

## 南方策略优化股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2012 年第 1 号）

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

本招募说明书（更新）摘要内容截止日：2012 年 3 月 30 日

### 重要提示

本基金经中国证监会 2010 年 1 月 6 日证监许可[2010]9 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 3 月 30 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、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；本基金量化投资策略的有关风险等等。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

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 2012 年 3 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 3 月 31 日（未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）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：深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

成立时间：1998年3月6日

法定代表人：吴万善

注册资本：1.5亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：鲍文革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年，经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股，注册资本达到1亿元人民币。2005年，经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股，注册资本达1.5亿元人民币。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%。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

吴万善先生，董事，中共党员，大学/EMBA。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事长、党委副书记、南方基金管理有限公司董事长。

张涛先生，董事，中共党员，博士研究生。历任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理、深圳总部副总经理、深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任；现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员。

姜健先生，董事，中共党员，硕士研究生。历任南京农业大学教师；华泰证券人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行部股票事务部副经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部总经理、资产管理总部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务南京总部总经理、总裁助理兼上海总部总经理、公司机构客户服务部总经理。现任华泰证券股份有限公司副总裁、董事会秘书、党委委员。

李真先生，董事，中共党员，材料工程、企业管理双学士，高级工程师。历任机械工业部科技司材料工艺处、科研管理处副主任科员、总工程师秘书、科技与质量监督司行业技术

处处副处长；深圳亚洲金刚石有限公司副总经理（干部交流）；深圳市投资管理公司董事局秘书处副主任、综合部副部长、部长、总裁助理兼工业一部部长、办公室主任；深圳市通产实业有限公司党委书记、董事长；深圳会展中心管理有限责任公司党委书记、总经理、董事长；现任深圳市投资控股有限公司董事、总经理、党委副书记。

周建国先生，董事，中共党员，经济学硕士。历任某公社会计、团委书记；江西财经学院教师、企业财务教研室负责人、会计系办公室主任、会计系副主任、成人教育处处长（副教授）；深圳中旅信实业有限公司副总经理；深圳市商贸投资控股公司审计部部长、计财部部长，兼任商控实业有限公司董事长、党委书记，深圳市商贸投资控股公司总裁助理；深圳市投资控股有限公司计划财务部部长；深圳市投资控股有限公司副总经理；现任深圳经济特区房地产（集团）股份有限公司董事长。

洪文瑾女士，董事，中共党员，硕士研究生。历任厦门经济特区建设发展公司财务部，厦门建发集团有限公司财务部副经理、厦门建发信托投资公司副总经理、总经理，厦门国际信托投资有限公司总经理，现任厦门国际信托有限公司董事长。

庄园芳女士，董事，工商管理硕士，经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人，证券投资部副总经理、总经理，投资总监；现任兴业证券股份有限公司副总裁。

高良玉先生，董事，中共党员，经济学硕士，经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任南方基金管理有限公司总裁、党委书记、南方东英资产管理有限公司（香港）董事会主席。

张磊先生，独立董事，工商管理硕士（MBA）及国际关系硕士，注册金融分析师(CFA)，获得美国 NASD Series 7 & 65 证书。曾工作于耶鲁大学投资基金办公室（Yale Endowment）及美国新生市场投资基金(Emerging Markets Management, LLC)，主要从事基金管理及相关研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表；现任 HCM 投资管理有限公司高级合伙人，United World College of Southeast Asia Foundation 校董、耶鲁大学校务委员会成员、国际顾问委员会成员，纽约金融分析师协会会员。

周春生先生，独立董事，博士。历任美国联邦储备委员会经济学家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会委员（副局级）、中国留美金融学会理事、美国经济学会、美国金融研究会会员，Annals of Economics and Finance 编委，北京大学光华管理学院院长助理、EMBA 中心主任、高层管理者培训与发展中心主任、财务金融学教授，香港大学荣誉教授，深圳证券交易所第一、二、三届上市委员会委员；现为长江商学院金融教授、EMBA 和高层培训项目学术主任，国家杰出青年基金获得者。

王全洲先生，独立董事，中共党员，大学学历，1997 年中国人民大学会计专业研究生班毕业，注册会计师、资产评估师、注册税务师；历任北京市财政局会计处副处长，北京会计公司总经理（正处级）；现任北京兴华会计师事务所董事长、主任会计师。

丛培国先生，独立董事，法学硕士。历任北京大学法律系经济法教研室助教、经济师讲师、经济法教研室副主任，美国加州大学洛杉矶校区（UCLA）客座教授、北京大学副教授；现任北京君佑律师事务所合伙人、事务所主任。

米志明先生，独立董事，本科，高级经济师、注册会计师。历任江苏省姜堰税务局副局长，扬州市税务局副局长，扬州市财政局局长、党组书记，扬州市人民政府副秘书长，建设银行扬州市分行行长、党组书记，财政部深圳专员办专员、巡视员。

## 2、监事会成员

骆新都女士，职工监事，经济学硕士，经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问；现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本娥女士，监事，本科。历任熊猫电子集团公司财务处财务处长，华泰证券计划资金部副总经理（主持工作）、稽查监察部副总经理、总经理；现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

周景民先生，监事，工学硕士、工商管理硕士（MBA），经济师。历任深圳三九企业集团三九贸易公司职员，深圳大鹏证券有限公司投资银行部项目经理、加拿大西蒙弗雷泽大学工商管理学院 MBA 学生兼助教，广东美的集团战略发展部高级经理，招商局集团中国南山开发（集团）公司研究发展部高级项目经理，深圳市投资控股有限公司投资部副经理、经理；现任深圳市投资控股有限公司投资部高级主管。

