

## 南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书(更新)摘要

基金管理人:南方基金管理股份有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

截止日:2020年06月12日

### 重要提示

本基金经中国证监会2019年5月23日证监许可[2019]924号文注册募集。本基金的基金合同已于2019年6月12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。

本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%。本基金投资于日本证券市场,基金资产净值会因为日本证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前,投资人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,并承担基金投资中出现的风险,基金在投资运作过程中可能面临各种风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括:(1)本基金特有的风险,主要包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、IOPV计算错误的风险、投资于目标ETF基金带来的风险、第三方机构服务的风险、管理风险等;(2)投资风险,主要包括市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、衍生品风险、金融模型风险、信用风险等;(3)运作风险,主要包括操作风险、会计核算风险、法律及税务风险、交易结算风险、证券借贷/正回购/逆回购风险等;(4)合规与道德风险;(5)不可抗力风险等等。本基金属于股票型基金,一般而言,其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标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境外证券市场相似的风险收益特征。本基金主要投资日本证券市场上市的ETF,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金

的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化及基金份额上市交易价格波动引致的投资风险,由投资人自行负责。

在目前结算规则下,投资者当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回,即T日申购的基金份额,T日交收成功后,T+1日可卖出和赎回。当日买入的基金份额,当日可以赎回。

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2020年6月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2020年3月31日(未经审计)。

## § 1 基金名称

南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

## § 2 基金的类型

QDII、股票型证券投资基金

## § 3 基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪误差最小化。

## § 4 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已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信

托凭证；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）；境外政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

在建仓完成后，本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%。

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。

## § 5 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。

### 1、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、货币市场工具、金融衍生品，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。

### 2、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：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：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

本基金短期内优先通过二级市场交易投资目标ETF，待未来技术系统等各方面条件支持后也可通过申购赎回投资目标ETF。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。

### 3、标的指数成份股、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。

#### 4、固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

#### 5、衍生品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲目标 ETF 或某些成份券的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品规避外汇风险及其他相关风险。

今后，随着全球证券市场的发展、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。

## § 6 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为经估值汇率调整的标的指数收益率，本基金标的指数为东证指数（Tokyo Stock Price Index, “TOPIX”）。

东证指数（Tokyo Stock Price Index, “TOPIX”）是东京证券交易所编制的，由在东京证券交易所第一市场上市的所有股票按自由流通市值加权平均计算出的股价指数。该指数样本覆盖范围广，能够准确反映日本股票市场的总体走势。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），基金管理人应与基金托管人协商一致，履行适当程序后，报中国证监会备案并及时公告。

## § 7 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金主要通过投资于目标 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境外证券市场相似的风险收益特征。

本基金主要投资日本证券市场上市的 ETF，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## § 8 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 2020 年 3 月 31 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            | -             | -            |
|    | 其中：普通股          | -             | -            |
|    | 存托凭证            | -             | -            |
| 2  | 基金投资            | 47,460,731.57 | 99.17        |
| 3  | 固定收益投资          | -             | -            |
|    | 其中：债券           | -             | -            |
|    | 资产支持证券          | -             | -            |
| 4  | 金融衍生品投资         | -             | -            |
|    | 其中：远期           | -             | -            |
|    | 期货              | -             | -            |
|    | 期权              | -             | -            |
|    | 权证              | -             | -            |
| 5  | 买入返售金融资产        | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融 | -             | -            |

|   |              |               |        |
|---|--------------|---------------|--------|
|   | 资产           |               |        |
| 6 | 货币市场工具       | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 13,433.41     | 0.03   |
| 8 | 其他资产         | 383,385.09    | 0.80   |
| 9 | 合计           | 47,857,550.07 | 100.00 |

## 2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票或存托凭证。

## 3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票或存托凭证。

## 4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票或存托凭证。

## 5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 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

金额单位：人民币元

| 序 | 基金名称 | 基金 | 运作方 | 管理人 | 公允价值(人 | 占基金资 |
|---|------|----|-----|-----|--------|------|
|---|------|----|-----|-----|--------|------|

| 号 |                  | 类型  | 式          |                                | 人民币元)         | 产净值比例 (%) |
|---|------------------|-----|------------|--------------------------------|---------------|-----------|
| 1 | One ETF<br>TOPIX | ETF | 交易型<br>开放式 | Asset Management One<br>Co Ltd | 47,460,731.57 | 100.16    |

