

文件 3:

## 南方保本混合型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

(2012 年第 2 号)

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

### 重要提示

本基金经中国证监会 2011 年 4 月 11 日证监许可[2011]524 号文核准募集，基金合同已于 2011 年 6 月 21 日正式生效。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者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。未持有到期，投资者赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

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。

本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 12 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日 2012 年 9 月 30 日（未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：南方基金管理有限公司

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

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：吴万善

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：鲍文革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4 号文批准，由南方证券股份有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

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

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

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

李真先生，董事，中共党员，材料工程、企业管理双学士，高级工程师。历任机械工业部科技司材料工艺处、科研管理处副主任科员、总工程师秘书、科技与质量监督司行业技术处副处长；深圳亚洲金刚石有限公司副总经理（干部交流）；深圳市投资管理公司董事局秘书处副主任、综合部副部长、部长、总裁助理兼工业一部部长、办公室主任；深圳市通产实业有限公司党委书记、董事长；深圳会展中心管理有限责任公司党委书记、总经理、董事长；现任深圳市投资控股有限公司董事、总经理、党委副书记。

余钢先生，董事，中共党员。毕业于湘潭大学英语专业，高级经济师，中共党员。历任广州军区技术局四处见习学员；广州军区技术局组织处助理翻译、中尉；广州军区情报部副连参谋、正连参谋、副营参谋；深圳市投资管理公司人事部、董办、办公室业务经理；深圳市国资委企业领导人员管理处主任科员；深圳市国资委办公室副主任、党委秘书；深圳市国资委企业领导人员管理处副处长；深圳市地铁有限公司人力资源部部长、党支部书记；深圳市地铁集团有限公司党委委员人力资源部部长、党支部书记（2009-2010年4月兼深圳通公司董事、深圳大学轨道交通学院理事会理事）；2009.09—2009.11 深圳市市委中青班培训学习；现任深圳市投资控股有限公司党委副书记、纪委书记、董事。

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

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

高良玉先生，董事，中共党员，经济学硕士，经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长。1998年加入南方基金担任副总经理、总裁，现任南方基金管理有限公司副董事长兼党委副书记、南方东英资产管理有限公司（香港）董事会主席。

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

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

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

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

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

## 2、监事会成员

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

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

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

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

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

苏民先生，职工监事，博士研究生，工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师，

华夏证券深圳分公司电脑部经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监；现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

### 3、公司高级管理人员

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

高良玉先生，董事，总裁，中共党员，经济学硕士，经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长。1998 年加入南方基金担任副总经理，现任南方基金管理有限公司副董事长、总裁兼党委副书记、南方东英资产管理有限公司（香港）董事会主席。

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

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

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司，2002 年加入南方基金，历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员，华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理、投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005 年加入南方基金，曾任督察长兼监察稽核部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委委员、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

杨小松先生，督察长，中共党员，会计学硕士，注册会计师。历任德勤国际会计师行会计专业翻译，光大银行证券部职员，证监会国际部、上市部、发行部主任科员、副处长、处长（期间曾派往美国 NASDAQ 工作），证监会上海监管局党委委员兼局长助理、副局长，证监会发行监管部副主任。2012 年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司督察长。

### 4、基金经理

孙鲁闽先生，南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003年4月加入南方基金管理有限公司，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理，2007年12月至2010年10月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2010年12月至今，任南方避险基金经理；2011年6月至今，任南方保本基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

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

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 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：蒋超良

成立日期：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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，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”。

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，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，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 146 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，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 2012 年 12 月 21 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 143 只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基

金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金剛保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债



券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金。

## 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。

### 三、相关服务机构

#### （一）销售机构

##### 1、直销机构：

南方基金管理有限公司

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

法定代表人：吴万善

电话：（0755）82763905、82763906

传真：（0755）82763900

联系人：张锐珊

##### 2、代销机构：

代销银行：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国农业银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街69号 办公地址：北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人：蒋超良 联系人：刘一宁 电话：010-85108227 传真：010-85109219 客服电话：95599 公司网站： <a href="http://www.abchina.com">www.abchina.com</a>
2	中国工商银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人：姜建清 联系人：陶仲伟 联系电话：010-66107900 客服电话：95588 公司网站： <a href="http://www.icbc.com.cn">www.icbc.com.cn</a>
3	中国建设银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街25号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人：王洪章 电话：010-66275654 传真：010-66275654 联系人：何奕 客服电话：95533 网址： <a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>
4	中国银行股份有限公司	地址：北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人：肖钢

