南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2019 年第 1 号)

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: 2019 年 02 月 08 日

重要提示

本基金经中国证监会 2017 年 2 月 21 日证监许可[2017]255 号文注册募集,并于 2017 年 11 月 3 日获得证监会延期募集备案的回函(机构部函[2017] 2523 号)。本基金的基金合同已于 2018 年 2 月 8 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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 80%。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,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;本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")的,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、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。本基金的特定风险详见招募说明书"风险揭示"章节等。本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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和基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现;基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资人保证最低收益。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、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险,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。当日竞价买入的基金份额,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 2019 年 2 月 8 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日(未经审计)。

§1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

名称:南方基金管理股份有限公司

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 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,注册资本达 1.5 亿元人民币。2014 年公司进行增资扩股,注册资本金达 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。目前股权结构:华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

1.2 主要人员情况

1.2.1 董事会成员

张海波先生,董事长,工商管理硕士,中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员,江苏省人民政府办公厅调研员,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。

王连芬女士,董事,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。现任华泰证券股份有限公司总裁助理兼深圳分公司总经理。

张辉先生,董事,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。现任华泰证券股份有限公司董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生,董事,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、纪委书记,深圳市投控资本有限公司监事。

李平先生,董事,工商管理硕士,中国籍。曾任职深圳市城建集团办公室文秘、董办文秘,深圳市投资控股有限公司办公室(信访办)高级主管、企业三部高级主管。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长,深圳市城市建设开发(集团)公司董事。

李自成先生,董事,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。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

王斌先生,董事,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。现任兴业证券研究所总经理。

杨小松先生,董事,经济学硕士,中国注册会计师,中国籍。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总裁、党委副书记,南方东英资产管理有限公司董事。

姚景源先生,独立董事,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,中国经济 50 人论坛成员,中国统计学会副会长。

李心丹先生,独立董事,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,南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、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。

周锦涛先生,独立董事,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。

郑建彪先生,独立董事,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。现任致同会计师事务所(特殊普通合伙)管理合伙人,中国证监会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。

周蕊女士,独立董事,法学硕士,中国籍。曾任职北京市万商天勤(深圳)律师事务所律师,北京市中伦(深圳)律师事务所律师,北京市信利(深圳)律师事务所律师、合伙人。现任金杜律师事务所合伙人,全联并购公会广东分会会长,广东省律师协会女律师工作委员会副主任,深圳市中小企业改制专家服务团专家,深圳市女企业家协会理事。

1.2.2 监事会成员

吴晓东先生,监事会主席,法律博士,中国籍。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。

舒本娥女士,监事,大学本科学历,中国籍。曾任职熊猫电子集团公司财务处处长,华泰证券计划资金部副总经理、稽查监察部副总经理、总经理、计划财务部总经理。现任华泰证券股份有限公司财务总监,华泰联合证券有限责任公司监事会主席,华泰长城期货有限公司副董事长,华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士,监事,大学本科学历,高级会计师,中国籍。曾任职浙江兰溪马涧米厂主管会计,浙江兰溪纺织机械厂主管会计,深圳市建筑机械动力公司会计,深圳市建设集团计划财务部助理会计师,深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理,深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长、考核分配部部长。现任深圳市投资控股有限公司财务部部长、深圳经济特区房地产(集团)股份有限公司董事、深圳市建安(集团)股份有限公司董事。

王克力先生,监事,船舶工程专业学士,中国籍。曾任职厦门造船厂技术员,厦门汽车工业公司总经理助理,厦门国际信托有限公司国际广场筹建处副主任,厦信置业发展公司总经理、投资部副经理、自有资产管理部副经理职务。现任厦门国际信托有限公司投资发展部总经理。

林红珍女士,监事,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。现任兴业证券财务部、资金运营管理部总经理,兴证期货管理有限公司董事,兴业创新资本管理有限公司监事。

