

南方中证国有企业改革指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

公告日期：二〇二〇年十二月八日

一、重要声明与提示

《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）管理人南方基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人海通证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2020年12月1日刊登在中国证监会基金电子披露网站

（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）以及南方基金管理股份有限公司网站（www.nffund.com）上公告的《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金名称：南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）
- 2、基金简称及场内简称：改革基金
- 3、基金代码：160136
- 4、基金份额总额：130,115,880.83份（截止：2020年12月4日）
- 5、基金份额净值：1.0112元（截止：2020年12月4日）
- 6、本次上市交易份额：65,388,862.00份
- 7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 8、上市交易日期：2020年12月11日
- 9、基金管理人：南方基金管理股份有限公司
- 10、基金托管人：海通证券股份有限公司
- 11、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的历史沿革与上市交易

（一）本基金的历史沿革

南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）由南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金转型而来。

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金为契约型开放式证券投资基金，经中国证监会2015年5月12日证监许可[2015]886号文注册募集，基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金自2015年5月25日至2015年5月29日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》于2015年6月3日正式生效。经中国证监会2020年7月13日证监许可[2020]1457号文《关于准予南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金变更注册的批复》，南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

金于 2020 年 10 月 30 日召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，内容包括南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金取消分级运作机制、转型选择期安排、国企改革 A 份额与国企改革 B 份额的终止上市、基金份额的转换与折算、投资范围、投资策略、投资限制、基金费率水平、收益分配原则、自动清盘条款以及授权基金管理人相应修订《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》等，并同意将转型后基金更名为“南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自 2020 年 12 月 1 日起，《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

（二）本次基金上市前基金基本情况

- 1、基金变更注册的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2020 年 7 月 13 日证监许可[2020]1457 号文。
- 2、基金合同生效日：2020 年 12 月 1 日
- 3、基金运作方式：契约型、上市开放式
- 4、基金合同期限：不定期
- 5、基金合同生效日的基金份额总额：130,115,880.83 份

（三）本基金上市交易的主要内容

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2020】1199 号
- 2、上市交易日期：2020 年 12 月 11 日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、上市交易份额简称：改革基金
- 5、交易代码：160136
- 6、本次上市交易份额：65,388,862.00 份
- 7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，其中 A 类基金份额可跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通，C 类基金份额不能进行跨系统转托管至场内。本基金自 2020 年 12 月 7 日开通 A 类基金份额的跨系统转托管业务。
- 8、基金资产净值的披露：开放式基金每个工作日交易结束后对基金资产净值进行的估值。基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2020 年 12 月 4 日，本基金持有人户数为 6,599 户，平均每户持有的基金份额为 19,717.51 份，其中场内持有人总户数为 2,293 户，场外持有人总户数为 4,306 户。

（二）持有人结构

截至 2020 年 12 月 4 日，本基金份额持有人结构如下：

投资者持有基金总份额为 130,115,880.83 份，场外投资者持有基金总份额为 64,727,018.83 份，场内投资者持有基金总份额为 65,388,862.00 份。场内个人投资者持有的基金份额为 57,243,021.00 份，占场内基金总份额的 87.54%。场内机构投资者持有的基金份额为 8,145,841.00 份，占场内基金总份额的 12.46%。

（三）截至 2020 年 12 月 4 日，前十名场内基金份额持有人情况

序号 持有人名称（全称） 持有基金份额 占场内基金份额的比例（%）

- 1 廖伟光 5,636,944.00 8.62%

- 2 中意人寿保险有限公司 2,778,090.00 4.25%
- 3
中国太平洋人寿保险股份有限公司—
传统—普通保险产品
2,437,172.00 3.73%
- 4 中国银河证券股份有限公司 1,785,583.00 2.73%
- 5 梁小红 1,774,399.00 2.71%
- 6 刁成芳 1,383,485.00 2.12%
- 7 孙毅 1,049,900.00 1.61%
- 8 李筱容 982,991.00 1.50%
- 9 赵从志 954,372.00 1.46%
- 10 李粤韩 815,528.00 1.25%
- 合计 19,598,464.00 29.97%

