

**南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书（更新）摘要**  
(2017 年第 1 号)

基金管理人：南方基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
截止日：2017 年 12 月 29 日

## 重要提示

本基金经中国证监会 2016 年 11 月 30 日证监许可[2016]2985 号文注册募集。本基金的基金合同已于 2017 年 6 月 28 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，本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。本基金为南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金（简称“目标 ETF”）的 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。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》，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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人基金投资的“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，由投资人自行承担。。

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 2017 年 12 月 29 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行会计专业翻译、光大银行证券部职员、美国 NASDAQ 实习职员、证监会处长、副主任、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、南方东英资产管理有限公司董事。

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，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。曾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，曾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。曾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，曾任高级研究员、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）。

史博先生，副总裁，经济学硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍。曾任博时基金管理有限公司研究员、市场部总助、中国人寿资产管理有限公司股票部高级投资经理、泰达宏利基金管理有限公司投资副总监、研究总监、首席策略分析师、基金经理。2009 年加入南方基金管理有限公司，曾任基金经理、研究部总监、总经理助理兼首席投资官（权益），现任南方基金管理有限公司副总裁、首席投资官（权益）。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士，中国籍。曾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，曾任运作保障部总监、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

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）李海鹏先生，副总裁兼首席投资官（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铄先生。

### 1.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

## § 2 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至2017年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工218人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场

形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 745 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12、建立并保存基金份额持有人名册；
- 13、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；



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

16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

17、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

21、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### （五）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

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

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在

总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

### 4、内部风险控制措施实施

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

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

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

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

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

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

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

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

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

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

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

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### (六) 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《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应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 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
2	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

3	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：鲁娟 电话：010-89198762 客服电话：96198；400-88-96198； 400-66-96198 网址：www.bjrcb.com
4	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
5	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
6	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
7	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

8	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
9	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：刘强 电话：020-22389067 传真：020-22389031 客服电话：95313 网址：www.grcbank.com
10	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
11	四川天府银行股份有限公司	注册地址：四川省南充市涪江路1号 办公地址：四川省成都市锦江区下东大街258号 法定代表人：黄光伟 联系人：樊海波 电话：028-67676033 客服电话：400-16-96869 网址：www.tf.cn
12	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

13	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
14	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.
15	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：浙江省杭州市上城区望江东路59号 法定代表人：王钧 联系人：陈妍宇 电话：0571-87788979 传真：0571-87788818 客服电话：400-88-96575 网址：www.zjtlcb.com
16	中原银行股份有限公司	注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦 办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦 法定代表人：窦荣兴 联系人：牛映雪 电话：0371-85517710 传真：0371-85519869 客服电话：95186 网址：www.zybank.com.cn

17	湖北银行股份有限公司	注册地址：武汉市武昌区水果湖街中北路86号汉街总部国际8栋 办公地址：武汉市武昌区水果湖街中北路86号汉街总部国际8栋 法定代表人：刘志高 联系人：李昕雅 电话：027-87139129 传真：027-87135931 客服电话：（湖北）96599 （全国）400-85-96599 网址：www.hubeibank.cn
18	晋中银行股份有限公司	注册地址：山西省晋中市榆次区迎宾西街65号 办公地址：山西省晋中市榆次区迎宾西街65号 法定代表人：刘海滨 联系人：贺莎莎 电话：18634889009 客服电话：95105678 网址：www.jzbank.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 法定代表人：杨华辉 联系人：乔琳雪 联系电话：021-38565547 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 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
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：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	<p>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</p>
9	广发证券股份有限公司	<p>注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室          办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼          法定代表人：孙树明          联系人：黄岚          客服电话：95575 或致电各地营业网点          网址：广发证券网 <a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a></p>
10	长城证券股份有限公司	<p>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</p>
11	招商证券股份有限公司	<p>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</p>
12	中信证券股份有限公司	<p>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</p>
13	申万宏源证券有限公司	<p>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</p>

