**南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书（更新）**

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

截止日：2020年09月25日

目录

[§1 绪言 4](#_Toc54189851)

[§2 释义 5](#_Toc54189852)

[§3 基金管理人 10](#_Toc54189853)

[§4 基金托管人 21](#_Toc54189854)

[§5 相关服务机构 24](#_Toc54189855)

[§6 基金的募集 91](#_Toc54189856)

[§7 基金合同的生效 91](#_Toc54189857)

[§8 基金份额的上市交易 91](#_Toc54189858)

[§9 基金份额的申购和赎回 94](#_Toc54189859)

[§10 基金的投资 105](#_Toc54189860)

[§11 基金的财产 119](#_Toc54189861)

[§12 基金资产估值 120](#_Toc54189862)

[§13 基金的费用与税收 126](#_Toc54189863)

[§14 基金的收益与分配 128](#_Toc54189864)

[§15 基金的会计与审计 130](#_Toc54189865)

[§16 基金的信息披露 131](#_Toc54189866)

[§17 风险揭示 137](#_Toc54189867)

[§18 基金合同的变更、终止和基金财产的清算 142](#_Toc54189868)

[§19 基金合同的内容摘要 145](#_Toc54189869)

[§20 基金托管协议的内容摘要 164](#_Toc54189870)

[§21 基金份额持有人服务 179](#_Toc54189871)

[§22 其他应披露事项 181](#_Toc54189872)

[§23 招募说明书存放及其查阅方式 183](#_Toc54189873)

[§24 备查文件 184](#_Toc54189874)

重要提示

本基金经中国证监会2009年8月7日证监许可[2009]755号文核准募集，并于2009年9月25日成立。根据《南方中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，将本基金变更为中证500交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，本基金的名称相应变更为“南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”。修改事项已报中国证监会备案，自2013年2月22日起生效。投资者可访问本公司网站(www.nffund.com)查阅修订后的基金合同、托管协议全文。

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；本基金的特定风险：本基金为目标ETF的联接基金，通过投资目标ETF紧密跟踪中证500指数的表现，与目标ETF在投资方法、交易方式等方面存在着联系和区别等；本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在流动性风险、市场风险和信用风险等转融通业务特有风险。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读《招募说明书》、《基金合同》及基金产品资料概要等信息披露文件。

本基金投资范围包括中国存托凭证，存在中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与中国存托凭证发行机制相关的风险等。

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。

本次披露版本除新增2020年10月19日已在官网披露涉及新增存托凭证的投资策略相关内容之外，其他内容截止日至2020年09月25日。

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9月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2020年6月30日（未经审计）。

§1 绪言

本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》以及《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，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》、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。

§2 释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

1、基金或本基金：指南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），本基金由南方中证500指数证券投资基金（LOF）通过基金合同修订变更而来

2、基金管理人或本基金管理人：指南方基金管理股份有限公司

3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同：指《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《南方中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订

13、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

14、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国银行保险监督管理委员会

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者

22、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

23、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

24、目标ETF：指南方基金管理股份有限公司管理的中证500交易型开放式指数证券投资基金（简称中证500ETF）

25、ETF联接基金：是指将其绝大部分基金财产投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金

26、基金销售业务：指基金管理人或代销机构办理基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

27、销售机构：指直销机构和代销机构

28、直销机构：指南方基金管理股份有限公司

29、代销机构：指接受基金管理人委托代为办理本基金销售业务的机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位

30、基金销售网点：指直销机构的直销网点及代销机构的代销网点

31、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

32、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为南方基金管理股份有限公司或接受南方基金管理股份有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。

本基金A类份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；本基金C类份额的注册登记机构为南方基金管理股份有限公司

33、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

34、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

35、基金募集期限：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、日：指公历日

39、月：指公历月

40、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

41、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

42、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、发售：指在基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为

45、认购：指在基金募集期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

46、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

47、赎回：指在基金存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

48、上市交易：指基金存续期内，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

49、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

50、销售场所：指场外销售场所和场内交易场所，分别简称为场外和场内

51、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所

52、场内：通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所

53、注册登记系统：指中国证券登记结算有限公司开放式基金登记结算系统或南方基金管理股份有限公司办理注册登记业务使用的系统

54、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限公司深圳分公司证券登记结算系统

55、系统内转托管：指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

56、跨系统转登记：指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

57、证券账户：指注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户,包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户,记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

58、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

59、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户

60、A类基金份额：指注册登记业务办理机构为中国证券登记结算有限责任公司，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

61、C类基金份额：指注册登记业务办理机构为南方基金管理股份有限公司，从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

62、元：指人民币元

63、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定

64、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

65、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

66、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

67、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

68、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

69、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

70、转融通证券出借业务：是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

71、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

§3 基金管理人

3.1 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%。

3.2 主要人员情况

3.2.1 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、深交所第一届创业板上市委委员、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。

3.2.2 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。

3.2.3 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。

3.2.4 基金经理

本基金历任基金经理为：张原先生，管理时间为2009年9月25日至2013年4月19日；潘海宁先生，管理时间为2011年2月17日至2013年4月21日；罗文杰女士，管理时间为2013年4月22日至今。

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，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013年5月17日至2015年6月16日，任南方策略基金经理；2017年11月9日至2019年1月18日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016年12月30日至2019年4月18日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018年2月8日至2020年3月27日，任H股ETF基金经理；2018年2月12日至2020年3月27日，任南方H股联接基金经理；2013年4月22日至今，任南方500、南方500ETF基金经理；2013年5月17日至今，任南方300、南方300联接基金经理；2014年10月30日至今，任500医药基金经理；2015年2月16日至今，任南方恒生ETF基金经理；2017年7月21日至今，任恒生联接基金经理；2017年8月24日至今，任南方房地产联接基金经理；2017年8月25日至今，任南方房地产ETF基金经理；2018年4月3日至今，任MSCI基金基金经理；2018年6月8日至今，任MSCI联接基金经理；2020年7月24日至今，兼任投资经理。

3.2.5 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。

3.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

3.3 基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10、按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12、编制季度报告、中期报告和年度报告；

13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

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

17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

20、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

21、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

22、建立并保存基金份额持有人名册；

23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24、执行生效的基金份额持有人大会的决定；

25、不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

3.4 基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

　　（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

　　（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

　　（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

　　（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（9）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（10）贬损同行，以提高自己；

（11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（12）以不正当手段谋求业务发展；

（13）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（14）其他法律、行政法规禁止的行为。

3.5 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖除目标ETF外的其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资；

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

3.6 基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

3.7 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

　　内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

　　公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

　　基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

　　部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则

　　健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

　　有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

　　成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

　　3、主要内部控制制度

（1）内部会计控制制度

　　公司依据《中华人民共和国会计法》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

　　内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

　　（2）风险管理控制制度

　　风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

　　风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

（3）监察稽核制度

　　公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

　　公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

§4 基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近310名，其中具有高级职称的专家60名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2020年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共529只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理,实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

§5 相关服务机构

5.1 销售机构

5.1.1 场外销售机构

5.1.1.1 直销机构

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

法定代表人：张海波

电话：0755-82763905、82763906

传真：0755-82763900

联系人：张锐珊

5.1.1.2 代销机构

南方500A代销银行：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 代销机构名称 | 代销机构信息 |
| 1 | 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：周慕冰 客服电话：95599网址：www.abchina.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：陈四清联系人：谢宇晨客服电话：95588网址：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：田国立电话：010－66275654传真：010－66275654联系人：王嘉朔客服电话：95533网址：www.ccb.com |
| 4 | 中国银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号法定代表人：刘连舸 客服电话：95566网址：www.boc.cn |
| 5 | 交通银行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区银城中路188号办公地址：上海市浦东新区银城中路188号法定代表人：任德奇联系人：王菁电话：021-58781234传真：021-58408483客服电话：95559公司网址：www.bankcomm.com |
| 6 | 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：李建红联系人：季平伟客服电话：95555网址：www.cmbchina.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：张金良联系人：王硕传真：（010）68858057客服电话：95580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：高国富联系人：吴斌联系电话：021-61618888客服电话：95528网址：www.spdb.com.cn |
| 9 | 中信银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号办公地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼中信大厦法定代表人：李庆萍联系人：丰靖 电话：010-89937330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：王滨联系电话：0571-96000888，020-38322222客服电话：400-830-8003网址：www.cgbchina.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：高迎欣联系人：穆婷电话：010-58560666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：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心法定代表人：李晓鹏联系人：朱红电话：010-63636153传真：010-63639709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:李博联系电话:021-52629999-218966客服电话:95561网址:www.cib.com.cn |
| 14 | 平安银行股份有限公司 | 地址：深圳市深南东路5047号法定代表人：谢永林联系人：施艺帆联系电话：021-50979384客服电话：95511-3网址:bank.pingan.com |
| 15 | 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：李民吉联系人:王者凡联系电话：010-85238890客服电话:95577网址：www.hxb.com.cn |
| 16 | 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：沈仁康联系人：唐燕联系电话：0571-87659056客服电话：95527网址：www.czbank.com |
| 17 | 杭州银行股份有限公司 | 注册地址：杭州市下城区庆春路46号杭州银行大厦办公地址：杭州市下城区庆春路46号杭州银行大厦法定代表人：陈震山联系人：蔡捷联系电话：0571-85109708客服电话：95398网址：www.hzbank.com.cn |
| 18 | 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：金煜联系人：汤征程联系电话：021-68475521客服电话：95594网址：www.bosc.cn |
| 19 | 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：张东宁联系人：周黎传真：010-66225309客服电话：95526网址：www.bankofbeijing.com.cn |
| 20 | 上海农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区中山东二路70号办公地址：上海市黄浦区中山东二路70号法定代表人：徐力联系人：施传荣联系电话：021-61899999客服电话：021-962999、4006962999网址：www.srcb.com |
| 21 | 江苏银行股份有限公司 | 注册地址：南京市中华路26号办公地址：南京市中华路26号法定代表人：夏平联系人：张洪玮电话：025-58587036客服电话：95319网址：www.jsbchina.cn |
| 22 | 东莞银行股份有限公司 | 注册地址：东莞市莞城区体育路21号办公地址：东莞市莞城区体育路21号法定代表：卢国锋联系人：朱杰霞联系电话：0769-22865177客服电话：956033网址：www.dongguanbank.cn |
| 23 | 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号华普大厦办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路6号法定代表人：郭少泉联系人：徐伟静联系电话：0532-68629925客服电话：（青岛）96588；（全国）400-66-96588网址：www.qdccb.com |
| 24 | 宁波银行股份有限公司 | 注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号法定代表人：陆华裕联系人：胡技勋联系电话：0574-89068340客服电话：95574网址：www.nbcb.com.cn |
| 25 | 南京银行股份有限公司 | 注册地址：南京市玄武区中山路288号办公地址：南京市玄武区中山路288号法定代表人：胡升荣联系人：赵世光联系电话：025-86775305客服电话：95302网址：www.njcb.com.cn |
| 26 | 汉口银行股份有限公司 | 注册地址：武汉市江汉区建设大道933号汉口银行大厦办公地址：武汉市江汉区建设大道933号汉口银行大厦法定代表人：陈新民联系人：周田联系方式：027-82656785客服电话：96558（武汉）、40060-96558（全国）网址：www.hkbchina.com |
| 27 | 重庆银行股份有限公司 | 注册地址：重庆市江北区永平门街6号办公地址：重庆市江北区永平门街6号法定代表人：林军联系人：孔文超电话：023-63799379传真：023-63792412客服电话：400-70-96899网址：www.cqcbank.com |
| 28 | 东莞农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦法定代表人：王耀球联系人：黎子晴电话：0769-22866143传真：0769-22866282客服电话：0769-961122网址：www.drcbank.com |
| 29 | 乌鲁木齐银行股份有限公司 | 注册地址：乌鲁木齐市会展大道599号办公地址：乌鲁木齐市会展大道599法定代表人：任思宇联系人：王小培电话：0991-4500319传真：0991-4500319客服电话：0991-96518网址：www.uccb.com.cn |
| 30 | 广州银行股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江东路30号广州银行大厦办公地址：广州市天河区珠江东路30号广州银行大厦法定代表人：姚建军联系人：唐荟电话：020-28302742传真：020-28302021客服电话：020-96699网址：www.gzcb.com.cn |
| 31 | 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：郑夏芳电话：0311-67807030传真：0311-88627027客服电话：400-612-9999网址：www.hebbank.com |
| 32 | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：常州市天宁区和平中路413号办公地址：常州市天宁区和平中路413号法定代表人：陆向阳联系人：李仙 夏倩电话：0519-80585939传真：0519-89995170客服电话：96005网址：www.jnbank.com.cn |
| 33 | 厦门银行股份有限公司 | 注册地址：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦办公地址：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦法定代表人：吴世群联系人：孙瑜电话：0592-5310251传真：0592-5373973客服电话：400-858-8888网址：www.xmbankonline.com |
| 34 | 泉州银行股份有限公司 | 注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路3号办公地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路3号法定代表人：傅子能 联系人：谢婷枫电话：0595-22551071传真：0595-22578871客服电话：96312网址：http://www.qzccbank.com/ |
| 35 | 南洋商业银行（中国）有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道800号三层、六层至九层（不含六层A座）办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道800号三层、六层至九层（不含六层A座）法定代表人：陈孝周联系人：宋雯电话：021-38566409传真：021-20337790客服电话：8008302066，4008302066网址：http://www.ncbchina.cn/cn/index.html |
| 36 | 东亚银行（中国）有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区花园石桥路66号办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号法定代表人： 李国宝联系人： 张薇电话：021-3866 3744传真：021-3867 5314客服电话：95382网址：www.hkbea.com.cn |