## 10 投资组合报告附注

### 10.1

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。

### 10.2

本基金本报告期末未持有股票。

### 10.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | 383,378.26 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 6.83       |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 383,385.09 |

### 10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 9 基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

| 阶段                           | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2019.6.12<br>-<br>2019.12.31 | 12.19%  | 0.59%     | 11.65%     | 0.62%         | 0.54% | -0.03% |
| 2020.1.1-<br>2020.3.31       | -15.26% | 2.40%     | -16.64%    | 2.00%         | 1.38% | 0.40%  |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今           | -4.93%  | 1.39%     | -6.92%     | 1.21%         | 1.99% | 0.18%  |

## § 10 基金管理人

### 10.1 基金管理人概况

名称：南方基金管理股份有限公司

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

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：张海波

注册资本：3.6172 亿元人民币

电话：(0755) 82763888

传真：(0755) 82763889

联系人：常克川

1998 年,南方基金管理有限公司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,注册资本增至1.5亿元人民币。2014年公司进行增资扩股,注册资本金增至3亿元人民币。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司,注册资本金3亿元人民币。

2019年7月30日,公司注册资本增至3.6172亿元,股权结构调整为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%。

## 10.2 主要人员情况

### 10.2.1 董事会成员

张海波先生,工商管理硕士,中国籍,无境外永久居留权。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,华泰证券总裁助理、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。现任南方基金管理股份有限公司党委书记、董事长。

张辉先生,管理学博士,中国籍。曾任职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干部,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、人力资源部总经理兼党委组织部长。现任华泰证券股份有限公司执行委员会委员、董事会秘书,南方基金管理股份有限公司董事。

王连芬女士,金融专业硕士,中国籍。曾任职赛格集团销售,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,华泰证券总裁助理兼深圳分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司执行委员会主任助理兼深圳分公司总经理,南方基金管理股份有限公司董事。

冯青山先生,工学学士,中国籍。曾任职陆军第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、办公厅副主任、

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，深圳市投控资本有限公司监事，南方基金管理股份有限公司董事。

李平先生，工商管理硕士，中国籍。曾任职深圳市城市建设开发(集团)公司办公室文秘，董办文秘、主管；深圳市投资控股有限公司办公室高级主管，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，南方基金管理股份有限公司董事。

李自成先生，近现代史专业硕士，中国籍。曾任职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、总经理。现任南方基金管理股份有限公司董事。

王斌先生，临床医学博士，中国籍。曾任职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(主持工作)、总经理。现任兴业证券经济与金融研究院院长，南方基金管理股份有限公司董事。

杨小松先生，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职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。现任南方基金管理股份有限公司董事、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，经济学硕士，中国籍。曾任职国家经委副处长，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，国务院参事室社会调查中心理事长，国务院参事室与中国人民银行合作的金融研究中心专家委员会副主任，中国统计学会副会长，南方基金管理股份有限公司独立董事。

李心丹先生，金融学博士，国务院特殊津贴专家，中国籍。曾任职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，南京大学教授、博士生导师，中国金融学年会常务理事，江苏省资本市场研究会会长，江苏省科技创新协会副会长、江苏银行监事、上海证券交易所科创板制度评估专家委员会主任，南方基金管理股份有限公司独立董事。

周锦涛先生，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。曾任职香港警务处(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，南方基金管理股份有限公司独立董事。

郑建彪先生，经济学硕士，工商管理硕士，中国注册会计师，中国籍。曾任职北京市财政局干部，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，中国证监会第九届股票发行审核委员会委员，中国证监会第一至三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。现任致同会计师事务所（特殊普通合伙）管理合伙人，中国并购公会副会长，北京注册会计师协会副会长，南方基金管理股份有限公司独立董事。

周蕊女士，法学硕士，中国籍。先后执业于万商天勤律师事务所、中伦律师事务所律师等国内知名律所，曾担任广东省律师协会女工委副主任、深圳市律师协会证券、基金与期货专业委员会副主任、深圳市律师协会国际与港澳台工作委员会副主任。现任金杜律师事务所合伙人、中国并购公会广东分会会长、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深交所培训中心专家、深圳市女企业家协会理事，南方基金管理股份有限公司独立董事。

### 10.2.2 监事会成员

吴晓东先生，法律博士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职中国证监会副处长、处长，华泰证券合规总监，华泰联合证券副总裁、党委书记、董事长，南方股权投资基金管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司监事。