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

- 1、名称：南方基金管理股份有限公司
- 2、法定代表人：张海波
- 3、总裁：杨小松
- 4、注册资本：3.6172 亿元人民币
- 5、住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码 91440300279533137K
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
- 9、股权结构：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%。

10、内部组织结构及职能：

部门名称 主要职责

宏观策略部

- 1.负责公司产品标准化研究资源的整合与共享
- 2.负责宏观研究和大类资产配置策略研究
- 3.为各投研部门、市场部门提供投资决策依据和营销支持

权益投资部

- 1.负责权益产品、主动量化类产品的投资管理
- 2.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作
- 3.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

权益研究部

- 1.负责股票市场的行业与上市公司研究，提出投资建议并完成研究报告撰写
- 2.及时更新和维护股票池、研究数据以及研究模型
- 3.协助固定收益相关部门开展信用研究及可转债研究，并提出判断和建议
- 4.向销售市场相关部门提供研究支持服务

指数投资部

- 1.负责被动指数公募产品的投资管理

- 2.^根据量化模型，完成投资策略研究工作，并提出判断和建议
- 3.^参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作
- 4.^配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

固定收益投资部

- 1.^负责固定收益产品的投资管理
- 2.^参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作
- 3.^配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

现金投资部

- 1.^负责货币、短期理财等公募产品的投资管理
- 2.^参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作
- 3.^配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

固定收益研究部

- 1.^负责可转债研究和信用研究，提出投资建议并完成研究报告撰写
- 2.^向全国社保理事会提供支持服务
- 3.^向销售市场相关部门提供研究支持服务

国际业务部

- 1.^负责海外市场产品的研究、投资管理
- 2.^参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作
- 3.^配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

混合资产投资部

- 1.^负责“固收+”（固定收益资产投资+其他资产投资统称“固收+”）策略的公募产品和混合策略的非公募产品（包括专户、社保、基本养老、企业年金、职业年金、养老金产品）的投资管理
- 2..配合做好大类资产配置研究
- 3..为产品设计与市场营销提供支持
- 4..二级部门 FOF 投资部负责 FOF 产品的投资管理及提供投顾策略的输出

战略与产品

开发部

- 1..在战略与产品委员会的指导下，研究资产管理行业的发展战略，完成集团层面的战略规划撰写工作
- 2..研究国内外资产管理产品发展动态和创新趋势，进行产品创新、开发及储备，建设和维护公司产品库
- 3..负责公司创新业务的研究及孵化工作

产品管理部

- 1..负责公募、专户业务线产品日常管理与维护工作
- 2..负责公募、专户业务线产品的立项、制作、报批与管理等

零售服务部

- 1..根据公司的业务发展需要，构建公司渠道营销服务体系，推动和协调分公司公募基金销售工作的开展；
- 2..进行公募基金（含一对多）等产品合作渠道开发、维护和管理，为分公司提供培训、服务和支持，促进公募基金（含一对多）等产品的销售、业务的拓展，保障公司公募基金资产管理规模持续发展。