林斯彬先生,职工监事,民商法专业硕士,中国籍。曾任职金杜律师事务所证券业务部实习律师,上海浦东发展银行深圳分行资产保全部职员,银华基金监察稽核部法务主管,民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金管理股份有限公司监察稽核部执行董事。

徐刚,职工监事,硕士学历,中国籍。1995 年 7 月专科毕业于山东理工大学机电专业,2010 年 6 月研究生毕业于兰州大学工商管理专业。1995 年 11 月参加工作,就职于深圳期货投资公司,任职职员、项目经理,2003 年 6 月加入公司,先后任职上海分公司职员、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,目前任职上海分公司董事。

董星华,职工监事,硕士学历,中国籍。1991 年 7 月专本科毕业于华中理工大学机械工程专业,2002 年 6 月研究生毕业于中国人民大学政治经济学专业。其 1991 年 11 月参加工作,先后就职于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,任职科员、主任科员、经理,2011 年 2 月加入公司,先后任职综合管理部经理、办公室高级经理,现任办公室高级副总裁。

1.2.3 公司高级管理人员

张海波先生,董事长,简历同上。

杨小松先生,总裁,简历同上。

俞文宏先生,副总裁,工商管理硕士,经济师,中国籍。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。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。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,中国籍。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。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)。

鲍文革先生,督察长,经济学硕士,中国籍。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。

1.2.4 基金经理

孙伟先生,管理学学士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格、注册会计师(CPA)资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金,历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员;2014 年 12 月至 2015 年 5 月,担任南方恒生 ETF 的基金经理助理;2015 年 5 月至 2016 年 7 月,任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理;2015 年 7 月至今,任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理;2016 年 5 月至今,任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理;2016 年 8 月至今,任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理;2017 年 3 月至今,任南方全指证券 ETF 联接、南方中证全指证券 ETF 基金经理;2017 年 6 月至今,任南方中证银行 ETF、南方银行联接基金经理;2018 年 2 月至今,任 H 股 ETF、南方 H 股联接基金经理。

罗文杰女士,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士,具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行,从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理;2013 年 4 月起担任数量化投资部基金经理;现任指数投资部总经理。2013 年 5 月至 2015 年 6 月,任南方策略基金经理;2017 年 11 月至 2019 年 1 月,任南方策略、南方量化混合基金经理;2013 年 4 月至今,任南方 500、南方 500ETF 基金经理;2013 年 5 月至今,任南方 300、南方开元沪深 300ETF 基金经理;2014 年 10 月至今,任 500 医药基金经理;2015 年 2 月至今,任南方恒生 ETF 基金经理;2016 年 12 月至今,任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理;2017 年 7 月至今,任恒生联接基金经理;2017 年 8 月至今,任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理;2018 年 2 月至今,任 H 股 ETF、南方 H 股 ETF 联接基金经理;2018 年 4 月至今,任 MSCI 基金基金经理;2018 年 6 月至今,任 MSCI 联接基金经理。

1.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官(固定收益)李海鹏先生,副总裁兼首席投资官(权益)史博先生,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。

1.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

§2 基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间:1984 年 1 月 1 日

法定代表人:易会满

注册资本:人民币 34,932,123.46 万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至 2018 年 9 月,中国工商银行资产托管部共有员工 212 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 2018 年 9 月,中国工商银行共托管证券投资基金 899 只。自 2003 年以来,本行连续十五年获得香港《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 62 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。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017 共十一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,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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