陈莉女士，法学硕士，中国籍。曾任职华泰证券深圳民田路营业部总经理、深圳益田路营业部总经理、研究所副所长等职务。现任华泰证券股份有限公司研究所所长、华泰期货有限公司监事会主席、华泰国际金融控股有限公司董事，南方基金管理股份有限公司监事。

姜丽花女士，大学学历，高级会计师，中国籍。曾任职浙江兰溪马涧碾米厂主管会计，浙江兰溪纺织机械厂主管会计，深圳市建筑机械动力公司主管会计，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、考核分配部部长。现任深圳市投资控股有限公司财务部(结算中心)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、湖北深投控投资发展有限公司董事、ULTRARICH INTERNATIONAL LIMITED 董事，南方基金管理股份有限公司监事。

陈明雅女士，大学本科学历，注册会计师，中国籍。曾任厦门国际信托有限公司财务部副总经理。现任厦门国际信托有限公司财务部总经理、投资发展部总经理（兼任）。

林红珍女士，工商管理硕士，中国籍。曾任职厦门对外供应总公司会计，厦门中友贸易联合公司财务部副经理，厦门外供房地产开发公司财务部经理，兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副总经理（主持工作）、风险管

理部总经理、财务部总经理、资金运营管理部总经理、计划财务部总经理。现任兴业证券首席财务官，南方基金管理股份有限公司监事。

徐刚先生，工商管理硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职深圳期货投资公司职员、项目经理，南方基金管理股份有限公司上海分公司职员、机构业务部职员、养老金业务部主管、上海分公司高级经理、副总经理、董事。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、养老金业务部董事。

董星华女士，硕士学历，中国籍，无境外永久居留权。曾任职中国人保武汉分公司、中国人寿再保险公司、中国再保险公司、深圳证券通信公司，南方基金管理股份有限公司综合管理部经理、办公室高级经理，现任南方基金管理股份有限公司职工监事、办公室高级副总裁。

苏望先生，法学硕士学位，中国籍，无境外永久居留权。曾任国信证券股份有限公司合规管理总部职员，深圳市融通资本管理股份有限公司职员。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、监察稽核部高级副总裁。

### 10.2.3 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，工商管理硕士，经济师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职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，南方资本管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

朱运东先生，副总裁，经济学学士，高级经济师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职财政部地方预算司及办公厅秘书，中国经济开发信托投资公司综合管理部总经理，南方基金管理有限公司北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

常克川先生，副总裁，EMBA 工商管理硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职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，南方资本管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士，特许金融分析师(CFA)，中国籍，无境外永久居留权。曾任职美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师，南方基金管理有限公司高级研究员、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、总裁助理兼固定收益投资总监，南方东英资产管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、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，无境外永久居留权。曾任职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，南方基金管理有限公司基金经理、研究部总监、总裁助理兼首席投资官（权益）。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（权益）、基金经理。

鲍文革先生，督察长，经济学硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职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，南方基金管理有限公司运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理。现任南方基金管理股份有限公司督察长，南方资本管理有限公司董事。

#### 10.2.4 基金经理

本基金历任基金经理为：崔蕾女士，管理时间为2019年6月12日至今。

崔蕾女士，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理师（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015年2月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2018年11月8日至今，任南方中证500增强基金经理；2019年6月12日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019年6月28日至今，任大数据300基金经理；2019年7月12日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF、南方小康ETF、南方小康ETF联接基金经理；2019年11月29日至今，任南方粤港澳大湾区ETF基金经理；2020年1月17日至今，任红利50基金经理；2020年1月21日至今，任南方大盘红利50基金经理；2020年3月26日至今，任南方粤港澳大湾区联接基金经理。

#### 10.2.5 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，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，权益专户投资部总经理刘树坤先生。

#### 10.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

## § 11 基金的费用概览

## 11.1 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，含境外投资顾问的投资顾问费（如有）；
- 2、基金托管人的托管费，含境外托管人收取的费用（如有）；
- 3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- 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、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、基金相关账户的开户及维护费用；
- 11、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 12、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”）；
- 13、更换基金管理人、更换基金托管人、更换境外托管人及基金资产由原基金托管人、境外托管人转移新基金托管人、境外托管人所引起的费用，但因基金管理人或基金托管人、境外托管人自身原因导致被更换的情形除外；
- 14、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 0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配；如果委托境外投资顾问，基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用，具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进行约定。