机构服务部

1..根据公司经营目标和营销战略，进行公司机构客户公募业务、专户业务的营销策划、销售发动、营销支持、
营销推动、赋能一线和投后服务等工作；

2..提高公司机构客户在公募业务和专户业务的市场份额，完成公司对上述业务下达的经营任务。

战略客户部

1..根据公司整体经营目标，整合公司资源，针对战略客户提供全面综合的资产管理及研究支持服务；

2..开展公募、专户和创新业务的开拓与营销，维护与战略客户的良好合作关系，提高战略客户资产保有

规模，完成公司下达的经营任务指标。

养老金业务部

1..负责专户业务线养老金业务的销售管理、资源共享整合

2..根据公司养老金业务经营目标和战略进行整体营销规划

3..对集团的养老金业务提供专业服务与支持

北京、上海、深圳、南京、

成都分公司

1..负责组织完成所辖片区的银行、财务公司、券商、保险、企事业单位及高净值人群的客户销售与拓展

2..开展资产创设业务与另类产品交叉销售工作

3..维护相关政府、监管机构和行业协会关系，提供相关接待及后勤服务

4..完成公司下达的预算指标和利润指标

合肥分公司

（理财中心）

1..履行理财中心相关职能

2..通过电话、网络等多种服务通道，为客户提供集理财咨询和资讯为一体的专业理财顾问服务

3..合肥理财中心隶属客户关系部

网络金融部

1..负责公募业务线上渠道的整体管理工作，包括线上渠道发展规划、平台和网站建设及维护等

2..负责线上渠道的营销管理工作，包括线上渠道推广、线上渠道营销方案的制定、线上销售市场情况及

销售数据分析等

企划部

1..负责集团企业文化建设、品牌形象规划与实施

2..负责销售、宣传、活动等创意策划

3..为集团销售前台做好营销支持，提高公司的公众认知度和美誉度

客户关系部

1..建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和建议，处理客户投诉；

2..搭建客户分类分级服务体系，进行客户信息分析和挖掘；运用多种服务形式和服务手段，进行客户关

系的有效维护

监察稽核部

- 1..统筹集团层面的内控体系规划，建设并完善集团法律合规和监察稽核体系
- 2..负责合规风险和除投研交易外的其他业务操作风险的组织协调与管理工作。
- 3..监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制情况、委员会的运作情况
- 4..为公司各项业务发展提供法律支持

风险管理部

- 1..统筹集团层面的风险管理规划，建设并完善集团风险管理系统和投资监控体系
- 2..负责市场风险、投研交易类操作风险、信用风险、流动性风险等风险的组织协调与管理工作，进行风险预防、评估、监控、报告，对风险处置情况进行持续跟踪
- 3..提供风险管理金融工程方面的支持及产品业绩归因分析，为公司风险管理决策提供专业支持

交易管理部

- 1..负责组合交易和交易执行等策略的研究和制定
- 2..负责交易实施，降低交易成本、获得交易收益、防范交易过程中的风险
- 3..负责交易分析和新产品持续研究，提供相关交易支持

信息技术部

- 1..根据集团业务发展战略要求，完成集团信息系统的规划
- 2..负责集团信息系统的建设和应用开发，持续完善集团信息化建设
- 3..负责集团信息系统的运行维护，提升运营效率，支持集团业务发展运作保障部

- 1..统筹集团层面的基金运营管理，搭建集团层面的统一运营服务平台
- 2..负责基金的投资清算、会计与估值、信息披露等基金会计工作
- 3..负责基金的注册登记、清算交收、数据统计及费用核算等工作

人力资源部

党委组织部

- 1..统筹集团层面的人力资源规划，制定集团人力资源政策
- 2..负责人力资源体系建设，实施人才招聘、培养、激励与保留，提供相关人力资源服务，支持公司业务发展
- 3..人力资源部与党委组织部合署办公，协助党委开展党员干部的选拔任用、管理监督、调整配备工作

办公室

党委办公室

- 1..统筹集团层面的战略规划、组织评价、检查督办、制度梳理、流程管理和文件归档工作
- 2..负责公司公文流转、办公文秘、公司会议组织及会议事项督办等工作
- 3..负责行政后勤、招投标采购管理、基建管理、办公安全等保障类工作
- 4..负责董事会办公室、工会、公益事业等日常事务工作
- 5..办公室与党委办公室合署办公，协助党委领导处理日常党务工作，贯彻并跟进党委会决议执行情况，开展党员发展培养和党员先进性教育等工作