		联系电话：010-66594905 客服电话：95566 公司网站：www.boc.cn
5	交通银行股份有限公司	办公地址：上海市银城中路 188 号 法定代表人：胡怀邦 联系人：陈铭铭 联系电话：021-58781234 客服电话：95559 公司网站：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：傅育宁 联系人：邓炯鹏 客服电话：95555 公司网站：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：李国华 客户服务电话：95580 联系人：陈春林 传真：（010）68858117 公司网址：www.psbc.com
8	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号 办公地址：上海市中山东一路 12 号 法定代表人：吉晓辉 联系人：倪苏云、虞谷云 联系电话：021-61618888 客服电话：95528 公司网站：www.spdb.com.cn
9	中信银行股份有限公司	注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 法定代表人：田国立 联系人：郭伟 电话：010-65557048 客服电话：95558 网址：http://bank.ecitic.com/
10	广发银行股份有限公司	注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：董建岳 联系电话：0571-96000888，020-38322222 客服电话：400-830-8003 公司网站：www.gdb.com.cn

11	中国民生银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人：董文标 联系人：董云巍 电话：010-57092615 传真：010-57092611 客服电话：95568 网址：www.cmbc.com.cn
12	中国光大银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦 办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心 法定代表人：唐双宁 联系人：朱红 电话：010-63636153 传真：010-63636157 客服电话：95595 网址：www.cebbank.com
13	兴业银行股份有限公司	注册地址：福州市湖东路154号 办公地址：福州市湖东路154号 法定代表人：高建平 联系人：刘玲 联系电话：021-52629999 客服电话：95561 公司网站：www.cib.com.cn
14	平安银行股份有限公司	地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦 法定代表人：肖遂宁 联系人：张青 联系电话：0755-22166118 客服电话：95501/95511-3 公司网站：www.bankpingan.com
15	杭州银行股份有限公司	办公地址：杭州庆春路46号 法定代表人：吴太普 联系人：江波 联系电话：0571-85108309 客服电话：0571-96523、4008888508 公司网站：www.hzbank.com.cn
16	上海银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路168号 办公地址：上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人：范一飞 联系人：龚厚红 联系电话：021-68475504 客服电话：021-962888 公司网站：www.bankofshanghai.com

17	北京银行股份有限公司	北京银行股份有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号 法定代表人：闫冰竹 联系人：谢小华 电话：010-66223587 传真：010-66226045 客户服务电话：95526 公司网站：www.bankofbeijing.com.cn
18	北京农村商业银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融街 9 号 办公地址：北京市西城区金融大街 9 号金融街中心 B 座 法定代表人：乔瑞 联系人：王薇娜 电话：010-63229475 传真：010-63229478 客服电话：96198；400-88-96198；400-66-96198 网址：www.bjrcb.com
19	烟台银行股份有限公司	注册地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号 办公地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号 法定代表人：叶文君 联系人：王淑华 电话：0535-6699660 传真：0535-6699884 客服热线：4008-311-777 公司网址：http://www.yantaibank.net/
20	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼 办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼 法定代表人：胡平西 联系人：吴海平 联系电话：021-38576977 客服电话：021-962999 公司网站：www.srcb.com
21	江苏银行股份有限公司	注册地址：南京市洪武北路 55 号 办公地址：南京市洪武北路 55 号 法定代表人：黄志伟 联系人：田春慧 电话：025-58587018 客服电话：96098，400-8696-098 公司网站：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 法定代表人：廖玉林 联系人：巫渝峰 联系电话：0769-22119061 客服电话：4001196228 公司网站：www.dongguanbank.cn
23	华夏银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 法定代表人：吴建 联系人：李慧 客服电话：95577 公司网站：www.hxb.com.cn
24	青岛银行股份有限公司	注册地址：山东省青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦 办公地址：山东省青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦 法定代表人：郭少泉 客服电话：（青岛）96588，（全国）400-66-96588 公司网站：www.qdccb.com
25	宁波银行股份有限公司	注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 法定代表人：陆华裕 联系人：胡技勋 客服电话：96528，上海、北京地区 962528 公司网站：www.nbcb.com.cn
26	南京银行股份有限公司	注册地址：南京市白下区淮海路 50 号 办公地址：南京市玄武区中山路 288 号 法定代表人：林复 联系人：翁俊 联系电话：025-84544021 客服电话：400-88-96400 公司网站：www.njcb.com.cn
27	临商银行股份有限公司	注册地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号 办公地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号 法定代表人：王傢玉 联系人：寇廷柱 联系电话：0539-8304657 客服电话：400-699-6588 公司网站：www.lsbchina.com