苏荣坚先生，监事，学士学位，高级经济师。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务部总监兼财务部总经理。

郑城美先生，监事，中共党员，经济学硕士。历任兴业证券华林营业部客户经理、研究中心市场分析师、经纪业务部市场分析师、办公室文秘部经理、南平滨江路营业部副总经理（主持工作）、计划财务部副总经理、财务部总经理；现任兴业证券财务总监兼计划财务部总经理。

苏民先生，职工监事，博士研究生，工程师。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监。

## 3、公司高级管理人员

吴万善先生，董事，中共党员，大学/EMBA。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事长、党委副书记、南方基金管理有限公司董事长。

高良玉先生，董事，总裁，中共党员，经济学硕士，经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长。1998 年加入南方基

金担任副总经理，现任南方基金管理有限公司总裁、党委书记、南方东英资产管理有限公司（香港）董事会主席。

俞文宏先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，经济师，历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003 年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委副书记。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000 年加入南方基金，历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士。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。

秦长奎先生，督察长，中共党员，工商管理硕士。历任南京汽车制造厂工程师、华泰证券公司营业部总经理、部门总经理、总裁助理。2005 年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司督察长、党委委员、纪委委员、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

#### 4、基金经理

刘治平先生，美国康奈尔大学工商管理硕士、美国佛罗里达州立大学计算物理学博士，曾获得美国证券及股票交易从业资格，具有中国基金从业资格。曾先后担任香港巴克莱投资银行可转债交易总监、美国纽约贝尔斯登可转债对冲基金经理及美国纽约美联投资银行自营投资董事总经理，2008 年 6 月加入南方基金，现任南方基金数量策略投资小组组长兼数量化投资部总监。2010 年 3 月至今，任南方策略基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

总裁高良玉先生，副总裁郑文祥先生，总裁助理兼投资总监邱国鹭先生，专户投资管理部总监吕一凡先生、固定收益部总监李海鹏先生，研究部总监史博先生、投资部执行总监陈键先生。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

## 2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截止 2011 年 12 月 31 日，招商银行总资产 2.795 万亿元人民币，核心资本充足率 8.22%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、运营室、监察稽核室 4 个职能处室，现有员工 52 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第

一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可，被境内外权威媒体评为“中国最佳托管专业银行”“中国资产托管市场创新客户满意首选品牌”6S 资产托管综合业务平台荣获“深圳市金融创新奖二等奖第一名”。

经过九年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2011 年，招商银行实现托管费收入 5.10 亿元，托管资产突破 5000 亿元，托管日均存款达到 274 亿元，各项指标均创历史新高。托管产品数量、托管资产规模稳居中小托管银行第一，开放式基金托管新增数量与首发规模规模居股份制托管银行第一，内部控制连续五年通过 ISAE3402 国际认证，第二次被境外权威媒体《财资》评为“中国最佳托管专业银行”，被《21 世纪经济报道》评为“2011 年度 VC/PE 最佳托管银行”。

## （二）主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999 年 3 月开始担任本公司董事。2010 年 8 月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司）董事长，及中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（深圳证券交易所上市公司）董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生，招商银行执行董事、行长兼首席执行官，1999 年 1 月加入本公司。经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员。1999 年 1 月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自 1999 年 9 月、2003 年 9 月、2007 年 11 月及 2008 年 10 月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长，并自 2002 年 7 月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995 年 5 月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006 年 4 月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公

司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，大学本科，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

胡家伟先生，大学本科学历，现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历，已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2012年3月31日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资



基金（QDII-LOF）、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金共 42 只开放式基金及其它托管资产，托管资产为 7384.05 亿元人民币。

#### （四）托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

##### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

##### 3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资

产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

（5）适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

（6）防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

#### 4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

#### (五) 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》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知限期内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠

对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、直销机构：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

法定代表人：吴万善

电话：(0755) 82763905、(0755) 82763906

传真：(0755) 82763900

联系人：张锐珊

##### 2、代销机构：

代销银行：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	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：傅育宁 联系人：邓炯鹏 客服电话：95555 公司网站：www.cmbchina.com
2	中国工商银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人：姜建清 联系人：陶仲伟 联系电话：010-66107900 客服电话：95588 公司网站：www.icbc.com.cn
3	中国建设银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街25号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人：王洪章 电话：010-66275654 传真：010-66275654 联系人：何奕 客服电话：95533 网址：www.ccb.com

4	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：蒋超良 客服电话：95599 公司网站：www.abchina.com
5	中国银行股份有限公司	地址：北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人：肖钢 联系电话：010-66594905 客服电话：95566 公司网站：www.boc.cn
6	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：胡怀邦 联系人：曹榕 联系电话：021-58781234 客服电话：95559 公司网站：www.bankcomm.com
7	中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街3号 办公地址：北京市西城区金融大街3号 法定代表人：李国华 客户服务电话：95580 联系人：陈春林 传真：(010) 68858117 公司网址：www.psbc.com
8	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：吉晓辉 联系人：倪苏云、虞谷云 联系电话：021-61618888 客服电话：95528 公司网站：www.spdb.com.cn
9	中信银行股份有限公司	注册地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 法定代表人：孔丹 联系人：丰靖 电话：010-65557083 客服电话：95558 网址：http://bank.ecitic.com/