财务部

- 1..负责集团预算管理工作
- 2..执行集团财务规划、资本优化以及财务风险预警管理，对公司财务状况进行监控和分析

3..负责资金管理、会计核算、财务信息披露及税务管理，支持公司业务发展

基础设施基金投资管理

部

1..负责公开募集基础设施证券投资基金产品的研究、投资和运营管理工作

2..联合南方资本、战略与产品开发部完成基础设施基金的业务承揽、产品创设等工作

3..配合市场销售相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

11、人员情况：

截止到 2020 年 9 月 30 日，我公司共有员工 763 人，博士 22 人、硕士 545 人、本科 180 人、其他 16 人。

12、信息披露负责人：常克川

咨询电话：400-889-8899

13、基金管理业务情况简介：

截至 2020 年 9 月 30 日，南方基金管理股份有限公司旗下共管理 233 只开放式基金及多只专户产品、社保投资组合和企业年金投资组合，管理总资产规模约 11,301 亿元人民币，旗下管理的开放式基金有南方稳健成长、南方宝元债券型基金、南方现金增利基金、南方积极配置混合型、南方高增长混合型、南方多利增强债券型、南方稳健成长贰号、南方绩优成长混合型、南方成份精选混合型、南方全球精选配置、南方隆元产业主题混合型、南方盛元红利混合型、南方优选价值混合型、南方沪深 300ETF 联接、南方中证 500ETF 联接 (LOF)、深证成份 ETF、南方深证成份 ETF 联接、南方策略优化混合型、中证南方小康产业 ETF、中证南方小康产业 ETF 联接、南方广利回报债券型、南方金砖四国指数、南方优选成长混合型、上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接、南方香港优选股票型、南方新兴消费增长股票型、南方金利定期开放债券型、南方润元纯债债券型、南方高端装备灵活配置混合型、南方理财 60 天债券型、中证 500ETF、南方沪深 300ETF、南方永利 1 年定期开放债券型(LOF)、南方稳利 1 年定期开放债券型、南方丰元信用增强债券型、南方聚利 1 年定期开放债券型(LOF)、南方现金货币市场基金、南方医药保健灵活配置混合型、南方新优享灵活配置混合型、南方通利债券型、中国梦灵活配置混合型、南方薪金宝货币市场基金、南方天元新产业股票型、南方启元债券型、中证 500 医药卫生指数 ETF、南方绝对收益策略定期开放混合型发起式、南方理财金交易型货币市场基金、南方收益宝货币市场基金、南方恒生 ETF、南方中证 100 指数、南方产业活力股票型、南方二元债券型、南方创新经济灵活配置混合型、中证 500 工业指数 ETF、中证 500 原材料指数 ETF、南方利淘灵活配置混合型、南方大数据 100 指数、南方改革机遇灵活配置混合型、南方利鑫灵活配置混合型、南方利众灵活配置混合型、南方潜力新蓝筹混合型、南方中证国有企业改革指数、南方中证高铁产业指数、南方大数据 300 指数、中证 500 信息技术指数 ETF、南方量化成长股票型、南方中证互联网指数、南方利达灵活配置混合型、南方国策动力股票型、南方香港成长灵活配置混合型、南方中小盘成长股票型、南方利安灵活配置混合型、南方荣光灵活配置混合型、南方顺康灵活配置混合型、南方弘利定期开放债券型发起式、南方沪港深价值主题灵活配置混合型、南方瑞利灵活配置混合型、南方核心竞争混合型、南方益和灵活配置混合型、南方日添益货币市场基金、南方君选灵活配置混合型、南方亚洲美元收益债券型、南方转型驱动灵活配置混合型、南方新兴龙头灵活配置混合型、南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式、南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接、南方原油、南方品质优选灵活配置混合型、南方荣欢定期开放混合型发起式、南方荣冠定期开放混合型、南方中证 500 信息技术指数 ETF 发起式联接、南方中债 10 年期国债指数、南方转型增长灵活配置混合型、南方安泰混合型、南方颐元定期开放债券型发起式、南方多元定期开放债券型发起式、南方中证 1000ETF、南方天天利货币市场基金、南方荣发定期开放混合型发起式、