## 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 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外托管人，其中可以部分作境外托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外托管人在有关协议中进行约定。

## 3、基金合同生效后的指数许可使用费

在通常情况下，指数许可使用费按计费期间平均每日资产净值所适用的年费率支付。对于平均每日资产净值中不超过 500 亿日元或等值人民币（包括 500 亿日元或等值人民币）的部分，不支付指数使用费；对于平均每日资产净值中超过 500 亿日元或等值人民币的部分，按该部分的 0.01%的年费率支付指数使用费。指数使用费自基金首次挂牌之日起累计，按每个计费期间支付，计算方法如下：

(1)  $E \leq 500$  亿日元或等值人民币时：

$$H=E \times 0\%$$

(2)  $E > 500$  亿日元或等值人民币时：

$$H=500 \text{ 亿日元或等值人民币} \times 0\% + (E - 500 \text{ 亿日元或等值人民币}) \times 0.01\%$$

H 为计费期间应付的指数许可使用费

E 为计费期间平均每日资产净值， $E = \text{计费期间每日基金资产净值的合计数} \div \text{计费期间天数}$

指数许可使用费以一年为一个计费期间，第一个计费期间的起始之日为基金首次挂牌日，结束之日为基金首次挂牌日的年度对日的前一日。第二个计费期间的起始之日为第一个计费期间结束之日的次日，结束之日为第二个计费期间起始之日的年度对日的前一日，以此类推。

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使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

指数许可使用费的费率、计算方法及支付方式由基金管理人书面告知基金托管人，如费率、计算方法、支付方式等发生变更，基金管理人应及时书面通知基金托管人。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—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。

### 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，其纳税义务按投资市场所在国家或地区的税收法律、法规执行。除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致基金在税收方面的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 11.2 与基金销售有关的费用

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的现金替代、现金差额及其他对价。申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申购代理券商可按照不超过 0.2% 的标准收取佣金，赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

4、本基金申购、赎回的币种为人民币。在未来市场和技术成熟时，本基金可开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回，该事项无须基金份额持有人大会通过。如本基金

开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回,更新的申赎原则、程序、费用等业务规则及相关事项届时由基金管理人确定并提前公告。

## § 12 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: 陈四清  
注册资本: 人民币 35,640,625.7089 万元  
联系电话: 010-66105799  
联系人: 郭明

### (二) 主要人员情况

截至 2020 年 3 月,中国工商银行资产托管部共有员工 210 人,平均年龄 33 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 2020 年 3 月,中国工商银行共托管证券投资基金 1053 只。自 2003 年以来,本行连续十六年获得香港《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 71 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。从2005年至今共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分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。

(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》、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。

## § 13 境外托管人

(一) 基本情况

北美信托集团是一家在美国纳斯达克交易所上市的金融控股公司,北美信托银行是北美信托集团的主要子公司。北美信托在全球范围为公司、机构及个人客户提供全球托管和资产管理服务,北美信托的主要业务均通过北美信托银行开展。

北美信托由拜伦史密斯先生于 1889 年创立,拥有 125 年的历史。北美信托自创立起就开始提供信托和托管服务。当美国职工退休收入安全法案在 1974 年推出后,北美信托将托管业务确立为主营业务。从 1981 年开始,北美信托开始提供全球托管业务,并于 1985 年在伦敦建立了全球托管运营中心以支持全球业务的发展。

北美信托是全球具有领先地位的,为企业、机构和富有个人提供投资服务、资产和基金管理,以及信托和银行服务方案的金融机构。随着不断增长,北美信托已在全球 21 国家和地区拥有服务机构。

截至 2019 年 12 月 31 日, 北美信托托管资产达到 12.05 万亿, 管理资产达到 1.2 万亿。托管资产和管理资产水平逐年提高, 标普长期信用评级为 AA-。我行具有雄厚的财务实力, 资本充足率达 16.3%, 核心资本充足率达 12.7%。

## (二) 托管业务介绍

通过公司与机构服务部和财富管理部, 北美信托重点服务两类客户: 公司与机构服务部负责为公司和机构客户提供全球托管和资产管理服务; 财富管理部负责为个人客户提供个人信托、托管和理财服务。这些业务均由运营与信息技术部和北美信托环球投资管理部提供支持。运营与信息技术部提供让北美信托保持全球领先地位所必备的持续可靠的全球基础设施。北美信托环球投资管理部提供各种资产类型的投资管理。