10	广发银行股份有限公司	注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：董建岳 联系电话：0571-96000888， 020-38322222 客服电话：400-830-8003 公司网站：www.gdb.com.cn
11	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：董文标 联系人：董云巍 电话：010-57092615 传真：010-57092611 客服电话：95568 网址：www.cmbc.com.cn
12	中国光大银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦 办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 法定代表人：唐双宁 联系人：朱红 电话：010-63636153 传真：010-63636157 客服电话：95595 网址：www.cebbank.com
13	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：刘玲 联系电话：021-52629999 客服电话：95561 公司网站：www.cib.com.cn
14	深圳发展银行股份有限公司	地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 法定代表人：法兰克纽曼 (FrankN. Newman) 联系人：姜聘 联系电话：0755-82088888 客服电话：95501 公司网站：www.sdb.com.cn

15	杭州银行股份有限公司	办公地址：杭州凤起路 432 号 法定代表人：马时雍 联系人：江波 联系电话：0571-85108309 客服电话：0571-96523、400888508 公司网站：www.hzbank.com.cn
16	上海银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：宁黎明 联系人：张萍 联系电话：021-68475888 客服电话：021-962888 公司网站：www.bankofshanghai.com
17	北京银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号 法定代表人：闫冰竹 联系人：谢小华 电话：010-66223587 传真：010-66226045 客户服务电话：95526 公司网站：www.bankofbeijing.com.cn
18	北京农村商业银行股份有限公司	注册地址：西城区阜成门内大街 410 号 办公地址：北京市西城区金融大街 9 号金融街中心 B 座 法定代表人：乔瑞 联系人：王薇娜 电话：010-63229475 传真：010-63229478 客服电话：96198；400-88-96198；400-66-96198 网址：www.bjrcb.com
19	平安银行股份有限公司	注册地址：广东省深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦 办公地址：广东省深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦 法定代表人：孙建一 联系人：蔡宇洲 联系电话：0755-22197874 客服电话：4006699999

		公司网站: <a href="http://bank.pingan.com">http://bank.pingan.com</a>
20	烟台银行股份有限公司	注册地址: 山东省烟台市芝罘区海港路25号 办公地址: 山东省烟台市芝罘区海港路25号 法定代表人: 庄永辉 联系人: 刘杰 联系电话: 0535-6699663 客服电话: 4008-311-777 公司网站: <a href="http://www.yantaibank.net">www.yantaibank.net</a>
21	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址: 上海市浦东新区浦东大道981号 办公地址: 上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层 法定代表人: 胡平西 联系人: 吴海平 联系电话: 021-38576977 客服电话: 021-962999 公司网站: <a href="http://www.srcb.com">www.srcb.com</a>
22	东莞银行股份有限公司	注册地址: 东莞市运河东一路193号 办公地址: 东莞市运河东一路193号 法定代表: 廖玉林 联系人: 胡昱 联系电话: 0769-22119061 客服电话: 0769-96228 公司网站: <a href="http://www.dongguanbank.cn">www.dongguanbank.cn</a>
23	华夏银行股份有限公司	注册地址: 北京市东城区建国门内大街22号 办公地址: 北京市东城区建国门内大街22号 法定代表人: 吴建 联系人: 李慧 客服电话: 95577 公司网站: <a href="http://www.hxb.com.cn">www.hxb.com.cn</a>
24	青岛银行股份有限公司	注册地址: 山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦(邮编266071) 办公地址: 山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦(邮编266071) 法定代表人: 张广鸿 客服电话: (青岛) 96588, (全国) 400-66-96588 公司网站: <a href="http://www.qdccb.com">www.qdccb.com</a>



25	宁波银行股份有限公司	注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号 法定代表人：陆华裕 联系人：胡技勋 客服电话：96528，上海地区 962528 公司网站：www.nbcb.com.cn
26	南京银行股份有限公司	注册地址：南京市白下区淮海路 50 号 办公地址：南京市白下区淮海路 50 号 法定代表人：林复 联系人：翁俊 联系电话：025-84544021 客服电话：400-88-96400 公司网站：www.njcb.com.cn
27	临商银行股份有限公司	注册地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号 办公地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号 法定代表人：王傢玉 联系人：寇廷柱 联系电话：0539-8304657 客服电话：400-699-6588 公司网站：www.lsbchina.com
28	汉口银行股份有限公司	注册地址：江汉区建设大道 933 号武汉 商业银行大厦 办公地址：江汉区建设大道 933 号武汉 商业银行大厦 法定代表人：陈新民 联系人：骆芸 电话：027-82656224 客服电话：96558（武汉）、40060-96558 （全国） 公司网站：http://www.hkbchina.com
29	江苏张家港农村商业银行股份有限公司	注册地址：张家港市杨舍镇人民中路 66 号 办公地址：张家港市杨舍镇人民中路 66 号 法定代表人：王自忠 联系人：姚珍珍 联系电话：0512-56968257 客服电话：0512-96065 公司网站：www.zrcbank.com

30	浙商银行股份有限公司	注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号 办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号 法定代表人：张达洋 联系人：毛真海 联系电话：0571-87659546 客服电话：95527 公司网站：www.czbank.com
31	温州银行股份有限公司	注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼 办公地址：温州市车站大道 196 号 法定代表人：邢增福 联系人：林波 联系电话：0577-88990082 客服电话：0577-96699 公司网站：www.wzbank.cn
32	重庆银行股份有限公司	注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号 办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号 法定代表人：马千真 联系人：孔文超 电话：023-6379937913896198104 传真：023-63792412 客服电话：400-70-96899 网址：www.cqcbank.com
33	深圳农村商业银行股份有限公司	注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 法定代表人：李伟 联系人：曾明 宋永成 联系电话：0755-25188371、 0755-25188611 传真：0755-25188785 客服电话：4001961200 公司网址：www.961200.net
34	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址：东莞市南城路 2 号 办公地址：东莞市南城路 2 号 法定代表人：何沛良 联系人：何茂才 电话：0769-22321089 传真：0769-22320896 客服电话：0769-961122 网址：www.drcbank.com