南方500A代销券商及其他代销机构：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 代销机构名称 | 代销机构信息 |
| 1 | 华泰证券股份有限公司 | 注册地址：南京市江东中路228号法定代表人：周易联系人：庞晓芸联系电话：0755-82492193客服电话：95597网址：www.htsc.com.cn |
| 2 | 兴业证券股份有限公司 | 注册地址：福州市湖东路268号办公地址：上海市浦东新区长柳路36号法定代表人：杨华辉联系人：乔琳雪联系电话：021-38565547客服电话：95562网址：www.xyzq.com.cn |
| 3 | 国信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层法定代表人：何如联系人：李颖电话：0755-82130833传真：0755-82133952客服电话：95536网址：www.guosen.com.cn |
| 4 | 中国银河证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座法定代表人：陈共炎联系人：辛国政联系电话：010-83574507客服电话：4008-888-888或95551网址：www.chinastock.com.cn |
| 5 | 国泰君安证券股份有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号 办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦法定代表人：贺青联系人：芮敏祺电话：021－38676666客服电话：4008888666网址：www.gtja.com |
| 6 | 中泰证券股份有限公司 | 注册地址：济南市市中区经七路86号办公地址：山东省济南市市中区经七路86号法定代表人：李玮联系人：许曼华电话：021-20315290传真：021-20315137客服电话：95538网址：www.zts.com.cn |
| 7 | 海通证券股份有限公司 | 注册地址：上海市广东路689号办公地址：上海市广东路689号法定代表人：周杰电话：021－23219000传真：021-23219100联系人：李笑鸣客服电话：95553网址：www.htsec.com |
| 8 | 中信建投证券股份有限公司 | 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 |
| 9 | 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：广州市天河区马场路26号广发证券大厦法定代表人：孙树明联系人：黄岚客服电话：95575、020-95575或致电各地营业网点网址：广发证券网http://www.gf.com.cn |
| 10 | 长城证券股份有限公司 | 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层法定代表人：丁益联系人:纪毓灵联系电话:0755-83516289客服电话:0755-33680000 4006666888网址：www.cgws.com |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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：陈宇电话：021-33389888传真：021-33388224客服电话：95523或4008895523网址： www.swhysc.com |
| 14 | 光大证券股份有限公司 | 注册地址:上海市静安区新闸路1508号办公地址:上海市静安区新闸路1508号法定代表人:刘秋明联系人:郁疆联系电话:021-22169999客服电话：95525网址：www.ebscn.com |
| 15 | 中国中金财富证券有限公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层法定代表人:高涛联系人：万玉琳联系电话：0755-82026907传真0755-82026539客服电话：400-600-8008、95532网址：www.ciccwm.com |
| 16 | 申万宏源西部证券有限公司 | 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室法定代表人：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 |
| 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：高振营联系人：江恩前联系电话：021-38784580-8920客服电话：95351网址：www.xcsc.com |
| 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单元办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层法定代表人：黄炎勋联系人：陈剑虹联系电话：0755-82825551客服电话：4008001001网址：www.essence.com.cn |
| 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 |
| 20 | 中银国际证券股份有限公司 | 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：宁敏联系人：王炜哲联系电话：021-20328309客服电话：4006208888网址：www.bocichina.com |
| 21 | 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：肖林联系人：王薇安联系电话：010-83252170传真：010-63080978客服电话：95321网址：www.cindasc.com |
| 22 | 民生证券股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层法定代表人：冯鹤年联系人：胡梦雅联系电话：010-85127627客服电话：95376网址：www.mszq.com |
| 23 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街8号办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12-18层法定代表人：张海文基金业务联系人：孙燕波联系电话：010-85556048传真：010-85556088客服电话：95390网址：www.hrsec.com.cn |
| 24 | 华西证券股份有限公司 | 注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦法定代表人：杨炯洋联系人：谢国梅客服电话：95584网址：www.hx168.com.cn |
| 25 | 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：李新华联系人：奚博宇电话：027-65799999传真：027-85481900客服电话：95579或4008-888-999网址：www.95579.com |
| 26 | 世纪证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层法定代表人：李强联系人：王雯联系电话：0755-83199511客服电话：4008323000网址：www.csco.com.cn |
| 27 | 东北证券股份有限公司 | 注册地址：长春市生态大街6666号办公地址：长春市生态大街6666号法定代表人：李福春联系人:安岩岩联系电话:0431-85096517客服电话:95360网址：www.nesc.cn |
| 28 | 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 |
| 29 | 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：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号法定代表人：赵洪波联系人：王金娇电话：18845074611传真：0451-82337279客服电话：956007网址：www.jhzq.com.cn |
| 30 | 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 |
| 31 | 东莞证券股份有限公司 | 注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心联系人:李荣联系电话：0769-22115712传真：0769-22115712客服电话：95328网址:www.dgzq.com.cn |
| 32 | 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：安志勇联系人:王星电话：022-28451922传真：022-28451892客服电话：400-651-5988网址：www.ewww.com.cn |
| 33 | 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 |
| 34 | 国都证券股份有限公司 | 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：翁振杰联系人：黄静电话：010-84183333传真：010-84183311-3389客服电话：400-818-8118网址：www.guodu.com |
| 35 | 东吴证券股份有限公司 | 注册地址：苏州工业园区星阳街5号办公地址：苏州工业园区星阳街5号法定代表人：范力联系人：陆晓电话：0512-62938521传真：0512-65588021客服电话：95330网址：www.dwzq.com.cn |
| 36 | 中信证券华南股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江西路5号501房办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔5楼法定代表人：胡伏云联系人：陈靖联系电话：020-88836999客服电话: 95396网址：www.gzs.com.cn |
| 37 | 华林证券股份有限公司 | 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城3幢1单元5-5办公地址：深圳市南山区深南大道9688号华润置地大厦C座31-33层法人代表：林立联系人：郑琢联系电话：0755-82707766客服电话:400-188-3888网址:www.chinalin.com |
| 38 | 南京证券股份有限公司 | 注册地址：南京市江东中路389号办公地址：南京市江东中路389号法定代表人：李剑锋联系人：王万君联系电话：025-58519523客服电话：95386网址：www.njzq.com.cn |
| 39 | 华安证券股份有限公司 | 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座法定代表人：章宏韬联系人：范超联系电话：0551-65161821客服电话：95318网址：www.hazq.com |
| 40 | 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：李素明联系人：杨敏珺联系电话：0871-63353652客服电话：956060网址：http://www.hongtastock.com |
| 41 | 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：4008-505-505网址：www.ytzq.com |
| 42 | 浙商证券股份有限公司 | 办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼法定代表人：吴承根联系人：陈姗姗电话：021-80108643传真：021-80106010客服电话：95345网址：www.stocke.com.cn |
| 43 | 华宝证券有限责任公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层法定代表人：刘加海联系人：胡星煜 电话：021-20515386传真：021-68408217-7517客服电话：4008209898 网址：www.cnhbstock.com |
| 44 | 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：400-666-1618，95573网址：www.i618.com.cn |
| 45 | 第一创业证券股份有限公司 | 注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼法定代表人:刘学民联系人:单晶联系电话:0755-23838750客服电话：95358网址:www.firstcapital.com.cn |
| 46 | 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：上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18楼法定代表人：黄金琳联系人：王虹电话：021-20655183传真：021-20655196客服电话：96326（福建省外请先拨0591）网址：www.hfzq.com.cn |
| 47 | 中山证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层法定代表人：林炳城联系人：罗艺琳联系电话：0755-82570586客服电话：95329网址：www.zszq.com |
| 48 | 国海证券股份有限公司 | 注册地址：广西省桂林市辅星路13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：何春梅联系人：牛孟宇电话：0755-83709350传真：0755-83704850客服电话：95563网址：http://www.ghzq.com.cn |
| 49 | 中原证券股份有限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号法定代表人：菅明军联系人：程月艳 李盼盼电话：0371-69099882传真：0371-65585899客服电话：95377网址：www.ccnew.com |
| 50 | 西南证券股份有限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号法定代表人：廖庆轩联系人：周青联系电话：023-63786633客服电话：4008096096网址：www.swsc.com.cn |
| 51 | 财达证券股份有限公司 | 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：马辉联系电话：0311-66006342客服电话： 河北省内95363；河北省外0311-95363网址：www.S10000.com |
| 52 | 德邦证券股份有限公司 | 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：武晓春联系人：李林电话：021-68761616传真：021-68767032客服电话：4008888128网址：www.tebon.com.cn |
| 53 | 中航证券有限公司 | 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼办公地址：北京市朝阳区望京东园四区2号 中航资本大厦35层法定代表人：王晓峰联系人：马琳瑶电话：010-59562532传真：010-59562532客服电话：95335网址：http://www.avicsec.com/ |
| 54 | 国元证券股份有限公司 | 注册地址：安徽省合肥市梅山路18号办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券法定代表人：蔡咏联系人：米硕联系电话：0551-68167601客服电话：95578网址：www.gyzq.com.cn |
| 55 | 国盛证券有限责任公司 | 注册地址:江西省南昌市新建区子实路1589号办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼法定代表人:徐丽峰联系人:占文驰联系电话:0791-88250812客服电话：956080网址:www.gszq.com |
| 56 | 中国国际金融股份有限公司 | 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：北京市建国门外大街甲6号SK大厦联系人：杨涵宇联系电话：010-65051166客服电话：400-910-1166网址：www.cicc.com.cn |
| 57 | 大同证券有限责任公司 | 注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13法定代表人：董祥联系人：薛津电话：0351-4130322传真：0351-4192803客服电话：4007121212网址：http://www.dtsbc.com.cn |
| 58 | 方正证券股份有限公司 | 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办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层法定代表人：施华联系人：胡创联系电话：010-59355997客服电话：95571网址：www.foundersc.com |
| 59 | 财通证券股份有限公司 | 注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 法定代表人：陆建强联系人：蔡驰宙联系电话：0571-87821867客服电话：95336,40086-96336网址：www.ctsec.com |
| 60 | 东海证券股份有限公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦法定代表人：钱俊文联系人：王一彦客服电话：95531；400-8888-588网址：www.longone.com.cn |
| 61 | 西部证券股份有限公司 | 注册地址：陕西省西安市东新街319号8幢10000室办公地址：陕西省西安市东新街319号8幢10000室法定代表人：徐朝晖联系人：梁承华电话：029-87211526传真：029-87211478客服电话：95582网址：http://www.westsecu.com/ |
| 62 | 新时代证券股份有限公司 | 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501法定代表人：林雯联系人：田芳芳联系电话：010-83561146　客服电话：95399网址：www.xsdzq.cn |
| 63 | 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：程宜荪联系人：冯爽联系电话：010-58328373客服电话：400-887-8827网址：www.ubssecurities.com |
| 64 | 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：王作义联系人：刘萍联系电话：0755-83025693客服电话：95372网址：www.jyzq.cn |
| 65 | 万联证券股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层办公地址：广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层法定代表人：罗钦城联系人:甘蕾联系电话：020-38286026客服电话:95322网址：www.wlzq.cn |
| 66 | 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：杜晶、黎建平联系电话：028-86690057传真：028-86690126客服电话：95310网址：www.gjzq.com.cn |
| 67 | 财信证券有限责任公司 | 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：刘宛晨 联系人：郭静 联系电话：0731-84403347客服电话： 95317网址:www.cfzq.com |
| 68 | 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：956088网址：www.cnht.com.cn |
| 69 | 华龙证券股份有限公司 | 注册地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼办公地址：兰州市城关区东岗西路638号19楼法定代表人：陈牧原联系人：范坤 电话：0931-4890208传真：0931-4890628客服电话：95368网址：www.hlzq.com |
| 70 | 华鑫证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号法定代表人：俞洋联系人：虞佳彦电话：021-54967656传真：021-54967280客服电话：95323，4001099918网址：http://www.cfsc.com.cn |
| 71 | 国融证券股份有限公司 | 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：张智河联系人:虞哲维客服电话：400-660-9839网址：www.grzq.com |
| 72 | 英大证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层法定代表人：吴骏联系人：王晓静联系电话：0755-83007336客服电话：4000-188-688网址：www.ydsc.com.cn |
| 73 | 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：黄海洲联系人：戴佳璐电话：0755-88311518传真：0755-82545500客服电话：40018-40028网址：www.wkzq.com.cn |
| 74 | 大通证券股份有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层法定代表人：赵玺联系人：谢立军电话：0411-39991807传真：0411-39991833客服电话：4008-169-169网址：www.daton.com.cn |
| 75 |  粤开证券股份有限公司 |  注册地址：广州经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层 办公地址：北京市朝阳区红军营南路天畅园6号楼 法定代表人：严亦斌 联系人：郭晴 联系电话：010-64408842 客户服务电话：95564 公司网址：http://www.ykzq.com |
| 76 | 东兴证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层办公地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层法定代表人：魏庆华联系人：夏锐电话：010-66559079传真：010-66555133客服电话：95309网址：www.dxzq.net |
| 77 | 开源证券股份有限公司 | 注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层法定代表人：李刚联系人：张梦薇电话：029-88365805传真：029-88365835客服电话：95325网址：www.kysec.cn |
| 78 | 中邮证券有限责任公司 | 注册地址：陕西省西安市唐延路5号陕西邮政信息大厦9~11层办公地址：北京市东城区珠市口东大街17号法定代表人：丁奇文联系人：吉亚利电话：010-67017788-9104传真：010-67017788-9696客服电话：4008888005网址：www.cnpsec.com |
| 79 | 太平洋证券股份有限公司 | 注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元法定代表人： 李长伟联系人：王婧电话：010-88695182传真：010-88321763客服电话：95397网址：www.tpyzq.com |
| 80 | 宏信证券有限责任公司 | 注册地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼法定代表人：吴玉明联系人：张鋆电话：010-64083702传真：028-86199382客服电话：95304网址：www.hxzq.cn |
| 81 | 天风证券股份有限公司 | 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼办公地址： 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座48楼法定代表人： 余磊联系人：王雅薇电话：13971585665客服电话：4008005000或95391网址：www.tfzq.com |
| 82 | 联储证券有限责任公司 | 注册地址： 深圳市福田区深南大道南侧金地中心大厦9楼办公地址： 北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层法定代表人： 吕春卫联系人： 张婉婷电话：010-86499765传真：010-86499401客服电话：400-620-6868网址：www.lczq.com |
| 83 | 川财证券有限责任公司 | 注册地址： 中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼法定代表人：金树成 联系人：匡婷电话：028-86583053传真：028-86583002客服电话：95105118网址：www.cczq.com |
| 84 | 国开证券股份有限公司 | 注册地址： 北京市西城区阜成门外大街29号1-9层办公地址：北京市西城区阜成门外大街29号1-9层法定代表人： 张宝荣联系人：孟妍电话：010-88300999传真：010-88300999客服电话：4008895593网址：www.gkzq.com.cn |
| 85 | 东方财富证券股份有限公司 | 注册地址： 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦 法定代表人：徐伟琴 联系人： 付佳电话：021-23586603传真：021-23586860客服电话：95357网址：http://www.18.cn |
| 86 | 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：北京市西城区新街口外大街28号C座5层法定代表人：林义相联系人：谭磊客服电话：010-66045678传真：010-66045518网址：http://www.txsec.com公司基金网网址：http://jijin.txsec.com/ |
| 87 | 中信建投期货有限公司 | 注册地址： 重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C办公地址： 渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C法定代表人： 彭文德联系人：万恋电话：021-68762007传真：021-68763048客服电话：400-8877-780网址：www.cfc108.com |
| 88 | 中信期货有限公司 | 注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层法定代表人：张皓联系人：刘宏莹电话：010-60833754传真：021-60819988客服电话：400-990-8826网址：http://www.citicsf.com |
| 89 | 弘业期货股份有限公司 | 注册地址： 南京市秦淮区中华路50号办公地址： 南京市秦淮区中华路50号弘业大厦2-10楼法定代表人： 周剑秋联系人： 张苏怡电话：025-52278981传真：025-52278733客服电话：4008281288网址：www.ftol.com.cn |
| 90 | 诺亚正行基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋法定代表人：汪静波联系人：李娟 电话：021-80359127传真：021-38509777客服电话：400-821-5399网址：www.noah-fund.com |
| 91 | 深圳众禄基金销售股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室法定代表人：薛峰联系人：龚江江电话：0755-33227950传真：0755-33227951客服电话：4006-788-887网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com |
| 92 | 上海好买基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室；上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼法定代表人：杨文斌联系人：张茹电话：021-20613999传真：021-68596916客服电话：400-700-9665网址：www.ehowbuy.com |
| 93 | 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人：祖国明联系人：韩爱彬客服电话：4000-766-123公司网址：www.fund123.cn |
| 94 | 上海长量基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层法定代表人：张跃伟联系人：邱燕芳电话：021-20691831传真：021-20691861客服电话：400-820-2899网址：www.erichfund.com |
| 95 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座大楼（东方财富大厦）法定代表人：其实联系人：潘世友电话：021-54509977 传真：021-64385308客服电话：95021 / 4001818188网址：www.1234567.com.cn |
| 96 | 北京展恒基金销售股份有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦西侧楼6层联系人：武文佳电话：010-59601338客服电话：4008188000网址：www.myfund.com |
| 97 | 浙江同花顺基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号 同花顺大楼4层法定代表人：吴强联系人：吴强电话：0571-88911818传真：0571-86800423客服电话：4008-773-772网址：www.5ifund.com |
| 98 | 浦领基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区2号楼10层1001号04室办公地址：北京市朝阳区望京中航资本大厦10层法定代表人：聂婉君客服电话：400-012-5899联系人：李艳联系电话：010-59497361传真：010-64788016公司网站：www.zscffund.com |
| 99 | 和讯信息科技有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层法定代表人：王莉联系人：陈慧慧电话：010-85657353传真：010-65884788客服电话：4009200022网址：licaike.hexun.com |
| 100 | 宜信普泽（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区西大望路1号2号楼9层1008办公地址：北京市朝阳区西大望路1号2号楼9层1008法定代表人：才殿阳联系人： 魏晨电话：13260309352传真：010-85894285客服电话：4006099200网址：www.yixinfund.com |
| 101 | 浙江金观诚基金销售有限公司 | 注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室办公地址：杭州市拱墅区登云路43号金诚集团（锦昌大厦）13楼法人：徐黎云联系人：来舒岚电话：0571-88337888传真：0571-88337666客服电话：400-068-0058网址：www.jincheng-fund.com |
| 102 | 泛华普益基金销售有限公司 | 注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室办公地址：四川省成都市成华区锦江区东大街99号平安金融中心1501室法定代表人：于海锋联系人：陈金红电话：18591999779传真：028-84252474-801客服电话：400-8588588网址：http://www.puyifund.cn |
| 103 | 嘉实财富管理有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期27层2716单元办公地址：北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼11层法定代表人：张峰联系人：李雯电话：010-65215588传真：010-65185678客服电话：400-021-8850网址：www.harvestwm.cn |
| 104 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦7层法定代表人：洪弘联系人：文雯电话：010-83363101传真：010-83363072客服电话：400-166-1188网址：https://8.jrj.com.cn |
| 105 | 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室法定代表人：周斌联系人：侯艳红电话：13910678503传真：010-57756199客服电话：4008980618网址：www.chtwm.com |
| 106 | 北京钱景基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012法定代表人：赵荣春联系人：李超电话：010-56200948传真：010-57569671客服电话：400-893-6885网址：www.qianjing.com |
| 107 | 北京创金启富基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A办公地址： 北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社综合楼A座712室法定代表人：梁蓉 联系人：魏素清电话：010-66154828-8006 传真：010-63583991 客服电话：400-6262-818 网址：www.5irich.com |
| 108 | 海银基金销售有限公司 | 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼 法定代表人：巩巧丽联系人：刘晖 电话：021-60206991传真：021-80133413客服电话：400-808-1016网址：www.fundhaiyin.com |
| 109 | 北京植信基金销售有限公司 | 注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67 办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼法定代表人： 王军辉联系人：吴鹏电话：010-56075718 传真：010-67767615客服电话：4006-802-123网址：http://www.zhixin-inv.com |
| 110 | 上海大智慧基金销售有限公司 | 注册地址： 上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层办公地址：上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层法定代表人： 申健联系人：张蜓电话：021-20219988（35374）传真：021-20219923客服电话：021-20292031网址：http://www.wg.com.cn |
| 111 | 上海联泰基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层法定代表人：尹彬彬联系人：陈东电话：021-52822063传真：021-52975270客服电话：400-166-6788网址：http://www.66liantai.com |
| 112 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层法定代表人：李兴春联系人：陈孜明电话：18516109631传真：021-61101630客服电话：95733网址：www.leadfund.com.cn |
| 113 | 汇付基金销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼法定代表人： 金佶联系人： 陈云卉电话：021-33323999传真：021-33323837客服电话：400-821-3999网址：www.hotjijin.com/ |
| 114 | 厦门市鑫鼎盛控股有限公司 | 注册地址： 厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504办公地址： 厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504法定代表人：陈洪生联系人：梁云波电话：0592-3122757传真：0592-3122701客服电话：400-918-0808网址：www.xds.com.cn |
| 115 | 上海陆金所基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼法定代表人：王之光联系人：宁博宇电话：021-20665952传真：021-22066653客服电话：4008219031网址：www.lufunds.com |
| 116 | 北京虹点基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室办公地址：北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室法定代表人：何静联系人：王重阳电话： 010-65951887客服电话：400-618-0707网址：www.hongdianfund.com |
| 117 | 北京新浪仓石基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座法定代表人： 赵芯蕊联系人：赵芯蕊电话：010-62675768客服电话：010-62675369网址：http://www.xincai.com |
| 118 | 珠海盈米基金销售有限公司 | 注册地址： 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼 1201-1203室法定代表人：肖雯联系人：邱湘湘电话：020-89629099传真：020-89629011客服电话：020-89629066网址：www.yingmi.cn |
| 119 | 深圳富济基金销售有限公司 | 注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元法定代表人：刘鹏宇联系人：刘勇电话：0755-83999907-8814传真：0755-83999926客服电话：0755-83999907网址：www.fujifund.cn |
| 120 | 北京唐鼎耀华基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室办公地址： 北京市朝阳区东四环中路39号华业国际中心A座10层法定代表人：张冠宇联系人： 孙书慧电话：010-85932884客服电话：400-819-9868网址：https://www.tdyhfund.com |
| 121 | 上海凯石财富基金销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼法定代表人： 陈继武联系人：高皓辉电话：021-63333389-230传真：021-63333390客服电话：4006-433-389网址： www.vstonewealth.com |
| 122 | 大泰金石基金销售有限公司 | 注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼法定代表人：袁顾明联系人：孟召社电话：15621569619传真：021-20324199客服电话：400-928-2266/021-22267995网址：www.dtfunds.com |
| 123 | 济安财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307办公地址： 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307法定代表人： 杨健联系人：李海燕电话：010-65309516传真：010-65330699客服电话：400-673-7010网址：http://www.jianfortune.com |
| 124 | 中证金牛（北京）投资咨询有限公司 | 注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室办公地址： 北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层法定代表人：钱昊旻联系人： 沈晨电话：010-59336544传真：010-59336586客服电话：4008-909-998网址：www.jnlc.com |
| 125 | 深圳前海微众银行股份有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路A栋201办公地址：深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座法定代表人：顾敏客服电话：4009998877网址：www.webank.com |
| 126 | 北京汇成基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市海淀区中关村大街11号1108办公地址： 北京市海淀区中关村大街11号1108 法定代表人：王伟刚 联系人： 王骁骁电话：010-56282140传真：010-62680827客服电话：4006199059网址：www.hcjijin.com |
| 127 | 南京苏宁基金销售有限公司 | 注册地址： 南京市玄武区苏宁大道1-5号办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号法定代表人： 王锋联系人： 张云飞电话：025-66996699-887226传真：025-66996699客服电话：95177网址：www.snjijin.com |
| 128 | 北京广源达信基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层 法定代表人： 齐剑辉联系人：姜英华 电话：4006236060 传真：010-82055860客服电话：4006236060网址：www.niuniufund.com |
| 129 | 上海万得基金销售有限公司 | 注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座办公地址： 上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼法定代表人：王廷富 联系人：徐亚丹电话：021-50712782传真：021-50710161 客服电话：400-799-1888网址：www.520fund.com.cn |
| 130 | 北京蛋卷基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室法定代表人：钟斐斐联系人：侯芳芳电话：010-61840688传真：010-84997571客服电话：4001599288网址：https://www.danjuanapp.com |
| 131 | 上海云湾基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区法定代表人： 冯轶明联系人： 王宁电话：021-20538888传真：021-20538999客服电话：400-820-1515网址：www.zhengtongfunds.com |
| 132 | 上海基煜基金销售有限公司 | 注册地址： 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）办公地址：上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室法定代表人： 王翔联系人： 蓝杰电话： 021-35385521传真：021-55085991客服电话：400-820-5369网址：www.jiyufund.com.cn |
| 133 | 京东肯特瑞基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157办公地址： 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座17层法定代表人： 王苏宁电话： 95118传真：010-89189566 客服热线： 95118公司网站： kenterui.jd.com |
| 134 | 上海华夏财富投资管理有限公司 | 注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层法定代表人：毛淮平联系人：仲秋玥电话：010-88066632传真：010-88066552客服电话：400-817-5666网址：www.amcfortune.com |
| 135 | 上海挖财基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层04室办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层04室法定代表人：吕柳霞联系人： 曾芸电话：021-50810687传真：021-58300279客户服务电话:021-50810673 网址: www.wacaijijin.com |
| 136 | 中民财富基金销售（上海）有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层法定代表人：弭洪军联系人：李娜电话：021-33357030传真：021-63353736客服电话：400-876-5716网址：www.cmiwm.com |
| 137 | 大连网金基金销售有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室法定代表人：樊怀东客服电话：4000-899-100网址：http://www.yibaijin.com/ |
| 138 | 一路财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市西城区广安门北滨河路2号11幢2层222办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层法定代表人：吴雪秀联系人：董宣电话：13520209651客服电话：400-001-1566网址：www.yilucaifu.com |
| 139 | 腾安基金销售（深圳）有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼法定代表人：刘明军联系人：谭广锋电话：0755-86013388转80618传真：/客服电话：95017网址：www.tenganxinxi.com |
| 140 | 北京恒宇天泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋883室办公地址：北京市东城区东滨河路乙1号航星园8号楼9层法定代表人：梁越联系人：李晨电话：15210266234传真：010-56081694客服电话：400-188-8848网址：www.1314fund.com |
| 141 | 民商基金销售（上海）有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼法定代表人：贲惠琴联系人：周宇亮电话：021-50206003客服电话：021-50206003网址：www.msftec.com |
| 142 | 北京度小满基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室法定代表人：葛新办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼机构联系人：孙博超联系人电话：010-59403028联系人传真：010-59403027客户服务电话：95055-4公司网址：www.baiyingfund.com |
| 143 | 玄元保险代理有限公司 | 注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室法定代表人： 马永谙联系人：卢亚博电话：021-50701053传真：021-50701053客服电话：400 080 8208网址：www.licaimofang.cn |
| 144 | 凤凰金信（海口）基金销售有限公司 | 注册地址：海南省海口市滨海大道32号复兴城互联网创新创业园E区4层办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院18号楼法定代表人：张旭联系人：汪莹电话：010-58160084传真：010-58160181客服电话：400-810-5919公司网址：www.fengfd.com |
| 145 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人网站列示 |