28	汉口银行股份有限公司	<p>注册地址：江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦          办公地址：江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦          法定代表人：陈新民          联系人：王磊          联系方式 027-82656867          客服电话：96558（武汉）、40060-96558（全国）          公司网站：<a href="http://www.hkbchina.com">http://www.hkbchina.com</a></p>
29	江苏张家港农村商业银行股份有限公司	<p>注册地址：张家港市杨舍镇人民中路 66 号          办公地址：张家港市杨舍镇人民中路 66 号          法定代表人：王自忠          联系人：姚珍珠          联系电话：0512-56968257          客服电话：0512-96065          公司网站：<a href="http://www.zrcbank.com">www.zrcbank.com</a></p>
30	浙商银行股份有限公司	<p>注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号          办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号          法定代表人：张达洋          联系人：毛真海          联系电话：0571-87659546          客服电话：95527          公司网站：<a href="http://www.czbank.com">www.czbank.com</a></p>
31	温州银行股份有限公司	<p>注册地址：温州市车站大道 196 号          办公地址：温州市车站大道 196 号          法定代表人：邢增福          联系人：林波          联系电话：0577-88990082          客服电话：0577-96699          公司网站：<a href="http://www.wzbank.cn">www.wzbank.cn</a></p>
32	重庆银行股份有限公司	<p>注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号          办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号          法定代表人：马千真          联系人：孔文超          电话：023-6379937913896198104          传真：023-63792412          客服电话：400-70-96899          网址：<a href="http://www.cqcbank.com">www.cqcbank.com</a></p>

33	深圳农村商业银行股份有限公司	注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 法定代表人：李伟 联系人变更为：宋永成 王璇 联系电话：0755-25188266、0755-25188269 传真：0755-25188785 客服电话：4001961200 公司网址：www.4001961200.com
34	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址：东莞市南城路 2 号 办公地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦 法定代表人：何沛良 联系人：何茂才 电话：0769-22321089 传真：0769-22320896 客服电话：0769-961122 网址：www.drcbank.com
35	哈尔滨银行股份有限公司	注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 法定代表人：郭志文 联系人：武艳凤 电话：0451-86779018 传真：0451-86779218 客服电话：95537，400-60-95537 网址：www.hrbb.com.cn
36	乌鲁木齐市商业银行股份有限公司	注册地址：乌鲁木齐市新华北路 8 号 办公地址：乌鲁木齐市新华北路 8 号 法定代表人：农惠臣 联系人：菅焯 电话：0991-8824667 传真：0991-8824667 客服电话：0991-96518 网址：www.uccb.com.cn
37	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号 办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号 法定代表人：刘宝凤 联系人：王宏 电话：022-58316666 传真：022-58316569 客服电话：400888811 网址：www.cbhb.com.cn



38	广州银行股份有限公司	注册地址：广州市广州大道北 195 号 办公地址：广州市广州大道北 195 号 法定代表人：姚建军 联系人：张扬眉 电话：020-37598442 传真：020-37590726 客服电话：020-96699 网址：www.gzcb.com.cn
39	河北银行股份有限公司	注册地址：石家庄市平安北大街 28 号 办公地址：石家庄市平安北大街 28 号 法定代表人：乔志强 联系人：王栋 电话：0311-88627522 传真：0311-88627027 客服电话：400-612-9999 网址：www.hebbank.com
40	大连银行股份有限公司	注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼 办公地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 9 楼 法定代表人：陈占维 联系人：李格格 电话：0411-82311604 传真：0411-82311420 客服电话：400-664-0099 网址：www.bankofd1.com
41	徽商银行股份有限公司	注册地址：安徽合肥 办公地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座 法定代表人：王晓昕 联系人：叶卓伟 电话：0551-2667635 传真：0551-2667684 客服电话：4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内) 网址：www.hsbank.com.cn
42	佛山顺德农村商业银行股份有限公司	注册地址：广东省佛山市顺德区大良新城区拥翠路 2 号顺银大厦 办公地址：广东省佛山市顺德区大良新城区拥翠路 2 号顺银大厦 法定代表人：吴海恒 联系人：黄永光 电话：0757-22385849 传真：0757-22388235 客服电话：0757-22223388