35	哈尔滨银行股份有限公司	注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号 办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号 法定代表人：郭志文 联系人：王超 电话：0451-86779007 传真：0451-86779007 客服电话：95537，0451-96358 网址：www.hrbb.com.cn
36	乌鲁木齐市商业银行股份有限公司	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：农惠臣 联系人：菅焜 电话：0991-8824667 传真：0991-8824667 客服电话：0991-96518 网址：www.uccb.com.cn
37	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河西区马场道201-205号 办公地址：天津市河西区马场道201-205号 法定代表人：刘宝凤 联系人：王宏 电话：022-58316666 传真：022-58316569 客服电话：4008888811 网址：www.cbhb.com.cn
38	广州银行股份有限公司	注册地址：广州市广州大道北195号 办公地址：广州市广州大道北195号 法定代表人：姚建军 联系人：张扬眉 电话：020-37598442 传真：020-37590726 客服电话：020-96699 网址：www.gzcb.com.cn
39	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：王栋 电话：0311-88627522 传真：0311-88627027 客服电话：400-612-9999

		网址：www.hebbank.com
40	大连银行股份有限公司	注册地址：大连市中山区中山路 88 号 天安国际大厦 49 楼 办公地址：大连市中山区中山路 88 号 天安国际大厦 9 楼 法定代表人：陈占维 联系人：李鹏 电话：0411-82308602 传真：0411-82311420 客服电话：400-664-0099 网址：www.bankofd1.com
41	徽商银行股份有限公司	注册地址：安徽合肥 办公地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座 法定代表人：王晓昕 联系人：叶卓伟 电话：0551-2667635 传真：0551-2667684 客服电话：4008896588(安徽省外)、 96588(安徽省内) 网址：www.hsbank.com.cn
42	佛山顺德农村商业银行股份有限公司	注册地址：佛山市顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路 2 号 办公地址：佛山市顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路 2 号 法定代表人：吴海恒 联系人：刘伟 电话：0757-22386658 传真：0757-22388235 客服电话：0757-22223388 网址：www.sdebank.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	地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 法定代表人：吴万善 联系人：程高峰 联系电话：025-83290834 客服电话：95597 公司网站：http://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：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层 法定代表人：兰荣 联系人：谢高得 联系电话：021-38565785 客服电话：95562 公司网站：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：齐晓燕 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
4	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 法定代表人：顾伟国 客服电话：4008-888-888 公司网站：www.chinastock.com.cn
5	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：万建华 电话：021-62580818-177 客服电话：4008888666 联系人：芮敏祺 公司网站：www.gtja.com
6	齐鲁证券有限公司	注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 法定代表人：李玮 联系人：吴阳 电话：0531-68889155 传真：0531-68889752 客服电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn

7	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市淮海中路 98 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：王开国 联系人：金芸、李笑鸣 联系电话：021-23219000 客服电话：400-8888-001、95553 公司网站：www.htsec.com
8	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号 法定代表人：张佑君 联系人：魏明 联系电话：010-85130588 客服电话：4008888108 公司网站：www.csc108.com
9	广发证券股份有限公司	注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号 大都会广场 43 楼（4301-4316 房） 办公地址：广东省广州天河区天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼 法定代表人：林治海 联系人：黄岚 客服电话：95575 公司网站：www.gf.com.cn
10	长城证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区深南大道特区报业 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：黄耀华 联系人：匡婷 联系电话：0755-83516289 客服电话：0755-82288968；400-6666-888 公司网站：www.cc168.com.cn
11	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层 法定代表人：宫少林 联系人：林生迎 联系电话：0755-82943666 客服电话：95565、4008888111 公司网站：www.newone.com.cn

12	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层 办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层 法定代表人：王东明 联系人：陈忠 电话：010-84683893 传真：010-84685560 客服电话：95558 公司网站：www.citics.com
13	申银万国证券股份有限公司	注册地址：上海市常熟路171号 办公地址：上海市常熟路171号 法定代表人：丁国荣 联系人：曹晔 电话：021-54033888 传真：021-54038844 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.sywg.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：徐浩明 联系人：刘晨 联系电话：021-22169999 客服电话：10108998 公司网站：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：龙增来 联系人：刘毅 联系电话：0755-82023442 传真 0755-82026539 客服电话：400-600-8008 公司网站：www.cjis.cn
16	宏源证券股份有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号 办公地址：北京市西城区太平桥大街19号 法定代表人：冯戎 联系人：李巍 联系电话：010-88085858 客服电话：4008-000-562 公司网站：www.hysec.com

17	湘财证券有限责任公司	办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层 法定代表人：林俊波 联系人：钟康莺 联系电话：021-68634518-8503 客服电话：400-888-1551 公司网站：www.xcsc.com
18	中信证券（浙江）有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层 办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层 法人代表：沈强 邮政编码：310052 联系人：周妍 联系电话：0571-86811958 公司网站：www.bigsun.com.cn 客户服务中心电话：0571-96598
19	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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层 法定代表人：牛冠兴 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 公司网站：www.essence.com.cn
20	中信万通证券有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室） 办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层 法定代表人：张智河 联系人：吴忠超 联系电话：0532-85022326 客服电话：0532-96577 公司网站：www.zxwt.com.cn
21	中银国际证券有限责任公司	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：平岳 联系人：张静 联系电话：021-68604866 公司网站：www.bocichina.com