南方500C代销银行：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 代销机构名称 | 代销机构信息 |
| 1 | 中国工商银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号法定代表人：陈四清联系人：谢宇晨客服电话：95588网址：www.icbc.com.cn |
| 2 | 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：李建红联系人：季平伟客服电话：95555网址：www.cmbchina.com |
| 3 | 中信银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号办公地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼中信大厦法定代表人：李庆萍联系人：丰靖 电话：010-89937330客服电话：95558网址：http://bank.ecitic.com/ |
| 4 | 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:李博联系电话:021-52629999-218966客服电话:95561网址:www.cib.com.cn |
| 5 | 平安银行股份有限公司 | 地址：深圳市深南东路5047号法定代表人：谢永林联系人：施艺帆联系电话：021-50979384客服电话：95511-3网址:bank.pingan.com |
| 6 | 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号华普大厦办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路6号法定代表人：郭少泉联系人：徐伟静联系电话：0532-68629925客服电话：（青岛）96588；（全国）400-66-96588网址：www.qdccb.com |
| 7 | 南京银行股份有限公司 | 注册地址：南京市玄武区中山路288号办公地址：南京市玄武区中山路288号法定代表人：胡升荣联系人：赵世光联系电话：025-86775305客服电话：95302网址：www.njcb.com.cn |
| 8 | 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：李光安联系人：常志勇联系电话：0755－25188781传真：0755-25188785客服电话：4001961200网址：www.4001961200.com |
| 9 | 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：哈尔滨市道里区上江街888号法定代表人：郭志文联系人：李至北电话：0451-87792450传真：0451-87792682客服电话：95537，400-60-95537网址：www.hrbb.com.cn |
| 10 | 珠海华润银行股份有限公司 | 注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东1346号办公地址：广东省珠海市吉大九洲大道东1346号法定代表人：刘晓勇联系人：李阳电话：96588(广东省外加拨0756)传真：0客服电话：96588(广东省外加拨0756)，4008800338网址：www.crbank.com.cn |
| 11 | 江苏紫金农村商业银行股份有限公司 | 注册地址： 南京市建邺区江东中路381号办公地址： 南京市建邺区江东中路381号法定代表人： 张小军联系人： 樊林电话：025-88866344传真：025-88866502客服电话：025-96855网址：www.zjrcbank.com |
| 12 | 晋中银行股份有限公司 | 注册地址： 山西省晋中市榆次区迎宾西街65号办公地址：山西省晋中市榆次区迎宾西街65号法定代表人： 刘海滨联系人： 贺莎莎电话：18634889009客服电话：95105678网址：www.jzbank.com |
| 13 | 长沙银行股份有限公司 | 注册地址： 长沙市岳麓区滨江路53号楷林商务中心B座办公地址： 长沙市岳麓区滨江路53号楷林商务中心B座法定代表人： 朱玉国联系人： 于立娜电话：0731-89736250传真：0731-89736250客服电话：40067-96511网址：www.bankofchangsha.com |