南方卓元债券型、南方安裕混合型、南方荣安定期开放混合型、南方中证 500 量化增强股票型发起式、南方宣利定期开放债券型、南方安颐混合型、南方宏元定期开放债券型发起式、南方现代教育股票型、南方中证全指证券公司 ETF 联接、南方军工改革灵活配置混合型、南方中证全指证券公司 ETF、南方智慧精选灵活配置混合型、南方和元债券型、南方纯元债券型、南方安康混合型、南方中证银行 ETF、南方中证银行 ETF 发起式联接、南方荣年定期开放混合型、南方安睿混合型、南方平衡配置混合型、南方恒生 ETF 联接、南方祥元债券型、南方中证申万有色金属 ETF、南方金融主题灵活配置混合型、南方智造未来股票型、南方天天宝货币市场基金、南方中证全指房地产 ETF 发起式联接、南方中证全指房地产 ETF、南方中证申万有色金属 ETF 发起式联接、南方兴利半年定期开放债券型发起式、南方兴盛先锋灵活配置混合型、南方全天候策略混合型 FOF、南方道琼斯美国精选 REIT 指数(QDII-LOF)、南方安福混合型、南方互联网+灵活配置混合型、南方优享分红灵活配置混合型、南方卓利 3 个月定期开放债券型发起式、南方融尚再融资主题精选灵活配置混合型、南方安养混合型、南方恒生中国企业 ETF、南方恒生中国企业 ETF 联接、南方乾利定期开放债券型发起式、南方浙利定期开放债券型发起式、南方希元可转债债券型、MSCI 中国 A 股国际通 ETF、南方涪利定期开放债券型发起式、南方成安优选灵活配置混合型、南方瑞祥一年定期开放灵活配置混合型、南方君信灵活配置混合型、MSCI 中国 A 股国际通 ETF 发起式联接、南方 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型(LOF)、南方共享经济灵活配置混合型、南方瑞合三年定期开放混合型发起式(LOF)、南方泽元债券型、南方赢元债券型、南方人工智能主题混合型、南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型 FOF、南方中债 1-3 年国开行债券指数、南方吉元短债债券型、南方中债 3-5 年农发行债券指数、南方交元债券型、南方畅利定期开放债券型发起式、南方昌元可转债债券型、南方国利 6 个月定期开放债券型发起式、南方合顺多资产配置混合型 FOF、南方华元债券型、南方臻元债券型、南方亨元债券型发起式、南方智诚混合型、南方中债 7-10 年国开行债券指数、南方鑫利 3 个月定期开放债券型发起式、南方惠利 6 个月定期开放债券型、南方科技创新混合型、南方富元稳健养老目标一年持有期混合型 FOF、南方恒庆一年定期开放债券型、南方致远混合型、南方顶峰 TOPIXETF(QDII)、南方初中短债债券型发起式、南方信息创新混合型、南方旭元债券型发起式、南方甄智混合型发起式、南方泰元债券型发起式、南方恒新 39 个月定期开放债券型、南方全球精选债券型发起式(QDII)、南方贺元利率债债券型、南方聪元债券型发起式、南方智锐混合型、南方梦元短债债券型、南方定元中短债债券型、南方皓元短债债券型、南方粤港澳大湾区创新 100ETF、南方养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式 FOF、南方 ESG 主题股票型、南方远利 3 个月定期开放债券型发起式、南方宝泰一年持有期混合型、南方创利 3 个月定期开放债券型发起式、南方宁利一年定期开放债券型发起式、南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF、南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF 联接、南方内需增长两年持有期股票型、南方尊利一年定期开放债券型发起式、南方骏元中短期利率债债券型、南方鼎利一年定期开放债券型发起式、南方宝丰混合型、南方中债 0-5 年中高等级江苏省城投类债券指数、南方乐元中短期利率债债券型、南方粤港澳大湾区创新 100ETF 发起式联接、南方得利一年定期开放债券型发起式、南方集利 18 个月定期开放债券型、南方瑞盛三年持有期混合型、南方中债 1-5 年国开行债券指数、南方沪深 300 指数增强型、南方上证 50 指数增强型发起式、南方誉慧一年持有期混合型、南方招利一年定期开放债券型发起式、南方誉丰 18 个月持有期混合型、南方成长先锋混合型、南方昭元债券型发起式、南方升元中短期利率债债券型、南方荣尊混合型、南方核心成长混合型、南方创新精选一年定期开放混合型发起式、南方养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式 FOF、南方高股息主题股票型、南方科创板 3 年定期开放混合型、南方养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式 FOF、南方景气驱动混合型、南方中债 0-2 年国