22	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：高冠江 联系人：唐静 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：400-800-8899 公司网址：www.cindasc.com
23	民生证券有限责任公司	注册地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室 办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心16层 法定代表人：岳献春 联系人：赵明 联系电话：010-85127622 客服电话：4006198888 公司网站：www.msyzq.com
24	东方证券股份有限公司	注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层 办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层 法定代表人：潘鑫军 联系人：吴宇 联系电话：021-63325888 客服电话：95503 公司网站：www.dfzq.com.cn
25	华融证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区月坛北街26号 办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3层 法定代表人：丁之锁 联系人：梁宇 联系电话：010-58568007 客服电话：010-58568118 公司网站：www.hrsec.com.cn
26	华西证券有限责任公司	注册地址：四川省成都市陕西街239号华西证券大厦 办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼（深圳总部） 法定代表人：杨炯洋 联系人：金达勇 联系电话：0755-83025723 客服电话：4008888818 公司网站：www.hx168.com.cn

27	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：胡运钊 客户服务热线：95579 或 4008-888-999 联系人：李良 电话：027-65799999 传真：027-85481900 长江证券客户服务网站：www.95579.com
28	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41/42层 办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层 法定代表人：卢长才 联系人：方文 联系电话：0755-83199599 客服电话：0755-83199509 公司网站：www.csco.com.cn
29	东北证券股份有限公司	注册地址：长春市自由大路1138号 办公地址：长春市自由大路1138号 法定代表人：矫正中 联系人：潘锴 联系电话：0431-85096709 客服电话：4006000686，0431-85096733 公司网站：www.nesc.cn
30	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市西藏中路336号 法定代表人：郁忠民 联系电话：021-51539888 联系人：张瑾 公司网站：www.shzq.com 客服电话：4008918918，021-962518
31	江海证券有限公司	注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号 办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号 法定代表人：孙名扬 联系人：高悦铭 电话：0451-85863696 传真：0451-82287211 客服电话：400-666-2288 网址：www.jhzq.com.cn

32	国联证券股份有限公司	注册地址:江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层 法定代表人:雷建辉 联系人:沈刚 联系电话:0510-82831662 客服电话:95570 公司网站:www.glsc.com.cn
33	东莞证券有限责任公司	注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 联系人:苏卓仁 联系电话:0769-22112062 公司网站:www.dgzq.com.cn
34	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 办公地址:天津市南开区宾水西道 8 号 法定代表人:杜庆平 联系人:王兆权 电话:022-28451861 传真:022-28451892 客服电话:400-651-5988 网址:www.bhzq.com
35	平安证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 法定代表人:杨宇翔 联系人:周璐 联系电话:0755-22626172 客服电话:4008816168 公司网站: http://www.pingan.com
36	国都证券有限责任公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 办公地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 法定代表人:常喆 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

37	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 17-21 层 办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 17-21 层 法定代表人：吴永敏 联系人：方晓丹 电话：0512-65581136 传真：0512-65588021 客服电话：0512-33396288 网址： <a href="http://www.dwjq.com.cn/">http://www.dwjq.com.cn/</a>
38	广州证券有限责任公司	注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼 办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼 法定代表人：刘东 联系人：林洁茹 联系电话：020-88836999 客服电话：020-961303 公司网站： <a href="http://www.gzs.com.cn">www.gzs.com.cn</a>
39	华林证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼 办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼 法定代表人：宋志江 联系人：杨玲 联系电话：0755-82707888 客服电话：400-880-2888 公司网站： <a href="http://www.chinalions.com">www.chinalions.com</a>
40	南京证券有限责任公司	注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号 法定代表人：张华东 联系人：胥春阳 联系电话：025-83364032 公司网站： <a href="http://www.njqz.com.cn">www.njqz.com.cn</a>
41	华安证券有限责任公司	注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号 办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层 法定代表人：李工 联系人：甘霖 联系电话：0551-5161821 客服电话：96518，4008096518 公司网站： <a href="http://www.hazq.com">www.hazq.com</a>

42	红塔证券股份有限公司	注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼 办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼 法定代表人：况雨林 联系人：刘晓明 联系电话：0871-3577888 公司网站： <a href="http://www.hongtastock.com">http://www.hongtastock.com</a>
43	银泰证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行大厦 18 楼 办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行大厦 18 楼 法定代表人：黄冰 联系电话：0755-83706665 客服电话：4001022011 公司网站： <a href="http://www.ytzq.net">www.ytzq.net</a>
44	华宝证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼 办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼 法定代表人：陈林 联系人：宋歌 联系电话：021-68777222 客服电话：021-38929908 公司网站： <a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>
45	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 公司网站： <a href="http://www.i618.com.cn">www.i618.com.cn</a>
46	第一创业证券有限责任公司	注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层 办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层 法定代表人：刘学民 联系人：王立洲 联系电话：0755-25832494 公司网站： <a href="http://www.fcsc.cn">www.fcsc.cn</a>

47	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：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层 法定代表人：黄金琳 联系人：张腾 电话：0591-87383623 传真：0591-87383610 客服电话：96326（福建省外请先拨 0591） 网址：公司网址：www.hfzq.com.cn
48	中山证券有限责任公司	注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 栋 15 层 办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 29 层 法定代表人：吴永良 联系人：李珍 联系电话：0755-82570586 客服电话：4001022011 公司网站：http://www.zszq.com
49	国海证券有限责任公司	注册地址：广西省南宁市滨湖路 46 号 办公地址：广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3F 法定代表人：张雅锋 联系人：牛孟宇 电话：0755-83709350 传真：0755-83700205 客服电话：95563 网址：http://www.ghzq.com.cn
50	中原证券股份有限公司	注册地址：郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 法定代表人：石保上 联系人：程月艳、耿铭 联系电话：0371—65585670 客服电话：967218、400-813-9666 公司网站：www.ccnew.com
51	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 办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦 法定代表人：王珠林 联系人：陈诚 电话：023-63786464 传真：023-63786311