		网址: <a href="http://www.sdebank.com">www.sdebank.com</a>
43	天津银行股份有限公司	注册地址: 天津市河西区友谊路 15 号 办公地址: 天津市河西区友谊路 15 号 法定代表人: 王金龙 联系人: 杨森 电话: 022-28405330 传真: 022-28405631 客服电话: 4006-960296 网址: <a href="http://www.bank-of-tianjin.com">www.bank-of-tianjin.com</a>
44	重庆农村商业银行股份有限公司	注册地址: 重庆市江北区洋河东路 10 号 办公地址: 重庆市江北区洋河东路 10 号 法定代表人: 刘建忠 联系人: 陈曦 电话: 023-67637912 传真: 023-67637909 客服电话: 023-966866 网址: <a href="http://www.cqrcb.com">www.cqrcb.com</a>
45	金华银行股份有限公司	注册地址: 浙江省金华市光南路 668 号 办公地址: 浙江省金华市光南路 668 号 法定代表人: 徐雅清 联系人: 徐晓峰 电话: 0579-83207775 传真: 0579-82178321 客服电话: 400-711-6668 网址: <a href="http://www.jhccb.com.cn">www.jhccb.com.cn</a>
46	包商银行股份有限公司	注册地址: 包头市青山区钢铁大街 6 号 办公地址: 内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号 法定代表人: 李镇西 联系人: 刘芳 电话: 0472-5109729 传真: 0472-5109729 客服电话: 96016 网址: <a href="http://www.bsb.com.cn/">http://www.bsb.com.cn/</a>
47	广州农村商业银行股份有限公司	注册地址: 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 办公地址: 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 法定代表人: 黄子励 联系人: 邝倩玲 电话: 020-22389200 传真: 020-22389031 客服电话: 961111 网址: <a href="http://www.grcbank.com">www.grcbank.com</a>

代销券商和其他代销机构:

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：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 法定代表人：吴万善 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 公司网站： <a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a>
2	兴业证券股份有限公司	注册地址：福州市湖东路 268 号 办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层 法定代表人：兰荣 联系人：谢高得 联系电话：021-38565785 客服电话：95562 公司网站： <a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a>
3	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人：何如 联系人：齐晓燕 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952 客服电话：95536 网址： <a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
4	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 法定代表人：陈有安 联系人：田薇 联系电话：010-66568430 客服电话：4008-888-888 公司网站： <a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a>
5	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：万建华 电话：021-38676666 客服电话：4008888666 联系人：芮敏祺 公司网站： <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>
6	齐鲁证券有限公司	注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

		办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 法定代表人：李玮 联系人：吴阳 电话：0531-68889155 传真：0531-68889752 客服电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn
7	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市淮海中路 98 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：王开国 电话：021-23219000 传真：021-23219100 联系人：李笑鸣 客服电话：95553 公司网址：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：北京市朝阳区门内大街 188 号 法定代表人：王常青 联系人：权唐 联系电话：010-85130588 客服电话：4008888108 公司网站：www.csc108.com
9	广发证券股份有限公司	注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房） 办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄岚 统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点 公司网站：广发证券网 <a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a>
10	长城证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦 14、16、17 层 办公地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦 14、16、17 层 法定代表人：黄耀华 联系人：刘阳 联系电话：0755-83516289 客服电话：0755-33680000 4006666888 公司网站：www.cgws.com

