客服电话：400-665-0999 网址：www.tpyzq.com</p>
62	宏信证券有限责任公司	<p>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</p>
63	天风证券股份有限公司	<p>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：夏旻 电话：027-87107535 传真：027-87618863 客服电话：4008005000 或 95391 网址：www.tfzq.com</p>
64	首创证券有限责任公司	<p>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</p>

65	联储证券有限责任公司	<p>注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路333号金砖大厦8楼 法定代表人：沙常明 联系人：丁倩云 电话：010-56177851 传真：010-56177855 客服电话：400-620-6868 网址：www.lczq.com</p>
66	中信建投期货有限公司	<p>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</p>
67	中信期货有限公司	<p>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：刘宏莹 电话：010-60833754 传真：0755-83217421 客服电话：400-990-8826 网址：http://www.citicsf.com</p>
68	弘业期货股份有限公司	<p>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</p>

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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层 法定代表人：张跃伟 联系人：张佳琳 电话：021-20691831 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：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座大楼（东方财富大厦） 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：95021 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：罗恒 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：李招弟 联系人：李艳 电话：010-59497361 传真：010-64788016 客服电话：400-876-9988 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	浙江金观诚基金销售有限公司	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	<p>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锦江区东大街99号平安金融中心1501室 法定代表人：于海锋 联系人：陈金红 电话：18591999779 传真：028-84252474-801 客服电话：400-8588588 网址：http://www.puyifund.cn</p>
82	嘉实财富管理有限公司	<p>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</p>
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：马勇 联系人：文雯 电话：010-83363101 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：周斌 联系人：祖杰 电话：010-53509636 传真：010-57756199 客服电话：4008980618 网址：www.chtfund.com</p>

85	北京钱景基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 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：李超 电话：010-56200948 传真：010-57569671 客服电话：400-893-6885 网址：www.qianjing.com
86	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社综合楼A座712室 法定代表人：梁蓉 联系人：魏素清 电话：010-66154828-8006 传真：010-63583991 客服电话：400-6262-818 网址：www.5irich.com
87	海银基金销售有限公司	注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室 办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼 法定代表人：刘惠 联系人：刘晖 电话：021-60206991 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://www.wg.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：杜娟 电话：010-67000988-6075 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：郑茂 电话：021-50583533 传真：021-60195218 客服电话：400-921-7755 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 上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼 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	<p>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</p>
94	上海陆金所资产管理有限公司	<p>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：胡学勤 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com</p>
95	北京虹点基金销售有限公司	<p>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：胡伟 联系人：陈铭洲 电话：18513699505 客服电话：400-068-1176 网址：www.hongdianfund.com</p>
96	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：吴翠 电话：010-60619607 客服电话：010-62675369 网址：http://www.xincai.com</p>

97	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： 邱湘湘 电话： 020-89629099 传真： 020-89629011 客服电话： 020-89629066 网址： www.yingmi.cn</p>
98	深圳富济财富管理有限公司	<p>注册地址： 深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位 办公地址： 深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位 法定代表人： 刘鹏宇 联系人： 刘娜 电话： 0755-83999907-811 传真： 0755-83999926 客服电话： 0755-83999907 网址： www.jinqianwo.cn</p>
99	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>
100	上海凯石财富基金销售有限公司	<p>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： 黄玮 电话： 021-63333389-230 传真： 021-63333390 客服电话： 4006-433-389 网址： www.vstonewealth.com</p>

101	大泰金石基金销售有限公司	<p>注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室 办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼 法定代表人：袁顾明 联系人：孟召社 电话：15621569619 传真：021-20324199 客服电话：400-928-2266/021-22267995 网址：www.dtfunds.com</p>
102	济安财富（北京）基金销售有限公司	<p>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 法定代表人：杨健 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客服电话：400-673-7010 网址：http://www.jianfortune.com</p>
103	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	<p>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：钱昊旻 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</p>
104	北京汇成基金销售有限公司	<p>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.hcjjin.com</p>

105	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
106	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
107	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
108	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

109	上海基煜基金销售有限公司	<p>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）</p> <p>办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A 栋 1002-1003 室</p> <p>法定代表人：王翔</p> <p>联系人：蓝杰</p> <p>电话：021-35385521</p> <p>传真：021-55085991</p> <p>客服电话：400-820-5369</p> <p>网址：www.jiyufund.com.cn</p>
110	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06</p> <p>办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 17 层</p> <p>法定代表人：江卉</p> <p>联系人：徐伯宇</p> <p>电话：010-89188356</p> <p>传真：010-89189566</p> <p>客服电话：95118</p> <p>网址：jr.jd.com</p>
111	上海华夏财富投资管理有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室</p> <p>办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层</p> <p>法定代表人：毛淮平</p> <p>联系人：仲秋玥</p> <p>电话：010-88066632</p> <p>传真：010-88066552</p> <p>客服电话：400-817-5666</p> <p>网址：www.amcfortune.com</p>
112	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 场内销售机构