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

§3 相关服务机构

3.1 销售机构

3.1.1 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 法定代表人:周易 联系人:庞晓芸 联系电话:0755-82492193 客服电话:95597 网址:www.htsc.com.cn
2	国信证券股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人:何如 联系人:周杨 电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 客服电话:95536 网址:www.guosen.com.cn
3	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层 办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 法定代表人:陈共炎 联系人:辛国政 联系电话:010-83574507 客服电话:4008-888-888 或 95551 网址:www.chinastock.com.cn
4	国泰君安证券股份有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号 办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人:杨德红 联系人:芮敏祺 电话:021 – 38676666 客服电话:4008888666 网址:www.gtja.com
5	中泰证券股份有限公司	注册地址:济南市市中区经七路 86 号 办公地址:山东省济南市市中区经七路 86 号 法定代表人:李玮 联系人:许曼华 电话:021-20315290 传真:021-20315137 客服电话:95538 网址:www.zts.com.cn
6	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:北京市朝阳门内大街 188 号 法定代表人:王常青 联系人:刘畅 联系电话:010-65608231 客服电话:4008888108 网址:www.csc108.com
7	广发证券股份有限公司	注册地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼 法定代表人:孙树明 联系人:黄岚 客服电话:95575 或致电各地营业网点 网址:广发证券网 http://www.gf.com.cn
8	长城证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 办公地址:深圳市福田区深南大道特区报业大厦 14、16、17 层 法定代表人:丁益 联系人:金夏 联系电话:0755-83516289 客服电话:0755-33680000 4006666888 网址:www.cgws.com
9	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路 111 号 办公地址:深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼 法定代表人:霍达 联系人:黄婵君 联系电话:0755-82960167 客服电话:95565、4008888111 网址:www.newone.com.cn
10	中信证券股份有限公司	注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人:张佑君 联系人:王一通 电话:010-60838888 传真:010-60833739 客服电话:95558 网址:www.cs.ecitic.com
11	申万宏源证券有限公司	注册地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层 法定代表人:李梅 联系人:李玉婷 电话:021-33389888 传真:021-33388224 客服电话:95523 或 4008895523 网址: www.swhysc.com
12	光大证券股份有限公司	注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号 办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人:周健男 联系人:龚俊涛 联系电话:021-22169999 客服电话:95525 网址:www.ebscn.com
13	申万宏源西部证券有限公司	注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人:李琦 电话:0991-5801913 传真:0991-5801466 联系人:王怀春 客服电话:400-800-0562 网址:www.hysec.com
14	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 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 法定代表人:孙永祥 联系人:李欣 联系电话:021-38784580-8918 客服电话:95351 网址:www.xcsc.com
15	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 办公地址:山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层 法定代表人:姜晓林 联系人:焦刚 联系电话:0531-89606166 客服电话:95548 网址:sd.citics.com
16	上海证券有限责任公司	注册地址:上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼 办公地址:上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼 法定代表人:李俊杰 联系人:邵珍珍 联系电话:021-53686888 传真:021-53686100-7008 客服电话:4008918918 网址:www.shzq.com
17	国联证券股份有限公司	注册地址:江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层 办公地址:江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层 法定代表人:姚志勇 联系人:祁昊 联系电话:0510-82831662 客服电话:95570 网址:www.glsc.com.cn
18	平安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 办公地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层 法定代表人:何之江 联系人:王阳 联系电话:021-38637436 客服电话:95511-8 网址:stock.pingan.com
19	广州证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 办公地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 法定代表人:胡伏云 联系人:梁微 联系电话:95396 客服电话: 95396 网址:www.gzs.com.cn
20	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 一 24 层 办公地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22 一 24 层 法定代表人:高利 联系人:丁敏 联系电话:010-59355997 客服电话:95571 网址:www.foundersc.com
21	恒泰证券股份有限公司	注册地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层 办公地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层 法定代表人:庞介民 联系人:熊丽 客服电话:4001966188 网址:www.cnht.com.cn
22	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.1.2 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

3.2 登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人:周明

联系人:崔巍

电话:010-50938856

传真:010-59378907

3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

注册地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人:俞卫锋

联系人:丁媛

电话: (86 21) 3135 8666

传真: (86 21) 3135 8600

经办律师:黎明、丁媛

3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址:上海市湖滨路 202 号领展企业广场 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

§4 基金名称

南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

§5 基金的类型

股票型证券投资基金

§6 基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

§7 基金的投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股(包括沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票)。基金在境内可投资于货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具。基金在境外可投资于境外证券市场的股票、公募基金、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、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证、期权等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后,还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 80%,且不低于非现金基金资产的 80%。正常情况下,基金投资港股通股票的资产不低于基金资产净值的 80%。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。