北美信托在美国的 19 个州及华盛顿特区设有分支机构, 并在北美、欧洲和亚太地区的 25 个国家和地区设有分支机构。北美信托银行的客户遍及全球 53 个国家, 并在全球 102 个市场拥有一个完整的托管网络。北美信托在阿布扎比、阿姆斯特丹、班加罗尔、北京、芝加哥、都柏林、格恩西岛、香港、泽西岛、利默里克、伦敦、卢森堡、纽约、坦佩、悉尼、墨尔本、新加坡、东京、韩国、马来西亚、菲律宾、斯德哥尔摩和多伦多等地都设有服务和产品中心, 为世界各地的客户提供资产服务和资产管理。

北美信托于 2005 年在北京设立代表处, 并于 2010 年将代表处升格为分行。北京分行目前主要为境内机构投资者赴海外投资提供全球托管服务, 包括会计核算、绩效评估、投资指引合规监察和证券借贷等。

## (三) 境外托管人的职责

- 资产保管
- 账户开立和证券登记
- 清算和估值
- 收入托收
- 收入税预扣及退税
- 公司行动
- 现金管理
- 货币兑换

## (四) 托管部门人员配备、安全保管资质条件说明

北美信托拥有本土化的客户服务团队, 除了在托管运营上依托我行全球一体化的服务模式外, 我行北京客服团队直接向北京分行行长汇报, 不再设有区域客服管理团队, 真正意义上做到了中国客户由本地客服团队来服务, 在华业务由本地管理团队来管理的具有中国特色的本土化服务。

北美信托通过公司与机构服务部和运营与信息技术部为客户提供全球托管服务。

公司与机构服务部负责客户服务和客户关系管理。运营与信息技术部负责每日运营处理以及系统技术创新。该部门分两条线管理，分别是地域线和功能线。我们通过这种管理方法确保全球交易处理的准确性和一致性，同时更好地来了解客户投资的市场以满足客户特别的要求。地区线管理主要按照北美、欧洲中东非洲、亚太地区进行区分。我行在芝加哥、伦敦、新加坡和印度的班加罗尔均设有全球托管运营中心。北美信托伦敦分行负责所有全球托管及相关活动；新加坡分行负责处理亚太地区投资管理人的交易；芝加哥分行负责所有北美地区的交易及相关活动。班加罗尔分行通过为各地区处理中心提供备份来加强我们的全球业务连续性。功能性管理主要是从资产服务、每日估值和客户报告、数据管理、资本市场运营、技术应用和客户解决方案、技术构建和运营这几方面来管理。

北美信托银行符合《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》第十九条规定的境外资产托管人资质要求。

北美信托建立了一个经过良好规划的合规监控、风险管理和公司治理结构，贯穿从董事会到各业务部门的每个层面。在董事会层面，业务风险委员会及审计委员会对风险管理和合规监控活动提供董事会层面上的政策与督导。在执行层面，企业风险委员会对风险管理活动提供方向和管理。该委员会由资产/负债委员会、信贷政策委员会、操作风险委员会、信托风险委员会、合规监控委员会组成。此外，由风险管理专家及业务经理组成的工作组，也将风险管理政策纳入到日常业务操作中。

我行采用许多企业层面指标来评估操作风险。例如：员工流失率、关键风险岗位数量、所确定的重要审计点数量、合规问题、风险与控制状况、损失事件历史、关键风险问题的评估等。这些指标连同各业务部门风险管理官员的意见，均包含在“业务部门风险概况”报告中。

为了控制和防范包括操作风险在内的其它风险点，公司为每一参与层开发了最佳流程模式。主要模式之一是关注对风险源头的管理。这一模式包括七步流程，以保证风险被正确地辨别和管理，并不与控制措施脱节。

#### （五）托管业务主要制度管理

北美信托银行依照美国法律可以从事托管业务，并建立了健全的法人治理结构、有效的内部管理制度、严密的风险控制机制、有效的托管资产隔离制度，具有安全高效的托管系统和灾难处置系统。