开行债券指数、南方产业优势两年持有期混合型、南方创新驱动混合型、南方创业板 2 年定期开放混合型、南方创新成长混合型；以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

14、本基金基金经理简介

孙伟先生，管理学学士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。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、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至今，任改革基金、高铁基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF、南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理。

（二）基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）

住所：上海市黄浦区广东路 689 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 30 层 3002 单元

法定代表人：周杰

成立时间：1988 年 8 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行银复【1988】383 号

基金托管业务批准文号：证监许可【2013】1643 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：1150170.0000 万元整

存续期间：持续经营

联系人：郭兴邦

联系电话：021-23219000

2、主要人员情况

周杰先生，工学硕士，2016 年 10 月 28 日至今担任海通证券董事长，2016 年 7 月至今担任海通证券党委书记。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(于上交所上市，股份代号:601607；于香港联交所上市，股份代号:02607)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 月至今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:00981)非执行董事。周先生 2016 年至今任上海证券交易所监事、薪酬委员会主任，2016 年至今任上海证券同业公会会长，2017 年至今任上海金融业联合会副理事长，2016 年至今任上海上市公司协会理事会副会长，2016 年至今任中国互联网金融协会会员代表，2017 年至今任上海金融理财师协会会长，2017 年至今任上海市仲裁委仲裁员。

陈春钱先生，海通证券总经理助理，负责公司经纪业务。陈先生还兼任海通证券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，担任海通证券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，拥有证券从业资格与基金从业资格。自 1995 年已有 23 年金融从业经历。先后从事过银行证券投资、证券经纪业务管理、证券财富管理、资产托管业务管理等工作。其中 1995 年至 2001 年在交通银行绍兴分行证券部，负责证券投资业务。2001 年至 2013 年分别在海通证券上虞营业部担任总经理等职务，在此期间其管理的证券营业部连续七年荣获“十佳营业部”荣誉。2013 年至今分别在海通证券企业及私人客户部和基金托管部担任副总经理、总经理，负责公司专业机构客户财富管理业务和资产托管业务管理。

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。

（三）验资机构

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

联系人：曹阳

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、曹阳

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

本次基金转型期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从转型后基金资产中支付。

本基金转型后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）2020 年 12 月 4 日资产负债表如下：

资产 期末余额_1 负债和所有者权益 期末余额_

资产： - 负债： -

银行存款 5,380,037.34 短期借款 -
 结算备付金 473.01 短期借款 -
 存出保证金 45,363.16 交易性金融负债 -
 交易性金融资产 126,289,597.47 衍生金融负债 -
 股票投资 125,092,447.47 卖出回购金融资产款 300,000.00
 债券投资 1,197,150.00 应付证券清算款 -
 资产支持证券投资 - 应付赎回款 -
 理财投资 - 应付管理人报酬 7,190.29
 权证投资 - 应付托管费 1,438.05
 基金投资 - 应付销售服务费 -
 衍生金融资产 - 应付投资顾问费 -
 可供出售金融资产减值准备 - 应付交易费用 2,005.62
 买入返售金融资产 - 应付税费 0.54
 应收证券清算款 300,000.00 应付利息 -
 应收利息 37,329.23 应付利润 -
 应收股利 - 应付代减持资产 -
 应收申购款 - 其他负债 162,859.83
 其他资产 - 负债合计 473,494.33
 - 所有者权益 -
 - 实收基金 137,248,067.13
 - 资本公积 -
 - 未分配利润 -5,668,761.25
 - 所有者权益合计 131,579,305.88
 资产总计 132,052,800.21
 未分配负债和所有者权益合计利润 132,052,800.21