南方500C代销券商及其他代销机构：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 代销机构名称 | 代销机构信息 |
| 1 | 华泰证券股份有限公司 | 注册地址：南京市江东中路228号法定代表人：周易联系人：庞晓芸联系电话：0755-82492193客服电话：95597网址：www.htsc.com.cn |
| 2 | 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 |
| 3 | 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 |
| 4 | 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 |
| 5 | 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：陈宇电话：021-33389888传真：021-33388224客服电话：95523或4008895523网址： www.swhysc.com |
| 6 | 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 |
| 7 | 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 |
| 8 | 华西证券股份有限公司 | 注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦法定代表人：杨炯洋联系人：谢国梅客服电话：95584网址：www.hx168.com.cn |
| 9 | 东北证券股份有限公司 | 注册地址：长春市生态大街6666号办公地址：长春市生态大街6666号法定代表人：李福春联系人:安岩岩联系电话:0431-85096517客服电话:95360网址：www.nesc.cn |
| 10 | 中信证券华南股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江西路5号501房办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔5楼法定代表人：胡伏云联系人：陈靖联系电话：020-88836999客服电话: 95396网址：www.gzs.com.cn |
| 11 | 南京证券股份有限公司 | 注册地址：南京市江东中路389号办公地址：南京市江东中路389号法定代表人：李剑锋联系人：王万君联系电话：025-58519523客服电话：95386网址：www.njzq.com.cn |
| 12 | 华宝证券有限责任公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层法定代表人：刘加海联系人：胡星煜 电话：021-20515386传真：021-68408217-7517客服电话：4008209898 网址：www.cnhbstock.com |
| 13 | 中原证券股份有限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号法定代表人：菅明军联系人：程月艳 李盼盼电话：0371-69099882传真：0371-65585899客服电话：95377网址：www.ccnew.com |
| 14 | 财达证券股份有限公司 | 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：马辉联系电话：0311-66006342客服电话： 河北省内95363；河北省外0311-95363网址：www.S10000.com |
| 15 | 德邦证券股份有限公司 | 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：武晓春联系人：李林电话：021-68761616传真：021-68767032客服电话：4008888128网址：www.tebon.com.cn |
| 16 | 万联证券股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层办公地址：广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层法定代表人：罗钦城联系人:甘蕾联系电话：020-38286026客服电话:95322网址：www.wlzq.cn |
| 17 | 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：956088网址：www.cnht.com.cn |
| 18 | 东兴证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层办公地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层法定代表人：魏庆华联系人：夏锐电话：010-66559079传真：010-66555133客服电话：95309网址：www.dxzq.net |
| 19 | 中邮证券有限责任公司 | 注册地址：陕西省西安市唐延路5号陕西邮政信息大厦9~11层办公地址：北京市东城区珠市口东大街17号法定代表人：丁奇文联系人：吉亚利电话：010-67017788-9104传真：010-67017788-9696客服电话：4008888005网址：www.cnpsec.com |
| 20 | 天风证券股份有限公司 | 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼办公地址： 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座48楼法定代表人： 余磊联系人：王雅薇电话：13971585665客服电话：4008005000或95391网址：www.tfzq.com |
| 21 | 联储证券有限责任公司 | 注册地址： 深圳市福田区深南大道南侧金地中心大厦9楼办公地址： 北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层法定代表人： 吕春卫联系人： 张婉婷电话：010-86499765传真：010-86499401客服电话：400-620-6868网址：www.lczq.com |
| 22 | 川财证券有限责任公司 | 注册地址： 中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼法定代表人：金树成 联系人：匡婷电话：028-86583053传真：028-86583002客服电话：95105118网址：www.cczq.com |
| 23 | 国开证券股份有限公司 | 注册地址： 北京市西城区阜成门外大街29号1-9层办公地址：北京市西城区阜成门外大街29号1-9层法定代表人： 张宝荣联系人：孟妍电话：010-88300999传真：010-88300999客服电话：4008895593网址：www.gkzq.com.cn |
| 24 | 东方财富证券股份有限公司 | 注册地址： 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦 法定代表人：徐伟琴 联系人： 付佳电话：021-23586603传真：021-23586860客服电话：95357网址：http://www.18.cn |
| 25 | 中信期货有限公司 | 注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层法定代表人：张皓联系人：刘宏莹电话：010-60833754传真：021-60819988客服电话：400-990-8826网址：http://www.citicsf.com |
| 26 | 阳光人寿保险股份有限公司 | 注册地址： 海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层办公地址： 北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层法定代表人： 李科联系人： 王磊电话：010-85632771传真：010-85632773客服电话：95510网址：www.sinosig.com |
| 27 | 华泰期货有限公司 | 注册地址：广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层 办公地址：广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层 法定代表人：吴祖芳 联系人： 张慧敏电话：0755-23887931传真：0755-82777490客服电话：4006280888 网址：http://www.htfc.com/ |
| 28 | 诺亚正行基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋法定代表人：汪静波联系人：李娟 电话：021-80359127传真：021-38509777客服电话：400-821-5399网址：www.noah-fund.com |
| 29 | 深圳众禄基金销售股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室法定代表人：薛峰联系人：龚江江电话：0755-33227950传真：0755-33227951客服电话：4006-788-887网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com |
| 30 | 上海好买基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室；上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼法定代表人：杨文斌联系人：张茹电话：021-20613999传真：021-68596916客服电话：400-700-9665网址：www.ehowbuy.com |
| 31 | 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人：祖国明联系人：韩爱彬客服电话：4000-766-123公司网址：www.fund123.cn |
| 32 | 上海长量基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层法定代表人：张跃伟联系人：邱燕芳电话：021-20691831传真：021-20691861客服电话：400-820-2899网址：www.erichfund.com |
| 33 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座大楼（东方财富大厦）法定代表人：其实联系人：潘世友电话：021-54509977 传真：021-64385308客服电话：95021 / 4001818188网址：www.1234567.com.cn |
| 34 | 浙江同花顺基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号 同花顺大楼4层法定代表人：吴强联系人：吴强电话：0571-88911818传真：0571-86800423客服电话：4008-773-772网址：www.5ifund.com |
| 35 | 嘉实财富管理有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期27层2716单元办公地址：北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼11层法定代表人：张峰联系人：李雯电话：010-65215588传真：010-65185678客服电话：400-021-8850网址：www.harvestwm.cn |
| 36 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦7层法定代表人：洪弘联系人：文雯电话：010-83363101传真：010-83363072客服电话：400-166-1188网址：https://8.jrj.com.cn |
| 37 | 海银基金销售有限公司 | 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼 法定代表人：巩巧丽联系人：刘晖 电话：021-60206991传真：021-80133413客服电话：400-808-1016网址：www.fundhaiyin.com |
| 38 | 北京植信基金销售有限公司 | 注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67 办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼法定代表人： 王军辉联系人：吴鹏电话：010-56075718 传真：010-67767615客服电话：4006-802-123网址：http://www.zhixin-inv.com |
| 39 | 上海大智慧基金销售有限公司 | 注册地址： 上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层办公地址：上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层法定代表人： 申健联系人：张蜓电话：021-20219988（35374）传真：021-20219923客服电话：021-20292031网址：http://www.wg.com.cn |
| 40 | 上海联泰基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层法定代表人：尹彬彬联系人：陈东电话：021-52822063传真：021-52975270客服电话：400-166-6788网址：http://www.66liantai.com |
| 41 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层法定代表人：李兴春联系人：陈孜明电话：18516109631传真：021-61101630客服电话：95733网址：www.leadfund.com.cn |
| 42 | 上海陆金所基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼法定代表人：王之光联系人：宁博宇电话：021-20665952传真：021-22066653客服电话：4008219031网址：www.lufunds.com |
| 43 | 珠海盈米基金销售有限公司 | 注册地址： 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼 1201-1203室法定代表人：肖雯联系人：邱湘湘电话：020-89629099传真：020-89629011客服电话：020-89629066网址：www.yingmi.cn |
| 44 | 上海凯石财富基金销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼法定代表人： 陈继武联系人：高皓辉电话：021-63333389-230传真：021-63333390客服电话：4006-433-389网址： www.vstonewealth.com |
| 45 | 上海万得基金销售有限公司 | 注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座办公地址： 上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼法定代表人：王廷富 联系人：徐亚丹电话：021-50712782传真：021-50710161 客服电话：400-799-1888网址：www.520fund.com.cn |
| 46 | 北京蛋卷基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室法定代表人：钟斐斐联系人：侯芳芳电话：010-61840688传真：010-84997571客服电话：4001599288网址：https://www.danjuanapp.com |
| 47 | 上海云湾基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区法定代表人： 冯轶明联系人： 王宁电话：021-20538888传真：021-20538999客服电话：400-820-1515网址：www.zhengtongfunds.com |
| 48 | 上海中正达广基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 法定代表人：黄欣 联系人：戴珉微 电话：021-33768132传真：021-33768132-802客服电话：400-6767-523网址：www.zhongzhengfund.com |
| 49 | 上海基煜基金销售有限公司 | 注册地址： 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）办公地址：上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室法定代表人： 王翔联系人： 蓝杰电话： 021-35385521传真：021-55085991客服电话：400-820-5369网址：www.jiyufund.com.cn |
| 50 | 京东肯特瑞基金销售有限公司 | 注册地址： 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157办公地址： 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座17层法定代表人： 王苏宁电话： 95118传真：010-89189566 客服热线： 95118公司网站： kenterui.jd.com |
| 51 | 上海挖财基金销售有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层04室办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层04室法定代表人：吕柳霞联系人： 曾芸电话：021-50810687传真：021-58300279客户服务电话:021-50810673 网址: www.wacaijijin.com |
| 52 | 和耕传承基金销售有限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区东风南路东康宁街北6号楼503办公地址：郑州市郑东新区东风南路东康宁街北6号楼503法定代表人：王旋联系人：胡静华电话：0371-85518396传真：0371-85518397客服电话：4000-555-671网址： http://www.hgccpb.com/ |
| 53 | 大连网金基金销售有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室法定代表人：樊怀东客服电话：4000-899-100网址：http://www.yibaijin.com/ |
| 54 | 腾安基金销售（深圳）有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼法定代表人：刘明军联系人：谭广锋电话：0755-86013388转80618传真：/客服电话：95017网址：www.tenganxinxi.com |
| 55 | 北京恒宇天泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋883室办公地址：北京市东城区东滨河路乙1号航星园8号楼9层法定代表人：梁越联系人：李晨电话：15210266234传真：010-56081694客服电话：400-188-8848网址：www.1314fund.com |
| 56 | 民商基金销售（上海）有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼法定代表人：贲惠琴联系人：周宇亮电话：021-50206003客服电话：021-50206003网址：www.msftec.com |
| 57 | 北京度小满基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室法定代表人：葛新办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼机构联系人：孙博超联系人电话：010-59403028联系人传真：010-59403027客户服务电话：95055-4公司网址：www.baiyingfund.com |
| 58 | 江苏汇林保大基金销售有限公司 | 注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室法定代表人：吴言林联系人：张竞妍电话：025-66046166-849传真: 025-56878016客户服务电话：025-66046166网址：www.huilinbd.com |
| 59 | 中国人寿保险股份有限公司 | 注册地址：中国北京市西城区金融大街16号办公地址：中国北京市西城区金融大街16号法定代表人：王滨联系人：秦泽伟电话：010-63631539客服电话：95519网址：www.e-chinalife.com |
| 60 | 玄元保险代理有限公司 | 注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室法定代表人： 马永谙联系人：卢亚博电话：021-50701053传真：021-50701053客服电话：400 080 8208网址：www.licaimofang.cn |
| 61 | 凤凰金信（海口）基金销售有限公司 | 注册地址：海南省海口市滨海大道32号复兴城互联网创新创业园E区4层办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院18号楼法定代表人：张旭联系人：汪莹电话：010-58160084传真：010-58160181客服电话：400-810-5919公司网址：www.fengfd.com |
| 62 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人网站列示 |