北美信托设有专门的内部审计部，负责检查监控内部操作程序和工作指引。此外，我们还聘用毕马威会计师事务所为我们进行外部审计。

内部审计部对内部操作运营部门进行不定期审查。北美信托拥有一个由财务、运营、信息技术等专家组成的内部审计部门，并在芝加哥、都柏林、伦敦、洛杉矶、迈阿密、新加坡和班加罗尔都有人员设置。

内部审计部门负责对主要的操作流程和风险进行独立和客观的评估,分析控制环节的充足性和有效性,并将审计结果通报给管理层和专门的审计和监督委员会。内部审计部门遵循内部审计协会制定的准则和指引以及相关法律法规进行内部审计。

## § 14 相关服务机构

### 14.1 销售机构

#### 14.1.1 申购赎回代理证券公司

申购赎回代理证券公司:

| 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<br>法定代表人:周易<br>联系人:庞晓芸<br>联系电话:0755-82492193<br>客服电话:95597<br>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<br>办公地址:上海市浦东新区长柳路36号<br>法定代表人:杨华辉<br>联系人:乔琳雪<br>联系电话:021-38565547<br>客服电话:95562<br>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<br>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<br>法定代表人:何如<br>联系人:李颖<br>电话:0755-82130833<br>传真:0755-82133952<br>客服电话:95536 |

|   |              |   |
|---|--------------|---|
|   |              | 网址: <a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>  |
| 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<br>办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座<br>法定代表人: 陈共炎<br>联系人: 辛国政<br>联系电话: 010-83574507<br>客服电话: 4008-888-888 或 95551<br>网址:<br><a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a> |
| 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<br>办公地址: 上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦<br>法定代表人: 贺青<br>联系人: 芮敏祺<br>电话: 021-38676666<br>客服电话: 4008888666<br>网址: <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>                                     |
| 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<br>办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号<br>法定代表人: 李玮<br>联系人: 许曼华<br>电话: 021-20315290<br>传真: 021-20315137<br>客服电话: 95538<br>网址: <a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a>                               |
| 7 | 海通证券股份有限公司   | 注册地址: 上海市广东路 689 号<br>办公地址: 上海市广东路 689 号<br>法定代表人: 周杰<br>电话: 021-23219000<br>传真: 021-23219100<br>联系人: 李笑鸣<br>客服电话: 95553<br>网址: <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>  |
| 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   |