		客服电话：4008-096-096 网址：www.swsc.com.cn
52	财达证券有限责任公司	注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层 办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层 法定代表人：翟建强 联系人：陈丽君 联系电话：0311-66006219 客服电话：4006128888 公司网站：www.S10000.com
53	德邦证券有限责任公司	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：叶蕾 电话：021-68761616 传真：021-68767032 客服电话：4008888128 网址：www.tebon.com.cn
54	中航证券有限公司	注册地址：南昌市抚河北路 291 号 办公地址：南昌市抚河北路 291 号 法定代表人：杜航 联系人：戴蕾 电话：0791-6768681 传真：0791-6770178 客服电话：400-8866-567 网址：http://www.avicsec.com/
55	国元证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号 办公地址：合肥市花园街花园宾馆 14 楼 法定代表人：凤良志 联系电话：0551-2634400 客服电话：全国统一热线 95578，4008888777，安徽省内热线 96888 公司网站：www.gyzq.com.cn
56	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号 办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼 法定代表人：曾小普 联系人：徐美云 联系电话：0791-86285337 公司网站：www.gsstock.com

57	中国国际金融有限公司	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：北京市建国门外甲6号SK大厦 法定代表人：李剑阁 联系人：王雪筠 联系电话：010-85679265 客服电话：(010)85679238 (010)85679169 公司网站：www.ciccs.com.cn
58	大同证券经纪有限责任公司	注册地址：山西省大同市大北街13号 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
59	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层 办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22—24层 法定代表人：雷杰 联系人：彭博 联系电话：0731-85832343 客服电话：95571 公司网站：www.foundersec.com
60	财通证券有限责任公司	注册地址：杭大路15号嘉华国际商务中心 办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室 法定代表人：沈继宁 联系人：乔骏 联系电话：0571-87925129 客服电话：0571-96336（上海地区：962336） 公司网站：www.ctsec.com



61	东海证券有限责任公司	注册地址：江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼 办公地址：江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼 法定代表人：朱科敏 联系人：霍晓飞 客服电话：400-888-8588（全国），0519-88166222（常州），021-52574550（上海），0379-64902266（洛阳） 公司网站：www.longone.com.cn
62	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 1 层 法定代表人：刘建武 联系人：冯萍 电话：029-87406488 传真：029-87424426 客服电话：95582 网址：http://www.westsecu.com/
63	新时代证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 15 层 办公地址：北京市西城区金融街 1 号 A 座 8 层 法定代表人：马金声 联系人：孙恺 联系电话：010-83561149 公司网站：www.xsdzq.cn
64	瑞银证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层 办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层 法定代表人：刘弘 联系人：牟冲 联系电话：010-5832-8366，010-5832-8722 客服电话：400-887-8827 公司网站：www.ubssecurities.com
65	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：陆涛 联系人：金春 联系电话：0755-83025695

		客服电话：4008-888-228 公司网站：www.jyzq.com.cn
66	万联证券有限责任公司	注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层 办公地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层 法定代表人：张建军 联系人：罗创斌 联系电话：020-37865070 客服电话：400-8888-133 公司网站：www.wlzq.com.cn
67	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：金喆 电话：028-86690126 传真：028-86690126 客服电话：4006600109 网址：www.gjzq.com.cn
68	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：周晖 联系人：郭磊 客服电话：0731-4403360 公司网站：www.cfzq.com
69	恒泰证券股份有限公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号 办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号 法定代表人：庞介民 联系人：常向东 联系电话：0471-4979037 网址：www.cnht.com.cn
70	华龙证券有限责任公司	注册地址：兰州市城关区静宁路308号 办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼 法定代表人：李晓安 联系人：李杨 电话：0931-8784502 传真：0931-4890628 客服电话：4006-89-8888

		网址：www.hlzqgs.com
71	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：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元 法定代表人：王文学 联系人：黄旭成 电话：0755-82083788 传真：0755-82083408 客服电话：021-32109999, 029-68918888 网址：www.cfsc.com.cn
72	日信证券有限责任公司	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：孔佑杰 联系人：苏江 联系电话：010-88086830 公司网站：www.rxzq.com.cn
73	中天证券有限责任公司	注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲 办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲 法定代表人：李学琦 联系人：范守卫 联系电话：024-23268079 客服电话：4006180315 公司网站：www.stockren.com
74	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：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层 法定代表人：林义相 联系人：姜吉灵 客服电话：010-66045678 传真：010-66045500 公司网址：http://www.txsec.com 公司基金网网址： <a href="https://jijin.txsec.com">https://jijin.txsec.com</a>

75	五矿证券有限公司	全称：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：高竹 联系人：赖君伟 电话：0755-23902400 传真：0755-82545500 客服电话：40018-40028 网址：www.wkzq.com.cn
76	其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。	

## （二）注册登记机构

南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

电话：(0755) 82763849

传真：(0755) 82763868

联系人：古和鹏

## （三）律师事务所和经办律师

名称：广东华瀚律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路 1002 号宝安广场 A 座 16 楼 G.H 室

负责人：李兆良

电话：(0755)82687860

传真：(0755)82687861

经办律师：杨忠、戴瑞冬

## （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

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

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陈熹

经办会计师：薛竞、陈熹

#### 四、基金名称

南方策略优化股票型证券投资基金

#### 五、基金的类型

契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的各类股票、债券、短期金融工具、现金、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%~95%，债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资占基金资产的比例范围为 5%~40%。固定收益类工具主要包括国债、金融债、公司债（企业债）、央行票据、短期融资券、可转换债券、回购、资产证券化产品、货币市场工具等，其中现金以及到期日在 1 年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