5.1.2 场内销售机构

场内销售机构是指具有基金代销业务资格、并经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关证券交易所会员单位，具体名单以交易所网站刊载内容为准。

5.2 登记机构

5.2.1 A类份额

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：（010）59378982

传真：（010）58598907

联系人：程爽

5.2.2C类份额

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

法定代表人：张海波

电话：（0755）82763849

传真：（0755）82763889

联系人：古和鹏

5.3 出具法律意见书的律师事务所

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

5.4 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：张振波、曹阳

§6 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2009年8月7日证监许可[2009]755号文核准募集。

本基金为交易型开放式基金。基金存续期限为不定期。募集期自2009年8月20日至2009年9月18日止，共募集3,223,217,818.45份份基金份额，募集户数为54,086户。

§7 基金合同的生效

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同的生效

本基金合同于2009年9月25日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人可以终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

§8 基金份额的上市交易

本基金上市交易的份额为A类基金份额。

一、基金上市

1、上市交易的地点

深圳证券交易所。

2、上市交易的时间

本基金合同生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

3、基金上市条件

基金合同生效后具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市：

（1）基金募集金额不低于2亿元；

（2）基金份额持有人不少于1000人；

（3）《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

本基金A类基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。本基金基金份额已于2009年11月11日开始在深圳证券交易所上市交易。

三、暂停上市交易

A类基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金A类份额的上市交易，并报中国证监会备案：

1、不再具备本章第（一）款规定的上市条件；

2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；

3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；

4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所暂停基金A类份额上市的决定之日起2个工作日内在指定媒介发布基金A类份额暂停上市公告。

当暂停上市情形消除后，基金管理人应向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金A类份额上市，并在指定媒介发布基金A类份额恢复上市公告。

四、终止上市交易

基金A类份额份额上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金A类份额的上市交易，并报中国证监会备案：

1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；

2、基金合同终止；

3、基金份额持有人大会决定终止上市；

4、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金A类份额上市的决定之日起2个工作日内发布基金A类份额终止上市公告。

五、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

§9 基金份额的申购和赎回

9.1 申购与赎回场所

本基金的A类基金份额，可以办理场内及场外的申购与赎回，C类基金份额仅能办理场外申购与赎回。

本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体销售网点和会员单位的名单将由基金管理人在招募说明书中或指定网站上列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

9.2 申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金的A类份额申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

C类基金份额开始办理申购、赎回业务的时间具体在招募说明书或其他相关公告中载明。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

本基金A类份额已于2009年11月11日开放申购和赎回业务。

9.3 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额的申购与赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资者通过场外申购、赎回应使用注册登记机构开立的开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的证券账户（人民币普通股票账户和证券投资基金账户）；

6、本基金的申购、赎回等业务，按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和注册登记机构的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司或注册登记机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

7、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

9.4 申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日(T日)，并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，基金投资者应在T+2日后到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到基金管理人或注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

基金销售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本基金合同的有关条款处理。

9.5 申购与赎回的数额限制

1、本基金首次申购和追加申购的最低金额均为1元，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。本基金单笔赎回申请不得低于1份，投资人全额赎回时不受上述限制，基金销售机构在符合上述规定的前提下，可根据自己的情况调高单笔最低赎回申请份额要求限制，具体以基金销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。

2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人有权采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