|    |            |   |
|----|------------|---|
|    |            | <p>办公地址：北京市朝阳区内大街 188 号<br/>         法定代表人：王常青<br/>         联系人：刘畅<br/>         联系电话：010-65608231<br/>         客服电话：4008888108<br/>         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<br/>         办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦<br/>         法定代表人：孙树明<br/>         联系人：黄岚<br/>         客服电话：95575、020-95575 或致电各地营业网点<br/>         网址：广发证券网<br/> <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：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层<br/>         办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层<br/>         法定代表人：丁益<br/>         联系人：纪毓灵<br/>         联系电话：0755-83516289<br/>         客服电话：0755-33680000<br/>         4006666888<br/>         网址：www.cgws.com</p> |
| 11 | 招商证券股份有限公司 | <p>注册地址：深圳市福田区福华一路 111 号<br/>         办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼<br/>         法定代表人：霍达<br/>         联系人：黄婵君<br/>         联系电话：0755-82960167<br/>         客服电话：95565、4008888111<br/>         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</p>   |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
|    |              | <p>办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦<br/>         法定代表人:张佑君<br/>         联系人:王一通<br/>         电话:010-60838888<br/>         传真:010-60833739<br/>         客服电话:95558<br/>         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<br/>         办公地址:上海市徐汇区长乐路989号40层<br/>         法定代表人:李梅<br/>         联系人:陈宇<br/>         电话:021-33389888<br/>         传真:021-33388224<br/>         客服电话:95523或4008895523<br/>         网址:www.swhysc.com</p>   |
| 14 | 光大证券股份有限公司   | <p>注册地址:上海市静安区新闸路1508号<br/>         办公地址:上海市静安区新闸路1508号<br/>         法定代表人:刘秋明<br/>         联系人:郁疆<br/>         联系电话:021-22169999<br/>         客服电话:95525<br/>         网址:www.ebscn.com</p>   |
| 15 | 中国中金财富证券有限公司 | <p>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<br/>         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<br/>         法定代表人:高涛<br/>         联系人:万玉琳<br/>         联系电话:0755-82026907<br/>         传真:0755-82026539<br/>         客服电话:400-600-8008、95532</p> |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
|    |                | 网址: <a href="http://www.ciccwm.com">www.ciccwm.com</a>  |
| 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<br>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<br>法定代表人: 李琦<br>电话: 0991-5801913<br>传真: 0991-5801466<br>联系人: 王怀春<br>客服电话: 400-800-0562<br>网址: <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a> |
| 17 | 湘财证券股份有限公司     | 注册地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼<br>办公地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼<br>法定代表人: 孙永祥<br>联系人: 李欣<br>联系电话: 021-38784580-8918<br>客服电话: 95351<br>网址: <a href="http://www.xcsc.com">www.xcsc.com</a>                                       |
| 18 | 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<br>办公地址: 深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层<br>法定代表人: 黄炎勋<br>联系人: 陈剑虹<br>联系电话: 0755-82825551<br>客服电话: 4008001001<br>网址: <a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a>                                   |
| 19 | 中信证券(山东)有限责任公司 | 注册地址: 青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层<br>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<br>法定代表人: 姜晓林   |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
|    |              | <p>联系人: 焦刚<br/> 联系电话: 0531-89606166<br/> 客服电话: 95548<br/> 网址: sd.citics.com</p>   |
| 20 | 中银国际证券股份有限公司 | <p>注册地址: 上海市浦东新区<br/> 银城中路 200 号中银大厦<br/> 39F<br/> 法定代表人: 宁敏<br/> 联系人: 王炜哲<br/> 联系电话: 021-20328309<br/> 客服电话: 4006208888<br/> 网址: www.bocichina.com</p>   |
| 21 | 长江证券股份有限公司   | <p>注册地址: 武汉市新华路特<br/> 8 号长江证券大厦<br/> 法定代表人: 李新华<br/> 联系人: 奚博宇<br/> 电话: 027-65799999<br/> 传真: 027-85481900<br/> 客服电话: 95579 或 4008-<br/> 888-999<br/> 网址: www.95579.com</p>  |
| 22 | 东北证券股份有限公司   | <p>注册地址: 长春市生态大街<br/> 6666 号<br/> 办公地址: 长春市生态大街<br/> 6666 号<br/> 法定代表人: 李福春<br/> 联系人: 安岩岩<br/> 联系电话: 0431-85096517<br/> 客服电话: 95360<br/> 网址: www.nesc.cn</p>  |
| 23 | 上海证券有限责任公司   | <p>注册地址: 上海市黄浦区四<br/> 川中路 213 号 7 楼<br/> 办公地址: 上海市黄浦区四<br/> 川中路 213 号久事商务大厦<br/> 7 楼<br/> 法定代表人: 李俊杰<br/> 联系人: 邵珍珍<br/> 联系电话: 021-53686888<br/> 传真: 021-53686100-7008<br/> 客服电话: 4008918918<br/> 网址: www.shzq.com</p> |
| 24 | 国联证券股份有限公司   | <p>注册地址: 江苏省无锡滨湖<br/> 区太湖新城金融一街 8 号 7-<br/> 9 层</p>   |