		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
14	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
15	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
16	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：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
17	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551

		<p>客服电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn</p>
18	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 号青岛国际金融中心 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 网址：www.citicssd.com</p>
19	中银国际证券有限责任公司	<p>注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F 法定代表人：宁敏 联系人：王炜哲 联系电话：021-20328309 客服电话：4006208888 网址：www.bocichina.com</p>
20	信达证券股份有限公司	<p>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</p>
21	华西证券股份有限公司	<p>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</p>

22	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
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	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
25	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
26	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

27	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：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
28	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
29	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
30	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
31	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

32	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
33	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
34	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
35	西部证券股份有限公司	注册地址：陕西省西安市东大街 319 号 8 幢 10000 室 办公地址：陕西省西安市东大街 319 号 8 幢 10000 室 法定代表人：刘建武 联系人：梁承华 电话：029-87211526 传真：029-87211478 客服电话：95582 网址：http://www.westsecu.com/
36	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

		<p>联系人：田芳芳                  联系电话：010-83561146                  客服电话：95399                  网址：www.xsdzq.cn</p>
37	恒泰证券股份有限公司	<p>注册地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层                  办公地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层                  法定代表人：庞介民                  联系人：熊丽                  客服电话：4001966188                  网址：www.cnht.com.cn</p>
38	中天证券股份有限公司	<p>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</p>
39	大通证券股份有限公司	<p>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</p>
40	东兴证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层                  办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层                  法定代表人：魏庆华                  联系人：夏锐                  电话：010-66559079                  传真：010-66555133                  客服电话：95309                  网址：www.dxzq.net</p>



41	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>
42	川财证券有限责任公司	<p>注册地址：中国（四川）自由贸易试验区                  成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心                  B 座 17 楼                  办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成                  都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B                  座 17 楼                  法定代表人：孟建军                  联系人：匡婷                  电话：028-86583053                  传真：028-86583002                  客服电话：95105118                  网址：www.cczq.com</p>
43	上海华信证券有限责任公司	<p>注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号                  环球金融中心 9 楼                  办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明                  天广场 20 楼                  法定代表人：陈灿辉                  联系人：徐璐                  电话：021-63898427                  客服电话：400-820-5999                  网址：www.shhxzq.com</p>
44	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>

45	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
46	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
47	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
48	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

49	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
50	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
51	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
52	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

53	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
54	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	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
55	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
56	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

57	北京植信基金销售有限公司	注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67 办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼 法定代表人：于龙 联系人：吴鹏 电话：010-56075718 传真：010-67767615 客服电话：4006-802-123 网址： <a href="http://www.zhixin-inv.com">http://www.zhixin-inv.com</a>
58	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： <a href="http://www.66zichan.com">http://www.66zichan.com</a>
59	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： <a href="http://www.xds.com.cn">www.xds.com.cn</a>
60	上海陆金所基金销售有限公司	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：胡学勤 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址： <a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>

61	北京虹点基金销售有限公司	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：胡伟 联系人：陈铭洲 电话：18513699505 客服电话：400-068-1176 网址：www.hongdianfund.com
62	北京新浪仓石基金销售有限公司	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
63	珠海盈米财富管理有限公司	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
64	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	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/

65	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：黄祎 电话：021-63333389-230 传真：021-63333390 客服电话：4006-433-389 网址：www.vstonewealth.com
66	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 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
67	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：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
68	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

69	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： <a href="https://www.danjuanapp.com">https://www.danjuanapp.com</a>
70	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：上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-35385521 传真：021-55085991 客服电话：400-820-5369 网址： <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>
71	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 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 法定代表人：江卉 联系人：徐伯宇 电话：010-89188356 传真：010-89189566 客服电话：95118 网址： <a href="http://jr.jd.com">jr.jd.com</a>
72	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：上述代销机构中，上海华信证券有限责任公司仅代销本基金A类份额。

### 3.2 登记机构

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）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