3、本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制。

4、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制，但法律法规和监管机构另有规定的除外。

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒介上公告。

9.6 申购费用和赎回费用

1、本基金A类份额场外申购时投资者可以选择支付前端申购费用或后端申购费用；场内申购时投资者只能选择支付前端申购费用。本基金C类份额不收取申购费。

本基金A类份额前端申购费率最高不高于1.2%，且随申购金额的增加而递减，后端申购费率最高不高于1.4%，且随持有时间的增加而递减，如下表所示：

A类份额前端收费：

|  |  |
| --- | --- |
| 购买金额（M） | 申购费率 |
| M＜100万 | 1.2% |
| 100万≤M＜500万 | 0.7% |
| 500万≤M＜1000万 | 0.2% |
| M≥1000万 | 每笔1000元 |

A类份额后端收费（其中1年为365天）：

|  |  |
| --- | --- |
| **持有期限**（N） | **申购费率** |
| N＜1年 | 1.4% |
| 1年≤N＜2年 | 1.2% |
| 2年≤N＜3年 | 1.0% |
| 3年≤N＜4年 | 0.7% |
| 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A类份额场内赎回费率和场外赎回费率不高于1.5%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示：

|  |  |
| --- | --- |
| 申请份额持有时间（N） | 赎回费率 |
| N＜7日 | 1.5% |
| 7日≤N＜30日 | 0.5% |
| 30日≤N＜180日 | 0.25% |
| N≥180日 | 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，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，对于持有期少于7日的基金份额所收取的赎回费全额归入基金财产；对于持有期不少于7日的基金份额所收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于25%。

本基金C类份额赎回费率最高不超过1.5%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示：

|  |  |
| --- | --- |
| 申请份额持有时间（N） | 赎回费率 |
| N＜7日 | 1.5% |
| N≥7日 | 0 |

对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定。基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

9.7 申购份额与赎回金额的计算

1、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

（1）若投资者选择A类份额缴纳前端申购费用（适用于场外、场内），则申购份额的计算公式为：

净申购金额 = 申购金额/ (1+前端申购费率)

前端申购费用=申购金额－净申购金额

申购份额 = 净申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资者投资10万元申购本基金A类份额，选择缴纳前端申购费，对应费率为1.2%，假设申购当日基金份额净值为1.0160元，若投资者选择场外申购，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝100,000/(1+1.2%)＝98,814.23元

前端申购费用＝100,000－98,814.23＝1,185.77元

申购份额 =98,814.23/1.0160 = 97,258.10份

若投资者选择场内申购，场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为97,258份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还投资者。退款金额为：

实际净申购金额=97,258×1.0160＝98,814.13元

退款金额=100,000－98,814.13－1,185.77=0.1元

（2）若投资者选择A类份额缴纳后端申购费用（适用于场外），则申购份额的计算公式为：

申购份额＝申购金额/申购当日基金份额净值

当投资者提出赎回时，后端申购费用的计算公式为：

后端申购费用＝赎回份额×申购当日基金份额净值×后端申购费率

例：某投资者投资10万元场外申购本基金A类份额，选择缴纳后端申购费，假设申购当日基金份额净值为1.0160元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.0160 =98,425.19份

（3）若投资者选择C类份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额＝申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资者投资10万元申购C类份额，假设申购当日基金C类份额份额净值为1.0160元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.0160 =98,425.19份

2、基金赎回金额的计算

（1）若投资者认/申购时选择A类份额缴纳前端认/申购费用（适用于场外、场内），则赎回金额的计算公式为：

赎回费用=赎回份额×赎回当日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值-赎回费用

例：某投资者赎回本基金10万份A类份额基金份额，持有时间为10日，赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用＝100,000×1.0160×0.5%＝508.00元

赎回金额=100,000×1.0160－508.00＝101,092.00元

（2）若投资者认/申购时选择A类份额缴纳后端认/申购费用（适用于场外），则赎回金额的计算公式为：

后端认（申）购费用＝赎回份额×认（申）购当日基金份额净值×后端认（申）购费率

赎回费用=赎回份额×赎回当日基金份额净值×赎回费率

赎回金额＝赎回份额×赎回当日基金份额净值－后端认（申）购费用－赎回费用

例：某投资者场外赎回100,050份A类份额基金份额，持有时间为10日，对应的赎回费率为0.5%，对应的后端认购费率是1.2%，假设赎回当日基金份额净值是1.0360元，则其可得到的赎回金额为：

后端认购费用=100,050×1.00×1.2%=1200.60元

赎回费用=100,050×1.0360×0.5%=518.26元

赎回金额=100,050×1.0360－1200.60－518.26=101,932.94元

例：某投资者场外赎回10万份A类份额基金份额，持有时间为10日，对应的赎回费率为0.5%，对应的后端申购费率是1.4%，假设赎回当日基金份额净值是1.0360元，申购当日基金份额净值为1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

后端申购费用=100,000×1.0160×1.4%=1,422.40元

赎回费用=100,000×1.0360×0.5%=518.00元

赎回金额=100,000×1.0360－1,422.40－518.00=101,659.60元

（3）若投资者认/申购时选择C类份额则赎回金额的计算公式为：

赎回费用=赎回份额×赎回当日基金份额净值×赎回费率

赎回金额＝赎回份额×赎回当日基金份额净值－赎回费用

例：若该投资者赎回100,050份C类份额基金份额，持有时间30日以上，对应的赎回费率为0%，假设赎回当日C类份额基金份额净值是1.0360元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用=100,050×1.0360×0%=0元

赎回金额=100,050×1.0360－0=103,651.80元

3、基金份额净值的计算

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。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。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。

4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。场外申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购涉及金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；场内申购涉及份额的计算结果采用截尾法保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

6、申购和赎回的注册与过户登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者场外赎回基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

注册登记机构可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

9.8 拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作；

2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

4、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

5、目标ETF暂停基金资产估值；

6、目标ETF暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形；

7、因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

9、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述1-8项暂停申购的情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除后，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并公告。发生上述第9项拒绝申购的情形时，被拒绝的申购款项将退还给投资者。

9.9 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；

5、目标ETF暂停基金资产估值；

6、目标ETF暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形；

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规则办理，若出现上述第3项所述情形，按基金合同的相关条款处理。

发生暂停赎回时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

9.10 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据当时基金资产组合状况和深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定，选择下述处理方式：

(1)当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行，全额赎回。

(2)当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10％的前提下，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规则，决定是否对其余赎回申请延期办理。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额50%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对于其超过基金总份额50%以上部分的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；如基金管理人只接受其基金总份额50%部分作为当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述第（1）点或第（2）点的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回而基金管理人不能按照正常赎回程序办理赎回时，基金管理人应在2日内通过至少一家中国证监会指定媒介刊登公告，并在3个交易日内通过邮寄、传真或者其他方式（包括但不限于短信、电子邮件、公告或由基金销售机构通知等方式）在3个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

连续2日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

9.11 其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生基金合同或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

9.12 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

9.13 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。本基金A类基金份额和C类基金份额之间不能互相转换。

9.14 基金的转托管

一、基金份额的登记

1、基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以通过具有代销资格的会员单位申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可以申请场外赎回。

二、系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、本基金系统内转托管按照中国证券登记结算有限公司或南方基金管理股份有限公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额不能办理系统内转托管。

三、跨系统转登记

1、跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额、场外采用后端收费模式认购/申购的A类基金份额和C类基金份额不能办理跨系统转托管。

9.15 定投计划

基金管理人已于2009年11月11日起开通原基金在部分代销机构的定期定额投资计划，相关规定详见2009年11月11日发布的《关于南方中证500指数基金（LOF）开通基金定投业务的公告》和其他有关本基金定期定额业务公告。

变更后的基金定期定额投资计划不受影响。

9.16 其他业务

注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻、质押等业务，并收取一定的手续费用。

§10 基金的投资

10.1 投资目标

本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

10.2 投资范围

本基金主要投资于中证500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（一级市场初次发行或增发）、债券、及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中投资于中证500ETF的比例不少于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可投资存托凭证。

基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。

如基金投资需要，本基金在履行适当程序后，可以投资衍生工具等其他投资品种，无需召开持有人大会审议。基金管理人将根据相关法律法规规定，对相关调整予以公告并及时更新基金法律文件。

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。

10.3 投资理念

本基金遵循指数化投资理念，通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股等，力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。

10.4 投资策略

本基金为完全被动式指数基金，以中证500ETF作为其主要投资标的。本基金并不参与中证500ETF的管理。

（一）资产配置策略

为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

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0.3%，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。

（二）目标ETF投资策略

1、特殊申购

在目标ETF基金合同生效后、开放日常申购之前，将向本基金开通特殊申购，特殊申购仅开通一日，本基金以股票或现金特殊申购目标ETF基金份额，申购价格以特殊申购日的目标ETF基金份额净值（保留到小数点后9位）为基准计算，特殊申购过程中按照中国证券登记结算有限责任公司和上海证券交易所的相关规定缴纳的费用由基金资产承担。

2 、投资组合的日常投资方式

在目标ETF上市交易、开放申购赎回后，本基金通过两种方式投资目标ETF：

（1）申购和赎回：目标ETF开放申购赎回后，根据申购赎回清单进行申购赎回。

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

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

本基金将在目标ETF上市交易、开放申购赎回3个月内，使得本基金投资目标ETF的比例满足基金合同有关投资比例的要求。

（三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全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。

本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。

（四）债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时着重考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的中央银行票据、国家债券、政策性金融债等进行配置。

（五）转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通证券出借业务对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

本基金参与转融通证券出借业务，应综合考虑市场情况，例如出借证券停牌的风险、出借指数成分股调出指数的风险；综合考虑基金持有人类型与结构，例如个人投资者占比、持有人份额集中度等因素，衡量出现大额集中赎回可能性；综合考虑基金历史申赎情况，例如大额赎回份额占总份额的比例、申赎情况与市场涨跌之间的关联等，防范大额赎回风险；综合考虑出借证券流动性情况，衡量变现难度。在分析上述因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在更新的招募说明书中体现相关调整。

10.5 投资决策依据和决策程序

（一）决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

（二）投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。

（三）投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1、研究支持：金融工程小组依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

2、投资决策：投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

3、组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

4、交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

5、投资绩效评估：金融工程小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

6、组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，紧密跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资体制和程序做出调整，并在更新的《招募说明书》中列示。

10.6 投资限制

（一）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

2、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

3、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

4、本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

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

（2）参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；

（3）最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

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

5、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

6、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

7、本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行；

8、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第1、2项外，在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第4项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（二）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖除目标ETF外的其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资；

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

10.7 标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为中证500指数。

本基金业绩比较基准：中证500指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。

如果中证500指数被停止编制及发布，或中证500指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致中证500指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准后予以公告。

10.8 风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

10.9 基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

10.10 基金的融资融券及转融通

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资和转融通证券出借业务，在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资业务以及通过证券金融公司办理转融通证券出借业务，以提高投资效率并进行风险管理，无需召开基金份额持有人大会。基金参与融资和转融通证券出借等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法、人员及系统配备、风险管理制度、出借业务的相关安排及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

未来若法律法规或监管部门允许公开募集证券投资基金开展融券业务，在履行适当程序后，本基金可以开展融券业务，本基金管理人将根据相关法律法规规定，对相关调整予以公告并及时更新基金法律文件。

10.11 目标ETF的变更

目标ETF出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将去掉关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

1、目标ETF交易方式变更；

2、目标ETF终止上市；

3、目标ETF基金合同终止。

若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。

10.12 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6月30日（未经审计）。

1 报告期末基金资产组合情况

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
| 1 | 权益投资 | 152,047,593.95 | 1.35 |
|  | 其中：股票 | 152,047,593.95 | 1.35 |
| 2 | 基金投资 | 10,318,052,550.03 | 91.64 |
| 3 | 固定收益投资 | 393,118,756.30 | 3.49 |
|  | 其中：债券 | 393,118,756.30 | 3.49 |
|  |  资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 167,975,290.11 | 1.49 |
| 8 | 其他资产 | 228,137,506.50 | 2.03 |
| 9 | 合计 | 11,259,331,696.89 | 100.00 |