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

#### 八、投资策略

本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 Black-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业内具

有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。

#### （一）资产配置策略

本基金在对全球宏观经济情况及证券市场走势把握的基础上，运用国际化的视野审视中国经济和证券市场，并对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，确定本基金的资产配置比例。同时，基金管理人还将严格控制组合风险，调整组合配置，追求风险调整后的最大收益。

#### （二）行业配置策略

本基金的行业配置策略采用基金管理人开发的基于 Black-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。该模型在充分考虑市场均衡的行业配置比例的基础上，加入基金管理人对于各个行业风险收益的预期，从而测算出满足条件的最优化行业配置比例。

“南方量化行业配置模型”根据市场均衡计算出基础行业配置，按 Markowitz 收益-方差最优化过程得到市场均衡收益的估计值。基金管理人根据宏观经济与行业景气的相关性分析和行业周期性变化特征确定行业评级、行业预期收益等指标，并将上述行业分析的结果构建数量化模型，建立行业预期收益和风险的矩阵，之后将该矩阵作为参数导入“南方量化行业配置模型”，加入特定约束条件后通过数量方法求解，得到经过优化的行业配置比例。

#### （三）个股投资策略

基于对国内外股票市场大量的实证研究，基金管理人开发了“南方多因子量化选股模型”，模型将影响个股超额收益的因素归纳为以下四个主要方面：

##### （1）基本面因子

基本面因子主要包括上市公司的盈利能力、现金流情况、财务杠杆水平以及未来成长性，如主营业务收入、毛利率、每股收益、总资产回报率、企业现金流、资产负债率等指标，上述因子反映了上市公司的当前价值和成长潜力。通过对上市公司大量财务数据的筛选和加工，基金管理人构建了比较完整的股票数据库，其中也包括市场对于上述主要指标的一致预期数据。采用相应的一致预期数据，“南方多因子量化选股模型”可以测算出整体市场对于各个上市公司盈利水平和成长潜力的预期。

##### （2）价值因子

价值因子主要是指股票的绝对和相对估值水平。价值因子既包含上市公司基本面的信息，也包含股票价格的信息。对于不同行业的股票，该模型根据上市公司经营的特点和历史实证检验结果，采用不同的估值指标，如市盈率、市净率、市现率、市销率、EV/EBITDA 等，挑选具有绝对或相对估值吸引力的股票。

### （3）市场面因子

市场面因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票所处风格板块的轮动，股票价格的历史波动等。在构建模型的过程中，通过历史数据实证检验的方法确定各个行业最适用的市场面因子，同时动态跟踪相关市场数据，对模型进行不断地检验和修正。

### （4）流动性因子

流动性因子也是“南方多因子量化选股模型”的重要组成部分，该因子直接影响投资组合的构建。“南方多因子量化选股模型”采用移动时间窗的方法计算平均成交量、平均流通市值、Amivest 流动比率等各种指标，对个股流动性进行衡量。

此外，基金管理人还将对上市公司治理结构、对股价有影响的潜在事件等作进一步定性分析，对模型筛选出的结果进行复核和优化，追求同等条件下的较高收益。

综上，基金管理人将利用“南方多因子量化选股模型”对股票进行综合评分，并根据评分结果配置各行业具有超额收益能力或潜力的优势个股，从而构建本基金的股票组合。

## （四）其他资产投资策略

### 1. 债券投资策略

依据资产配置结果，本基金将在部分阶段以改善组合风险构成为出发点配置债券资产。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和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响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。

### 2. 权证投资策略

在进行权证投资时，基金管理人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。

## 九、投资决策依据和决策程序

### 1. 决策依据

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

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础。

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

(4) 团队投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过投资研究人员的共同努力与分工协作，确定资产配置，由基金经理参考量化分析结果具体执行投资计划。

(5) 策略优化投资方式。本基金采用严格的量化股票投资策略，力争克服人为情绪干扰，取得超过业绩基准的稳定收益。

## 2. 决策程序

(1) 决定主要投资原则：投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，决定基金的主要投资原则，确立基金的投资方针及投资方向，审定基金的资产及行业配置方案。

(2) 团队投资与投资决策制定：在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，通过投资、研究人员的团队投资、分工协作，由基金经理具体执行投资计划：1) 依据投资研究团队对宏观经济、股市政策、市场趋势的判断，结合基金合同、投资制度的要求提出本基金的资产配置建议；2) 在投资决策委员会授权及批准的范围内，通过量化分析决定基金的行业配置方案；3) 依据投资研究团队对各行业的具体分析与股票候选名单，按照南方基金量化选股模型，结合基金合同、投资制度的要求，在投资决策委员会授权及批准的范围内，制定基金的个股投资方案。

(3) 进行风险评估：风险控制委员会定期召开会议，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险控制意见。

(4) 评估和调整决策程序：基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

基金管理人将致力于对上述量化选股模型、组合构建方式和投资操作流程不断地进行改造、提高和完善，并在更新的《招募说明书》中列示。

## 十、业绩比较基准

业绩基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{上证国债指数}$

本基金为股票型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准。沪深 300 指数成份股选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。沪深 300 指数中的成份股



的发布和调整均由交易所完成,具有较强的公正性与权威性。债券组合的业绩基准则采用了上证国债指数,上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数,反映我国债券市场整体变动状况,具有较强的市场代表性。