场内销售机构是指具有基金代销业务资格、并经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关证券交易所会员单位，具体名单以交易所网站刊载内容为准。

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
联系人：崔巍
电话：010-50938856
传真：010-59378907

3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称：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：(86 21) 3135 8666
传真：(86 21) 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

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

§ 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、政府支持债券、地方政府债、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 90%，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

8.1 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 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规

则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（一）资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将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。

（二）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。

（三）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。

（四）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。

（五）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。

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。

8.2 投资决策依据和决策程序

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

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。

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。

（1）研究支持：指数化投资团队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、股指期货跟踪有效性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。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告，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。

（3）组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股的方法构建组合。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。

（4）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。

（5）投资绩效评估：指数化投资团队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、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此调整投资组合。

（6）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、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，紧密跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资体制和程序做出调整，并在更新的《招募说明书》中列示。

§ 9 标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数：中证国有企业改革指数及其未来可能发生的变更。

本基金的业绩比较基准：标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的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本基金管理人认为原标的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时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况

下，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

本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，国企改革 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；国企改革 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

§ 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 2017 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	293,175,185.94	93.00
	其中：股票	293,175,185.94	93.00
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	21,402,039.02	6.79
8	其他资产	664,363.63	0.21

合计	315,241,588.59	100.00
----	----------------	--------

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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	-	-
B	采矿业	25,257,980.24	8.05
C	制造业	112,783,076.59	35.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,522,756.00	6.54
E	建筑业	44,709,981.25	14.25
F	批发和零售业	13,833,094.20	4.41
G	交通运输、仓储和邮政业	27,913,920.65	8.90
H	住宿和餐饮业	700,220.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,515,337.12	3.67
J	金融业	26,298,389.72	8.38
K	房地产业	4,314,701.68	1.38
L	租赁和商务服务业	4,691,536.74	1.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	292,540,994.19	93.26

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.01
C	制造业	395,916.35	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	634,191.75	0.20

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

指数投资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	000858	五粮液	163,152	9,345,346.56	2.98
2	600519	贵州茅台	18,000	9,317,520.00	2.97
3	600104	上汽集团	298,903	9,023,881.57	2.88
4	601390	中国中铁	1,003,600	8,681,140.00	2.77
5	601601	中国太保	233,800	8,634,234.00	2.75
6	600028	中国石化	1,463,300	8,633,470.00	2.75
7	601328	交通银行	1,354,821	8,562,468.72	2.73
8	601668	中国建筑	903,400	8,383,552.00	2.67
9	600050	中国联通	1,099,518	8,158,423.56	2.60
10	601600	中国铝业	1,024,600	7,756,222.00	2.47

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.04
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.03
3	603055	台华新材	2,658	62,489.58	0.02
4	603367	辰欣药业	3,315	55,658.85	0.02
5	603321	梅轮电梯	2,725	54,309.25	0.02

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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

9.1 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。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。

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 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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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 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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	408,997.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,105.29
5	应收申购款	245,260.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	664,363.63

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

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601600	中国铝业	7,756,222.00	2.47	重大事项

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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。

阶段	净值增长率（1）	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)
2015.6.3-2015.12.31	-29.69%	3.29%	-31.50%	3.14%	1.81%	0.15%
2016.1.1-2016.12.31	-12.25%	1.73%	-14.83%	1.68%	2.58%	0.05%
2017.1.1-2017.9.30	13.72%	0.67%	10.64%	0.64%	3.08%	0.03%
自基金合同生效起至今	-29.84%	2.03%	-35.45%	1.95%	5.61%	0.08%

§ 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、基金上市费用及年费；
- 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、仲裁费和诉讼费；
- 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、基金相关账户的开户及维护费用；
- 11、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 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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、基金合同生效后标的指数许可使用费

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。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。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

基金合同生效后的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 50,000 元，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复

核后于每一季度末结束后的 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 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

基金管理人可以根据与基金份额持有人利益一致的原则，结合产品特点和投资人的需求设置基金管理费率的结构和水平。

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和基金托管费率，无须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

申购费用和赎回费用

1、本基金南方国企改革场外申购费率最高不高于 0.6%，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	0.6%
M≥100 万	每笔 500 元

本基金基础份额的场内申购费率为 0。

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计算。

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、注册登记等各项费用。

2、本基金南方国企改革场外赎回费率不高于 0.5%，随申请份额持有时间增加而递减（其中 1 年为 365 天）。具体如下表所示：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<1 年	0.5%
1 年≤N<2 年	0.25%
N≥2 年	0

本基金场内赎回费率为 0.5%。

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，南方高铁份额的赎回费用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，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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“绪言”部分，对“绪言”进行了更新。
- 3、在“释义”部分，对“释义”进行了更新。

- 4、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。
- 5、在“相关服务机构”部分，对“销售机构”进行了更新。
- 6、在“基金份额的申购和赎回”部分，对“申购与赎回的数额限制”进行了更新。
- 7、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。
- 8、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。
- 9、在“其他应披露事项”部分，对“其他应披露事项”进行了更新。
- 10、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
2018年1月8日