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（％） |
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,090,220.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 3,520,694.80 | 0.03 |
| C | 制造业 | 86,178,647.33 | 0.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,704,322.77 | 0.03 |
| E | 建筑业 | 2,220,605.04 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | 11,607,641.70 | 0.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,905,041.49 | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | 661,322.73 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,774,580.23 | 0.14 |
| J | 金融业 | 7,185,870.56 | 0.07 |
| K | 房地产业 | 6,865,674.45 | 0.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,400,708.55 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 853,036.75 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,419,322.20 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 132,480.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,039,838.10 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,331,856.49 | 0.02 |
| S | 综合 | 1,155,730.76 | 0.01 |
|  | 合计 | 152,047,593.95 | 1.41 |

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（％） |
| 1 | 600143 | 金发科技 | 114,661 | 1,510,085.37 | 0.01 |
| 2 | 600845 | 宝信软件 | 25,502 | 1,506,658.16 | 0.01 |
| 3 | 600859 | 王 府 井 | 27,090 | 1,233,949.50 | 0.01 |
| 4 | 600415 | 小商品城 | 231,000 | 1,124,970.00 | 0.01 |
| 5 | 600201 | 生物股份 | 39,010 | 1,086,038.40 | 0.01 |
| 6 | 300253 | 卫宁健康 | 45,253 | 1,038,103.82 | 0.01 |
| 7 | 600298 | 安琪酵母 | 19,500 | 964,860.00 | 0.01 |
| 8 | 600315 | 上海家化 | 20,005 | 958,239.50 | 0.01 |
| 9 | 603517 | 绝味食品 | 13,025 | 921,388.50 | 0.01 |
| 10 | 600161 | 天坛生物 | 19,583 | 887,697.39 | 0.01 |

4 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 | 178,533,222.00 | 1.65 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 214,582,534.30 | 1.98 |
|  | 其中：政策性金融债 | 214,582,534.30 | 1.98 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,000.00 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 393,118,756.30 | 3.64 |

5 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 | 019627 | 20国债01 | 1,784,440 | 178,533,222.00 | 1.65 |
| 2 | 018007 | 国开1801 | 1,011,250 | 101,276,687.50 | 0.94 |
| 3 | 018061 | 进出1911 | 638,320 | 63,883,065.60 | 0.59 |
| 4 | 108902 | 农发1802 | 350,000 | 35,182,000.00 | 0.33 |
| 5 | 108801 | 进出1901 | 85,600 | 8,560,856.00 | 0.08 |

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。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
| 1 | 南方中证500ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理股份有限公司 | 10,318,052,550.03 | 95.45 |

10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.1 本期国债期货投资政策

无。

11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

11.3 本期国债期货投资评价

无。

12 投资组合报告附注

12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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

12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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

12.3 其他资产构成

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| 1 | 存出保证金 | 1,046,472.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | 164,248,613.98 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,468,823.03 |
| 5 | 应收申购款 | 40,773,427.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 14,600,169.41 |
| 9 | 合计 | 228,137,506.50 |

12.4 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。

12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

10.13 基金业绩

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

南方500

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 2009.9.25-2009.12.31 | 17.60% | 1.65% | 25.40% | 1.90% | -7.80% | -0.25% |
| 2010.1.1-2010.12.31 | 9.40% | 1.71% | 9.77% | 1.72% | -0.37% | -0.01% |
| 2011.1.1-2011.12.31 | -32.72% | 1.45% | -32.34% | 1.45% | -0.38% | 0.00% |
| 2012.1.1-2012.12.31 | -0.17% | 1.46% | 0.42% | 1.46% | -0.59% | 0.00% |
| 2013.1.1-2013.12.31 | 16.05% | 1.37% | 16.14% | 1.37% | -0.09% | 0.00% |
| 2014.1.1-2014.12.31 | 36.29% | 1.18% | 36.88% | 1.18% | -0.59% | 0.00% |
| 2015.1.1-2015.12.31 | 44.14% | 2.70% | 41.26% | 2.68% | 2.88% | 0.02% |
| 2016.1.1-2016.12.31 | -15.19% | 1.82% | -16.77% | 1.81% | 1.58% | 0.01% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 0.64% | 0.88% | -0.13% | 0.88% | 0.77% | 0.00% |
| 2018.1.1-2018.12.31 | -30.76% | 1.43% | -31.85% | 1.43% | 1.09% | 0.00% |
| 2019.1.1-2019.12.31 | 26.19% | 1.39% | 25.09% | 1.39% | 1.10% | 0.00% |
| 2020.1.1-2020.6.30 | 11.58% | 1.70% | 10.84% | 1.70% | 0.74% | 0.00% |
| 自基金成立起至今 | 63.93% | 1.61% | 64.98% | 1.61% | -1.05% | 0.00% |

南方500C

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 2017.2.28-2017.12.31 | -1.90% | 0.89% | -2.89% | 0.90% | 0.99% | -0.01% |
| 2018.1.1-2018.12.31 | -31.02% | 1.43% | -31.85% | 1.43% | 0.83% | 0.00% |
| 2019.1.1-2019.12.31 | 25.67% | 1.39% | 25.09% | 1.39% | 0.58% | 0.00% |
| 2020.1.1-2020.6.30 | 11.35% | 1.71% | 10.84% | 1.70% | 0.51% | 0.01% |
| 自基金成立起至今 | -5.31% | 1.35% | -8.24% | 1.35% | 2.93% | 0.00% |

§11 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的金额。

三、基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵消；不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

§12 基金资产估值

一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

三、估值对象

基金依法拥有的目标ETF 基金份额、股票、债券及其他基金资产。

四、估值方法

1、目标ETF份额的估值

本基金投资的目标ETF份额以其估值日当日基金份额净值估值。

2、股票估值方法：

（1）上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（5）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、基金参与转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规和中国证券投资基金业协会发布的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

5、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值差错处理的原则和方法

（1）当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担50%，基金托管人承担50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（4）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金应当暂停估值；

4、本基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人（封闭式基金为每周五）。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、股票指数期货合约估值方法的第（2）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

§13 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、C类基金份额的销售服务费；

4、基金合同生效后的信息披露费用；

5、基金上市费及年费

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的指数使用费；

10、基金财产拨划支付的银行费用；

11、因参与融资融券和转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；

12、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。

二、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

三、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

本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有ETF基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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－前一日所持有ETF基金份额部分的基金资产，若为负数，则E取0

基金管理费每日计提，按月支付。由基金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

本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有ETF基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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－前一日所持有ETF基金份额部分的基金资产，若为负数，则E取0

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、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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前3个工作日内从基金财产中一次性支付给各销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、上述(一)中4到12项费用由基金托管人根据其他有关法律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。

四、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的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。基金募集期内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，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

六、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

§14 基金的收益与分配

一、基金收益的构成

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

期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

二、基金收益分配原则

1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权；

2、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多6次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的10%；

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

6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

三、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

四、收益分配的时间和程序

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，在2日内在指定媒介公告。

2、在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

五、收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

§15 基金的会计与审计

一、基金的会计政策

1、基金管理人为本基金的会计责任方；

2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金合同生效所在的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人分别保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

二、基金的审计

1、基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。基金管理人应当依据有关规定在指定媒介上公告。

§16 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露，并保证基金投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

(1)招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书。

(2)基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3)托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。基金产品资料概要的正文应当包括产品概况、基金投资与净值表现、投资本基金涉及的费用、风险揭示与重要提示等中国证监会规定的披露事项，相关内容不得与基金合同、招募说明书有实质性差异。基金管理人将在《信息披露办法》实施之日起一年内，按照《信息披露办法》、《基金合同》及基金招募说明书规定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求执行。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介及基金管理人网站上公告。

5、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

6、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

本基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

8、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

(1)基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

(2)终止基金合同、基金清算；

(3)基金扩募、延长基金合同期限；

(4)转换基金运作方式；

(5)更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

(6)基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

(7)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

(8)基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

(9)基金募集期延长或提前结束募集；

(10)基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

(11)基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；

(12)涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(13) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚

(14)基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

(15)基金收益分配事项；

(16)管理费、托管费和销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17)基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；

(18)本基金开始办理申购、赎回；

(19)本基金发生巨额赎回并延期办理；

(20)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(21)本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请申请；

(22)在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(23)A类基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；

(24)基金推出新业务或服务；

(25)目标ETF变更；

(26)基金合同生效后，连续30、40、45个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5000万元的情形时；

(27)基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

9、澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

10、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

11、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

12、中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

§17 风险揭示

一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险；

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避；

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

二、管理风险

1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2、基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

三、流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。由于国内股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

1、本基金的申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作，基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

2、投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于中证500ETF、标的指数成份股、备选成份股。目标ETF已依照指数权重进行了分散投资，故本基金可通过赎回目标ETF较好地获取流动性；另外，本基金还可以在二级市场卖出目标ETF获取流动性，以上均为基金平稳运作提供了良好的基础。根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，本基金会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据当时基金资产组合状况和深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定决定全额赎回或部分延期赎回。当发生巨额赎回而基金管理人不能按照正常赎回程序办理赎回时，基金管理人应在2日内通过至少一家中国证监会指定媒介、基金管理人网站或代销机构网点刊登公告，在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案，并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额50%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对于其超过基金总份额50%以上部分的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；如基金管理人只接受其基金总份额50%部分作为当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“巨额赎回的处理方式”中第（1）点或第（2）点的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按基金合同约定的时限支付赎回款项。

四、基金交易价格与基金份额净值发生偏离的风险

本基金在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值,从而产生折价或者溢价的情况,虽然基金份额净值反映基金投资组合的资产状况,但是交易价格受到很多因素的影响,比如中国的经济情况、投资人对于中国股市的信心以及本基金的供需情况等。

五、本基金特有风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中的证券交易成本、基金管理费和托管费的存在以及其它因素，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

4、投资于目标ETF基金带来的风险

由于主要投资于中证500ETF，所以本基金会面临诸如中证500ETF的管理风险与操作风险、中证500ETF基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、中证500ETF的技术风险等风险。

5、本基金参与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在转融通业务特有风险，包括但不限于以下风险：

（1）流动性风险

面对大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现、支付赎回款项的风险；

（2）信用风险

证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；

（3）市场风险

证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的风险。

（4）操作风险

由于不完善或有问题的内部操作流程、人员违规或失误、系统故障或外部事件所导致的直接或间接损失的风险。

根据转融通证券出借业务的特点，本公司配备了风控、合规、投资、后台等专业的技术人员、升级改造了相关技术系统，制定了参与转融通证券出借业务的投资策略、搭建了健全合理的转融通业务内部控制体系，包括严密完备的管理制度、科学规范的业务控制流程、清晰明确的组织体系与职责分工、灵活有效的风险应对安排，制定或更新了《南方基金转融通证券出借业务风险管理办法》、《南方基金转融通证券出借交易操作指引》、《南方基金转融通证券出借业务投资管理制度》等风险管理制度，完善了开展转融通出借业务的相关安排，保障转融通出借业务的顺利开展。

除上述风险外，本公司参与转融通证券出借业务还应关注外部监管机构或公司要求关注的其他风险。

6、基金合同终止的风险

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人可以终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

7、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

六、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和代销机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

七、本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在以下风险：

（１）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。

（２）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

（３）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。

（４）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

（５）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

（６）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

八、其他风险

如因技术因素、人为因素、战争、自然灾害等因素而产生的风险等。

§18 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

一、基金合同的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

(1)终止基金合同；

(2)转换基金运作方式；

(3)终止基金上市交易，但因下述原因致使基金终止上市交易的无需召开基金份额持有人大会：自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形；

(4)变更基金类别；

(5)变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

(6)变更基金份额持有人大会议事程序；

(7)更换基金管理人、基金托管人；

(8)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费收费标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(9)本基金与其他基金的合并；