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

## 十一、 风险收益特征

本基金为股票型基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

## 十二、 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20日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,投资者在作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2012年3月31日(未经审计)。

### (一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	550,831,376.05	77.45
	其中:股票	550,831,376.05	77.45
2	固定收益投资	29,953,633.50	4.21
	其中:债券	29,953,633.50	4.21
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-

5	银行存款和结算备付金合计	120,208,386.23	16.90
6	其他资产	10,212,313.23	1.44
7	合计	711,205,709.01	100.00

## （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,844,138.91	0.97
B	采掘业	84,302,963.46	11.96
C	制造业	245,918,296.27	34.90
C0	食品、饮料	96,918,858.29	13.75
C1	纺织、服装、皮毛	15,087,151.15	2.14
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	906,269.00	0.13
C5	电子	15,056,240.92	2.14
C6	金属、非金属	28,856,463.54	4.09
C7	机械、设备、仪表	55,360,132.41	7.86
C8	医药、生物制品	33,733,180.96	4.79
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,211,301.03	2.73
E	建筑业	997,339.40	0.14
F	交通运输、仓储业	10,219,052.62	1.45
G	信息技术业	15,502,561.86	2.20
H	批发和零售贸易	37,786,062.59	5.36
I	金融、保险业	88,463,246.93	12.55
J	房地产业	26,701,352.27	3.79
K	社会服务业	7,382,633.04	1.05
L	传播与文化产业	2,824,416.46	0.40
M	综合类	4,678,011.21	0.66
	合计	550,831,376.05	78.17

## （三）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	601166	兴业银行	1,870,997	24,921,680.04	3.54
2	000001	深发展 A	1,554,290	24,417,895.90	3.47
3	000869	张裕 A	250,821	23,632,354.62	3.35

4	600000	浦发银行	2,503,391	22,355,281.63	3.17
5	600887	伊利股份	750,000	16,530,000.00	2.35
6	601169	北京银行	1,539,948	15,122,289.36	2.15
7	600031	三一重工	1,122,500	13,773,075.00	1.95
8	000568	泸州老窖	340,000	13,290,600.00	1.89
9	601088	中国神华	502,286	12,863,544.46	1.83
10	600739	辽宁成大	801,725	12,803,548.25	1.82

#### （四）报告期末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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	29,953,633.50	4.25
8	其他	-	-
9	合计	29,953,633.50	4.25

#### （五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	113001	中行转债	300,000	28,416,000.00	4.03
2	110013	国投转债	12,960	1,275,134.40	0.18
3	110011	歌华转债	2,630	242,538.60	0.03
4	110012	海运转债	210	19,960.50	0.00

#### （六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前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。

#### （七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### （八）投资组合报告附注

1、本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	9,471,553.24
3	应收股利	-
4	应收利息	171,639.19
5	应收申购款	69,120.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,212,313.23

### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	28,416,000.00	4.03
2	110013	国投转债	1,275,134.40	0.18
3	110011	歌华转债	242,538.60	0.03
4	110012	海运转债	19,960.50	0.00

### 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。

## 十三、基金的业绩

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)
2010.3.30-2010.12.31	-2.80%	1.42%	-5.01%	1.32%	2.21%	0.10%
2011.1.1至2011.12.31	-30.43%	1.29%	-19.67%	1.04%	-10.76%	0.25%
2012.1.1至2012.3.31	1.66%	1.48%	3.98%	1.21%	-2.32%	0.27%
自基金成立起至今	-31.26%	1.36%	-20.66%	1.17%	-10.60%	0.19%

## 十四、基金费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

### 1、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) 基金财产划拨支付的银行费用；
- 4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5) 基金份额持有人大会费用；
- 6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7) 基金的证券交易费用；
- 8) 按照国家有关规定和基金合同可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 2、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

#### 2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3) 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

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费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

## （二）与基金销售有关的费用

1、本基金提供两种申购费用的支付模式。本基金在申购时收取的申购费用称为前端申购费用，在赎回时收取的申购费用称为后端申购费用。基金投资者可以选择支付前端申购费用或后端申购费用。

本基金前端申购费率最高不高于 1.5%，且随申购金额的增加而递减，后端申购费率最高不高于 1.8%，且随持有时间的增加而递减，如下表所示：

前端收费：

购买金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.5%
100 万 ≤ M < 500 万	0.9%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.3%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

后端收费（其中 1 年为 365 天）：

持有期限 (N)	申购费率
N < 1 年	1.8%
1 年 ≤ N < 2 年	1.5%
2 年 ≤ N < 3 年	1.2%
3 年 ≤ N < 4 年	0.8%
4 年 ≤ N < 5 年	0.4%
N ≥ 5 年	0

本基金的申购费用由基金申购人承担，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	0.3%
N ≥ 2 年	0

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

### 3、转换费

基金管理人已于 2010 年 6 月 28 日起开通本基金与公司旗下部分开放式基金间的转换，具体内容详见 2010 年 6 月 24 日发布的《关于南方策略优化股票型证券投资基金开通基金定投和转换业务的公告》和其他有关本基金转换公告。

### (三)其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它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“基金管理人部分，对“主要人员情况”进行了更新。
- 2、在“基金托管人”部分，更新了“发展概括”和“基金托管业务经营情况”。
- 3、在“相关服务机构”部分，对代销机构进行了更新。
- 4、在“基金的投资”部分，补充了本基金最近一期投资组合报告和基金的业绩。
- 5、在“基金份额持有人服务”部分，对基金份额持有人的服务的相关内容进行了更新。
- 6、对“其它应披露事项”进行了更新。
- 7、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

二〇一二年五月五日