八、基金投资组合

截止到 2020 年 12 月 4 日，南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

1.1 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 125,092,447.47 94.73

其中：股票 125,092,447.47 94.73

2 基金投资 --3 固定收益投资 1,197,150.00 0.91

其中：债券 1,197,150.00 0.91

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 5,380,510.35 4.07

8 其他资产 382,692.39 0.29

9 合计 132,052,800.21 100.00

1.2 按行业类别分类的股票投资组合

1.2.1 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 4,852,748.60 3.69

C 制造业 62,131,376.79 47.22

D
 电力、热力、燃气及水生产和供
 应业
 4,578,237.00 3.48

E 建筑业 5,106,683.00 3.88

F 批发和零售业 --G 交通运输、仓储和邮政业 3,194,276.62 2.43

H 住宿和餐饮业 --I
 信息传输、软件和信息技术服务
 业
 5,074,343.16 3.86

J 金融业 26,880,308.28 20.43

K 房地产业 8,095,929.00 6.15

L 租赁和商务服务业 3,302,774.02 2.51

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 1,875,771.00 1.43

S 综合 --合计 125,092,447.47 95.07

1.2.2 按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：截止 2020 年 12 月 4 日，本基金未持有港股通股票投资。

1.2.3 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 601166 兴业银行 217,294 4,589,249.28 3.49

2 002415 海康威视 96,700 4,435,629.00 3.37

3 600036 招商银行 95,600 4,376,568.00 3.33

4 000858 五粮液 15,530 4,149,460.70 3.15

5 601398 工商银行 718,100 3,813,111.00 2.90

6 000002 万科 A 123,800 3,714,000.00 2.82

7 600030 中信证券 117,600 3,563,280.00 2.71

8 600900 长江电力 175,200 3,525,024.00 2.68

9 000725 京东方 A 654,000 3,505,440.00 2.66

10 600309 万华化学 41,400 3,492,504.00 2.65

1.2.4 按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 国家债券 298,680.00 0.23

2 央行票据 --3 金融债券 898,470.00 0.68

其中：政策性金融债 898,470.00 0.68

4 企业债券 --5 企业短期融资券 --6 中期票据 --7 可转债（可交换债） --8 同业存单 --
 -9 其他 --10 合计 1,197,150.00 0.91

1.2.5 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

序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值（元）
 占基金资产净值比
 例（%）

1 018013 国开 2004 9,000 898,470.00 0.68

2 019640 20 国债 10 3,000 298,680.00 0.23

1.2.6 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
截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有资产支持证券。

1.2.7 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
截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有贵金属。

1.2.8 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
截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有权证。

1.2.9 本基金投资的股指期货交易情况说明
截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有股指期货。

1.2.10 本基金投资的国债期货交易情况说明
截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有国债期货。

1.2.11 投资组合报告附注

基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查, 不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库, 本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

1.2.11.1 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 45,363.16

2 应收证券清算款 300,000.00

3 应收股利 -4 应收利息 37,329.23

5 应收申购款 -6 其他应收款 -7 待摊费用 -8 其他 -9 合计 382,692.39

1.2.11.2 持有的处于转股期的可转换债券明细

截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有可转换债券。

1.2.11.3 前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止 2020 年 12 月 4 日, 本基金未持有流通受限股票。