§8 基金的投资策略

本基金为被动式指数基金,采用指数复制法。本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,在保持基金资产的流动性前提下,达到有效复制标的指数的目的。在正常市场情况下,本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 2%。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。

本基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,如果未来出现由于港股通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时,为了更好的保护投资人的利益,实现投资目标,本基金将可通过合格境内机构投资者的额度进行投资,直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

1、股票投资组合的构建

本基金将根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

2、股票投资组合的调整

1)定期调整

本基金将依照标的指数的定期调整规则,对股票组合进行相应的调整。

2)不定期调整

A、当成份股发生并购、股份回购、增发、送配、拆股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整;

B、根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

C、若个别成份股因停牌、流动性不足、个别标的指数成份股不属于港股通股票范围或法规限制等因素,使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

构造替代性组合的方法如下:

A、按照与被替代股票所属行业及基本面相似的原则,选取替代股票备选库。本基金投资采用与标的指数相同或类似的行业分类标准;

B、采用备选库中各股票过去较长一段时间的历史数据,分析其与被替代股票的相关性;

C、选取备选库中与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合,以模拟组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标,求解组合中各股票的权重。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的,基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本,以及税务及其他监管限制,决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但本基金管理人需在方法变更实施前 2 个工作日内在指定媒介公告,并阐明变更复制方法的原因。

3、债券和货币市场工具的配置策略

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。

4、金融衍生产品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品,如股指期货、期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。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,对冲某些成份股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的杠杆作用,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。

§9 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为经估值汇率调整的标的指数收益率,本基金标的指数为恒生中国企业指数。

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

恒生中国企业指数于 1994 年 8 月由恒生指数公司推出,成份股由市值最大、成交最活跃的 40 只 H 股组成,用于衡量以 H 股形式在香港上市、注册登记地在中国大陆的企业的表现。标的指数采取自由流通市值加权的方法,以充分考虑成份股的可投资性。同时,标的指数每只成份股规定 10%的权重上限,避免个股权重过大。

§10 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

§11 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 12 月 31 日(未经审计)。

1.1 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	157,829,024.56	99.11
	其中:普通股	157,829,024.56	99.11
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
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	1,412,536.16	0.89
8	其他资产	1,167.38	0.00
9	合计	159,242,728.10	100.00

本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 157,829,024.56 元,占净值比 99.47%。

1.2 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

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	157,829,024.56	99.47
合计	157,829,024.56	99.47

1.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

1.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	17,231,927.49	10.86
材料	1,748,019.00	1.10
工业	5,935,510.24	3.74
非必需消费品	5,631,330.40	3.55
必需消费品	1,123,726.50	0.71
医疗保健	2,901,694.02	1.83
金融	91,819,575.78	57.87
科技	12,958,472.28	8.17
通讯	14,454,802.83	9.11
公用事业	4,023,966.02	2.54
政府	-	-
合计	157,829,024.56	99.47

注:以上分类采用彭博行业分类标准(BICS)。

1.3.2 报告期末积极投资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积极投资的权益投资。

1.4 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

1.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	0939 HK	香港联合交易所	香港	2,846,000	16,109,077.19	10.15
2	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	香港	3,162,000	15,487,343.20	9.76
3	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	239,500	14,511,120.59	9.15
4	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	香港联合交易所	香港	47,100	12,958,472.28	8.17
5	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	香港联合交易所	香港	189,000	12,478,095.63	7.86
6	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	香港	3,404,000	10,081,136.62	6.35
7	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	香港联合交易所	香港	549,000	5,820,508.98	3.67
8	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	0386 HK	香港联合交易所	香港	1,094,000	5,358,366.05	3.38
9	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港联合交易所	香港	319,000	4,651,009.79	2.93
10	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港联合交易所	香港	167,000	4,199,538.98	2.65

注:以上证券代码采用当地市场交易代码。

1.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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

(下转 164 版)