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：丁媛

电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

经办律师：黎明、丁媛

### 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

南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

## § 5 基金的类型

联接基金

## § 6 基金的投资目标

本基金通过投资于目标 ETF，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

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。此外，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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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

本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争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 0.35%，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，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、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。

### （二）目标 ETF 投资策略

本基金投资目标 ETF 的方式如下：

（1）申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF。

（2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。

当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

### （三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

### （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；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

### （七）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

本基金的标的指数为中证银行指数。

本基金业绩比较基准为标的指数收益率 $\times 95\%$ +银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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%。业绩比较基准与投资比例相符。

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，在按监管部门要求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），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

本基金的目标 ETF 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、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场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 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	431,320.00	2.44
	其中：股票	431,320.00	2.44
2	基金投资	15,891,578.64	89.85
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	1,176,450.24	6.65
8	其他资产	187,783.69	1.06
-	合计	17,687,132.57	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

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	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮 政业	-	-
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	431,320.00	2.45
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	431,320.00	2.45

## 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

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	2,400	61,320.00	0.35
2	601166	兴业银行	3,100	53,599.00	0.30
3	600016	民生银行	5,600	44,912.00	0.26
4	601328	交通银行	6,600	41,712.00	0.24
5	600000	浦发银行	2,600	33,462.00	0.19
6	601288	农业银行	8,700	33,234.00	0.19
7	601398	工商银行	5,000	30,000.00	0.17
8	002142	宁波银行	1,600	25,248.00	0.14
9	601169	北京银行	3,100	23,126.00	0.13
10	601988	中国银行	5,200	21,424.00	0.12

## 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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	南方中证银行ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	15,891,578.64	90.42

## 10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 10.2 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。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；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

## 11. 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。

## 12. 投资组合报告附注

## 12.1

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。

## 12.2

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。

## 12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	3,155.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	312.86
5	应收申购款	184,315.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
-	合计	187,783.69

## 12.4 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。

## 12.5 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。

### 南方中证银行 ETF 联接 A

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
2017.6.29-2017.9.30	-1.54%	0.61%	3.64%	0.83%	-5.18%	-0.22%
自基金成立至今	-1.54%	0.61%	3.64%	0.83%	-5.18%	-0.22%

### 南方中证银行 ETF 联接 C

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
2017.6.29-2017.9.30	-1.65%	0.61%	3.64%	0.83%	-5.29%	-0.22%
自基金成立至今	-1.65%	0.61%	3.64%	0.83%	-5.29%	-0.22%

## § 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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《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；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）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扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分基金资产（若为负数，则E取0）

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 3、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类基金份额的基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

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提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人根据与销售机构签订的销售协议中约定的付款周期分别划付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第4-10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、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、本基金的申购费：

对于申购本基金A类份额的投资人，本基金的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 $\geq$ 500 万	每笔 1,000 元
----------------	------------

对于申购本基金 C 类份额的投资人，申购费率为零。

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、本基金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）：

#### A 类份额的赎回费

赎回时点 (T)	赎回费率
T<1 年	0.50%
1 年 $\leq$ T<2 年	0.25%
T $\geq$ 2 年	0

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。

#### C 类份额赎回费

赎回时点 (T)	赎回费率
T<30 天	0.5%
T $\geq$ 30 天	0

不低于赎回费总额的 75%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。

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“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“基金托管人”部分，对“基金托管人”进行了更新。

6、在“相关服务机构”部分，对“销售机构”进行了更新，对“审计基金财产的会计师事务所”进行了更新。

7、在“基金的募集”部分，对“基金的募集”进行了更新。

8、在“基金合同的生效”部分，对“基金合同的生效”进行了更新。

9、在“基金份额的申购和赎回”部分，对“申购与赎回的开放日及时间”进行了更新，对“申购与赎回的数额限制”进行了更新，对“基金转换”进行了更新，对“定投计划”进行了更新。

10、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。

11、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。

12、在“其他应披露事项”部分，对“其他应披露事项”进行了更新。

13、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2018年2月2日