|    |              |  |
|----|--------------|--|
|    |              | <p>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</p> <p>法定代表人:姚志勇</p> <p>联系人:祁昊</p> <p>联系电话:0510-82831662</p> <p>客服电话:95570</p> <p>网址:www.glsc.com.cn</p>  |
| 25 | 国都证券股份有限公司   | <p>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</p> <p>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</p> <p>法定代表人：翁振杰</p> <p>联系人：黄静</p> <p>电话：010-84183333</p> <p>传真：010-84183311-3389</p> <p>客服电话：400-818-8118</p> <p>网址：www.guodu.com</p> |
| 26 | 东吴证券股份有限公司   | <p>注册地址：苏州工业园区星阳街5号</p> <p>办公地址：苏州工业园区星阳街5号</p> <p>法定代表人：范力</p> <p>联系人：陆晓</p> <p>电话：0512-62938521</p> <p>传真：0512-65588021</p> <p>客服电话：95330</p> <p>网址：www.dwzq.com.cn</p>                                      |
| 27 | 中信证券华南股份有限公司 | <p>注册地址：广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼</p> <p>办公地址：广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼</p> <p>法定代表人：胡伏云</p> <p>联系人：梁微</p> <p>联系电话：020-88836999</p> <p>客服电话：95396</p> <p>网址：www.gzs.com.cn</p>                       |
| 28 | 华福证券有限责任公司   | <p>注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层</p> <p>办公地址：上海市浦东新区</p>  |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
|    |              | <p>陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼<br/>         法定代表人: 黄金琳<br/>         联系人: 王虹<br/>         电话: 021-20655183<br/>         传真: 021-20655196<br/>         客服电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)<br/>         网址: www.hfzq.com.cn</p>          |
| 29 | 西南证券股份有限公司   | <p>注册地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号<br/>         法定代表人: 廖庆轩<br/>         联系人: 周青<br/>         联系电话: 023-63786633<br/>         客服电话: 4008096096<br/>         网址: www.swsc.com.cn</p>  |
| 30 | 国盛证券有限责任公司   | <p>注册地址: 江西省南昌市新建区子实路 1589 号<br/>         办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼<br/>         法定代表人: 徐丽峰<br/>         联系人: 占文驰<br/>         联系电话: 0791-88250812<br/>         客服电话: 956080<br/>         网址: www.gsyzq.com</p> |
| 31 | 中国国际金融股份有限公司 | <p>注册地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层<br/>         办公地址: 北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦<br/>         联系人: 杨涵宇<br/>         联系电话: 010-65051166<br/>         客服电话: 400-910-1166<br/>         网址: www.cicc.com.cn</p>              |
| 32 | 方正证券股份有限公司   | <p>注册地址: 湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717<br/>         办公地址: 北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层<br/>         法定代表人: 施华<br/>         联系人: 程博怡</p>  |

|    |            |  |
|----|------------|--|
|    |            | 联系电话：010-59355997<br>客服电话：95571<br>网址：www.foundersc.com  |
| 33 | 财通证券股份有限公司 | 注册地址：杭州市杭大路<br>15号嘉华国际商务中心<br>201、501、502、1103、<br>1601-1615、1701-1716<br>办公地址：杭州市杭大路<br>15号嘉华国际商务中心<br>201、501、502、1103、<br>1601-1615、1701-1716<br>法定代表人：陆建强<br>联系人：蔡驰宙<br>联系电话：0571-87821867<br>客服电话：95336,40086-<br>96336<br>网址：www.ctsec.com |
| 34 | 恒泰证券股份有限公司 | 注册地址：呼和浩特市赛罕<br>区敕勒川大街东方君座D<br>座14层<br>办公地址：呼和浩特市赛罕<br>区敕勒川大街东方君座D<br>座14层<br>法定代表人：庞介民<br>联系人：熊丽<br>客服电话：956088<br>网址：www.cnht.com.cn   |
| 35 | 华鑫证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区莲<br>花街道福中社区深南大道<br>2008号中国凤凰大厦1栋<br>20C-1房<br>办公地址：上海市徐汇区宛<br>平南路8号<br>法定代表人：俞洋<br>联系人：杨莉娟<br>电话：021-54967552<br>传真：021-54967032<br>客服电话：95323，<br>4001099918<br>网址：www.cfsc.com.cn  |
| 36 | 东兴证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金<br>融大街5号新盛大厦B座<br>12、15层<br>办公地址：北京市西城区金  |

|    |                        |  |
|----|------------------------|--|
|    |                        | 融大街 5 号新盛大厦 B 座<br>12、15 层<br>法定代表人：魏庆华<br>联系人：夏锐<br>电话：010-66559079<br>传真：010-66555133<br>客服电话：95309<br>网址：www.dxzq.net |
| 37 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人网站列示 |  |

#### 14.1.2 二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司

#### 14.2 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
法定代表人：周明  
联系人：陈文祥  
电话：021-68419095  
传真：021-68870311

#### 14.3 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

#### 14.4 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 号领展企业广场 2 座普华永道中心 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

## § 15 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“重要提示”部分,对“重要提示”进行了更新。
- 2、在“基金的投资”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。
- 3、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。
- 4、在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。
- 5、在“境外托管人”部分,对“境外托管人”进行了更新。
- 6、在“基金份额的申购与赎回”部分,对“申购、赎回清单的内容与格式”进行了更新。
- 7、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。
- 8、在“基金份额持有人服务”部分,对“基金份额持有人服务”进行了更新。
- 9、在“其他应披露事项”部分,对“其他应披露事项”进行了更新。
- 10、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理股份有限公司

2020年7月10日