(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；

(3)因自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形而终止基金上市交易的；

(4)由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(5)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(6)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(7)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(8)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(9)因当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；

(10)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告。

二、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；

3、基金托管人人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；

4、相关法律法规、中国证监会及基金合同规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组

(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

2、基金财产清算程序

(1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2)对基金财产进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估价和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对清算报告进行审计；

(7)将基金清算结果报告中国证监会；

(8)公布基金清算报告；

(9)对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

§19 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者自依招募说明书、基金合同取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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

（6）出席或者委派代表出席目标ETF份额持有人大会，对目标ETF份额持有人大会审议事项行使表决权。本基金参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标ETF份额占本基金资产的比例折算；

（7）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（8）监督基金管理人的投资运作；

（9）对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（10）法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

（2）缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

（3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

（5）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

（7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）获得基金管理人报酬；

（3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（4）在符合有关法律法规交易所及登记结算结构相关业务规则和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费、管理费和销售服务费之外的费率结构和收费方式；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

（6）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

（7）自行担任基金注册登记机构，或选择、更换注册登记机构，对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查，并从注册登记机构获取基金份额持有人名册；

（8）选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（10）依法召集基金份额持有人大会；

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

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

（13）根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资融券和转融通证券出借业务；

（14）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（10）按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（15）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

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

（17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

（20）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（21）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（22）建立并保存基金份额持有人名册；

（23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（25）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

（1）获得基金托管费；

（2）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

（4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

（6）依法召集基金份额持有人大会；

（7）按规定取得基金份额持有人名册；

（8）法律法规规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（7）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（8）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于15年；

（10）按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

（13）按照规定监督基金管理人的投资运作；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

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

（18）按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（19）根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

（20）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（21）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（22）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（23）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（一）召开事由

1.当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1)终止基金合同；

(2)转换基金运作方式；

(3)终止基金上市交易，但因下述原因致使基金终止上市交易的无需召开基金份额持有人大会：自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形；

(4)变更基金类别；

(5)变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

(6)变更基金份额持有人大会议事程序；

(7)更换基金管理人、基金托管人；

(8)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费收费标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(9)本基金与其他基金的合并；

(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；

(3)因自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形而终止基金上市交易的；

(4)由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(5)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(6)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(7)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(8)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(9)因当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；

(10)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额10%以上（以上含本数，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

4、代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

(1)会议召开的时间、地点和出席方式；

(2)会议拟审议的主要事项；

(3)会议形式；

(4)议事程序；

(5)有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

(6)授权委托的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；

(7)表决方式；

(8)会务常设联系人姓名、电话；

(9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10)召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

1、会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以以召集人约定的非现场方式进行表决。

2、召开基金份额持有人大会的条件

(1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1)经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%，下同）；

2)亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在25个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

(2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2)召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，不影响表决效力；

3)本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上；

4)直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在25个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前35日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有30日的间隔期。

(3)对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

2、议事程序

(1)现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（六）决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1)一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(2)特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

（七）计票

1、现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票效力及表决效力。

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

(3)如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4)计票过程应由公证机关予以公证。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决效力。

（八）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

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

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒介公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（九）鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额直接参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标ETF基金份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标ETF后的每一参会份额和目标ETF的每一参会份额拥有平等的投票权。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权；

2、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多6次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的10%；

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

6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（三）收益分配的时间和程序

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，在2日内在指定媒介公告。

2、在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

（四）基金收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

四、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有ETF基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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－前一日所持有ETF基金份额部分的基金资产，若为负数，则E取0

基金管理费每日计提，按月支付。由基金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。

（二）基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有ETF基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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－前一日所持有ETF基金份额部分的基金资产，若为负数，则E取0

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。

（三）C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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前3个工作日内从基金财产中一次性支付给各销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于中证500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（一级市场初次发行或增发）、债券、及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中投资于中证500ETF的比例不少于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可投资存托凭证。

基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。

如基金投资需要，本基金在履行适当程序后，可以投资衍生工具等其他投资品种，无需召开持有人大会审议。基金管理人将根据相关法律法规规定，对相关调整予以公告并及时更新基金法律文件。

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。

（三）投资限制和禁止行为

一）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

2、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

3、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

4、本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

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

（2）参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；

（3）最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

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

5、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

6、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

7、本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行；

8、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第1、2项外，在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第4项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

二）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖除目标ETF外的其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资；

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

六、基金净值信息的披露方式

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

(1)终止基金合同；

(2)转换基金运作方式；

(3)终止基金上市交易，但因下述原因致使基金终止上市交易的无需召开基金份额持有人大会：自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形；

(4)变更基金类别；

(5)变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

(6)变更基金份额持有人大会议事程序；

(7)更换基金管理人、基金托管人；

(8)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费收费标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(9)本基金与其他基金的合并；

(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；

(3)因自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形而终止基金上市交易的；

(4)由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(5)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(6)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(7)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(8)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(9)因当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；

(10)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；

3、基金托管人人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；

4、相关法律法规、中国证监会及基金合同规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组

(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

2、基金财产清算程序

(1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2)对基金财产进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估价和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对清算报告进行审计；

(7)将基金清算结果报告中国证监会；

(8)公布基金清算报告；

(9)对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

九、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

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

(三)本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四)本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

§20 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：南方基金管理股份有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼

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

邮政编码：518048

法定代表人：张海波

成立日期：1998年3月6日

批准设立机关及批准设立文号：证监基字[1998]4号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币3.6172亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

（二）基金托管人

名称：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：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证 券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于中证500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中投资于中证500ETF的比例不少于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可投资存托凭证。

基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。

如基金投资需要，本基金在履行适当程序后，可以投资衍生工具等其他投资品种，无需召开持有人大会审议。基金管理人将根据相关法律法规规定，对相关调整予以公告并及时更新基金法律文件。

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

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

2、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

3、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

4、本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

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

（2）参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；

（3）最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

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

5、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

6、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

7、本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行；

8、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第1、2项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第4项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人应及时确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人并有权向中国证监会报告。

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

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、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进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3、在投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前两个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5、基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

6、基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保证基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据或者出现其他影响基金托管人履行托管人监督职责的行为，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应承担相应法律后果，包括但不限于承担基金托管人可能遭受的监管部门罚款以及基金托管人向基金份额持有人承担的赔偿。因投资流动受限证券产生的损失，除依据法律法规的规定以及基金合同的约定应当由基金份额持有人承担的之外，由基金管理人承担，基金托管人不承担上述损失。如因基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求的原因导致本基金出现风险损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。法律法规及监管机构另有规定的除外。

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 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依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

（八）基金管理人有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规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。

（九）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，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、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本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，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

6、对于因为基金认（申）购、投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集到的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。基金托管人在收到资金和股票当日出具确认文件。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

（三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

3、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

（五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算及复核程序

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

基金依法拥有的目标ETF 基金份额、股票、债券及其他基金资产。

2、估值方法

（1）目标ETF份额的估值

本基金投资的目标ETF份额以其估值日当日基金份额净值估值。

（2）股票估值方法：

1）上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（3）债券估值方法：

1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

5）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第1）－6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第1）－6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（4）基金参与转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规和中国证券投资基金业协会发布的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

（5）其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

（6）本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第3）项、债券估值方法的第7）项、股票指数期货合约估值方法的第2）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

（三）基金份额净值错误的处理方式

（1）当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.50%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后披露，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担50%，基金托管人承担50%。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（四）暂停估值与披露基金份额净值的情形

（1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2） 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

（3）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金应当暂停估值；

（4）本基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

（5）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（七）基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后5工作日内完成；基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。季度报告应在每个季度结束之日起15个工作日内编制完毕并予以公告；中期报告在上半年结束之日起两个月内编制完毕并予以公告；年度报告在每年结束之日起三个月内编制完毕并予以公告。基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

2、报表复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在3日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后20日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后30日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

（八）基金管理人应每周向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

（二）基金托管协议终止的情形

1、本基金合同终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组

(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(4)基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产清算程序

(1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2)对基金财产进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估价和变现；

(4)编制清算报告；

(5)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对清算报告进行审计；

(7)将基金清算结果报告中国证监会；

(8)公布基金清算公告；

(9)对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

§21 基金份额持有人服务

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请及时通过下述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售机构及销售机构提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

若本基金包含在中国香港特别行政区销售的H类份额，则该H类份额持有人享有的服务项目一般情况下限于客户服务中心电话服务、客户投诉及建议受理服务和网站资讯等服务。

一、基金份额持有人交易资料的发送服务

1、电子对账单

基金管理人提供场外交易电子邮件对账单、场外交易微信对账单服务，基金管理人将以电子邮件或微信服务通知形式向定制上述服务的个人投资者（本基金是否向个人投资者销售，请以本基金基金合同和招募说明书相关条款为准）定期发送对账单等相关信息，电子邮件地址不详的、微信未绑定或取消关注的除外。

2、其他渠道对账查询

注册登记机构和基金管理人不提供投资人的场内交易（本基金是否支持场内交易，请以本基金基金合同和招募说明书相关条款为准）对账单服务，投资人可到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务等渠道查询。

二、线上服务

通过基金管理人网站（www.nffund.com）、微信公众号（可搜索“南方基金”或“NF4008898899”）或APP客户端，投资人可获得如下服务：

1、账户查询服务

机构投资者通过基金管理人网站，个人投资者通过基金管理人网站、微信公众号或APP客户端，可享有场外基金交易查询、账户查询和相关基金信息查询等服务。

2、网上交易服务

机构投资者可通过基金管理人网站，个人投资者可通过基金管理人网站、微信公众号或APP客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

3、信息查询服务

投资人可以利用基金管理人网站等获取基金和基金管理人依法披露的各类信息，包括基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

4、智能客服服务（7×24小时）

投资人可通过基金管理人网站、微信公众号或APP客户端，获得业务规则、净值信息等自助咨询服务。

5、网上人工服务

投资人可通过基金管理人网站、微信公众号或APP客户端获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

三、客户服务中心电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线400-889-8899（国内免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务（7×24小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。

2、人工服务：提供每周7天，每日不少于8小时的人工服务（法定节假日除外）。投资人可以通过该热线获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

四、资讯服务

基金管理人通过电话、短信、邮件、微信等方式，为投资人提供相关资讯，包括但不限于以下类型：

1、持有产品相关的通知和资讯。

2、投资者教育资讯和相关活动。

3、符合相关法律法规要求的其他资讯。

投资人如需取消相关资讯服务，可按照资讯指引退订，或通过基金管理人客户服务中心热线400-889-8899、人工客服等人工服务方式退订。

五、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

§22 其他应披露事项

|  |  |
| --- | --- |
| 标题 | 公告日期 |
| 南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告 | 2020-09-22 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加和耕传承为销售机构的公告 | 2020-09-17 |
| 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2020年中期报告 | 2020-08-31 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加万得基金为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-08-12 |
| 南方基金管理股份有限公司关于深圳宜投基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告 | 2020-07-23 |
| 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2020年第2季度报告 | 2020-07-21 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-07-01 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加平安银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-06-15 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加申万宏源西部为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-06-04 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加申万宏源为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-06-04 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-05-22 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（华南）为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-05-06 |
| 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告 | 2020-04-30 |
| 关于南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告 | 2020-04-29 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加东兴证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-04-27 |
| 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2020年第1季度报告 | 2020-04-21 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-04-03 |
| 南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（山东）为销售机构及开通相关业务的公告 | 2020-04-02 |
| 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2019年年度报告 | 2020-03-31 |

注：其他披露事项详见基金管理人发布的相关公告

§23 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

§24 备查文件

一、中国证监会批准南方中证500指数证券投资基金（LOF）设立的文件

二、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》

三、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》

四、《南方中证500指数证券投资基金（LOF）登记结算服务协议》

五、《南方基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

六、法律意见书

七、基金管理人业务资格批件、营业执照

八、基金托管人业务资格批件、营业执照

南方基金管理股份有限公司

2020年 10月23 日