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件, 披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息, 并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后, 将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一) 严格遵守《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定, 以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定, 对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查; 如发现基金管理人违反《证券基金法》、

《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；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，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、 基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会准予南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金变更注册的批复
- (二) 《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- (三) 《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- (四) 《南方中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

风险提示：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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

南方基金管理股份有限公司

2020年12月8日

附件：基金合同摘要

一、 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务；

(14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金申购、赎回、转换、定投和非交易过户的业务规则;

(17) 在遵守届时有效的法律法规和监管规定, 且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项, 基金管理人有权代表基金份额持有人在必要限度内以基金资产作为质押进行融资;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

(1) 依法募集资金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2) 办理基金备案手续;

(3) 自《基金合同》生效之日起, 以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5) 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, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;

(6) 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, 不得委托第三人运作基金财产;

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定, 按有关规定计算并披露基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回的价格;

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;

(12) 保守基金商业秘密, 不泄露基金投资计划、投资意向等。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应予保密, 不向他人泄露, 但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外;

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案, 及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14) 按规定受理申购与赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法律法规规定的最低期限;

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出, 并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式, 随时查阅到与基金有关的公开资料, 并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

(18) 组织并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;

(19) 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并通知基金托

管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册；

(26) 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。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券、期货等交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(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等投资所需账户，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，审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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》及《托管协议》的规定进行；如果基金管

理人有未执行《基金合同》及《托管协议》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不少于法律法规规定的最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收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) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法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业监督管理机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》及《托管协议》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，应为基金份额持有人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。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》，但基金合同另有约定的除外；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- (6) 变更基金类别，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 终止基金上市，但基金合同另有约定的除外；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率、销售服务费率或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式或增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- (4) 在不违反法律法规、《基金合同》的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (7) 当法律法规或中国证监会的相关规定变更时，本基金在履行相关程序后可对资产配置比例进行适当调整；
- (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或

基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额

持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有同等表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

(七) 计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数。

(三) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。

- 5、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日在规定媒介公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为同一类别的基金份额。现金分红及红利再投资的计算方法等有关事项基金份额，依照《业务规则》执行。对于场内基金份额，则遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

四、基金费用与税收

（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；
- 5、基金上市费用及年费；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 7、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金的证券/期货交易费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、基金相关账户的开户及维护费用；
- 12、因参与融资及转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 13、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，由托管人根据与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，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，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 0.1% 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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与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，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.1%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，由托管人根据与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，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

4、基金合同生效后的指数许可使用费

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支付指数使用许可费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、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许可使用费。基金管理人将在招募说明书及其更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“（一）基金费用的种类”中第 5—13 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。

五、基金财产的投资范围和投资限制

（一）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或注册发行的股票以及存托凭证（下同））、债券资产（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、可交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、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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。

基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金 80% 以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）。本基金投资于标的指数成份股和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、国债期货合约、股票期权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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

基金管理人根据相关规定可参与融资、转融通证券出借业务。

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。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金 80%以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）；
- (2) 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%；
- (3) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
- (4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (6) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (7) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (9) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (10) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (12) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；
- (13) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：
 - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；
 - 2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
 - 3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。
 - 4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；
 - 5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；
- (14) 本基金参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：
 - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；
 - 2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

4) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(15) 本基金参与股票期权交易, 应当符合下列投资限制:

1) 基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%;

2) 开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(16) 本基金参与转融通证券出借业务的, 应当符合下列要求:

1) 本基金在任何交易日日终, 参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%, 其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

2) 本基金在任何交易日日终, 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%;

3) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天, 平均剩余期限按市值加权平均计算;

4) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元。

(17) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

(18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行;

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(3)、(8)、(11)、(12)项另有约定外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

本基金参与转融通证券出借业务, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(16)项规定的, 基金管理人不得新增出借业务。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的, 以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，各类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定披露。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

(二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低期限。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、本基金由南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金转型而来。《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，自南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金份额转换基准日的次日起生效。

2、《基金合同》的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。