11	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层 法定代表人：宫少林 联系人：林生迎 联系电话：0755-82943666 客服电话：95565、4008888111 公司网站：www.newone.com.cn
12	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 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：王东明 联系人：陈忠 电话：010-60838888 传真：010-60833739 客服电话：95558 公司网站：www.citics.com
13	申银万国证券股份有限公司	注册地址：上海市常熟路 171 号 办公地址：上海市常熟路 171 号 法定代表人：储晓明 联系人：曹晔 电话：021-54033888 传真：021-54038844 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.sywg.com
14	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号 办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 法定代表人：徐浩明 联系人：刘晨 联系电话：021-22169999 客服电话：10108998，95525 公司网站：www.ebscn.com
15	中国中投证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元 办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层 法定代表人：龙增来 联系人：刘毅 联系电话：0755-82023442 传真 0755-82026539 客服电话：400-600-8008、95532 公司网站：www.china-invs.cn

16	宏源证券股份有限公司	<p>注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号          办公地址:北京市西城区太平桥大街 19 号          法定代表人:冯戎          联系人:李巍          联系电话:010-88085858          客服电话:4008-000-562          公司网站:www.hysec.com</p>
17	湘财证券有限责任公司	<p>办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志          商务中心 A 栋 11 层          法定代表人:林俊波          联系人:钟康莺          联系电话:021-68634518          客服电话:400-888-1551          公司网站:www.xcsc.com</p>
18	中信证券(浙江)有限责任公司	<p>注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫          大厦主楼 19、20 层          办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫          大厦主楼 19、20 层          法人代表:沈强          邮政编码:310052          联系人:周妍          联系电话:0571-86078823          公司网站:www.bigsun.com.cn          客户服务中心电话:0571-96598</p>
19	安信证券股份有限公司	<p>注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35          层、28 层 A02 单元          办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35          层、28 层 A02 单元          深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层          法定代表人:牛冠兴          联系人:陈剑虹          联系电话:0755-82825551          客服电话:4008001001          公司网站:www.essence.com.cn</p>
20	中信万通证券有限责任公司	<p>注册地址:青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15          层(1507-1510 室)          办公地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融          广场 20 层          法定代表人:张智河          联系人:吴忠超          联系电话:0532-85022326          客服电话:0532-96577          公司网站:www.zxwt.com.cn</p>

21	中银国际证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F 法定代表人：许刚 联系人：李丹 联系电话：021-20328216 公司网站：www.bocichina.com
22	信达证券股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人：高冠江 联系人：唐静 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：400-800-8899 公司网址：www.cindasc.com
23	民生证券股份有限公司	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 16-18 层 法定代表人：余政 联系人：赵明 联系电话：010-85127622 客服电话：4006198888 公司网站：www.msizq.com
24	东方证券股份有限公司	注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层 办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层 法定代表人：潘鑫军 联系人：吴宇 联系电话：021-63325888 客服电话：95503 公司网站：www.dfzq.com.cn
25	华融证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层、5 层 法定代表人：宋德清 联系人：陶颖 联系电话：010-58568040 客服电话：010-58568118 公司网站：www.hrsec.com.cn

26	华西证券有限责任公司	注册地址:四川省成都市陕西街 239 号华西证券大厦 办公地址:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼(深圳总部) 法定代表人:杨炯洋 联系人:金达勇 联系电话:0755-83025723 客服电话:4008888818 公司网站:www.hx168.com.cn
27	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 法定代表人:胡运钊 客户服务热线:95579 或 4008-888-999 联系人:李良 电话:027-65799999 传真:027-85481900 长江证券客户服务网站:www.95579.com
28	东北证券股份有限公司	注册地址:长春市自由大路 1138 号 办公地址:长春市自由大路 1138 号 法定代表人:矫正中 联系人:安岩岩 联系电话:0431-85096517 客服电话:4006000686, 0431-85096733 公司网站:www.nesc.cn
29	上海证券有限责任公司	注册地址:上海市西藏中路 336 号 法定代表人:郁忠民 联系电话:021-53519888 联系人:张瑾 公司网站:www.shzq.com 客服电话:4008918918, 021-962518
30	江海证券有限公司	注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 法定代表人:孙名扬 联系人:张宇宏 电话:0451-82336863 传真:0451-82287211 客服电话:400-666-2288 网址:www.jhzq.com.cn
31	国联证券股份有限公司	注册地址:江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层 办公地址:江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 法定代表人:雷建辉 联系人:沈刚 联系电话:0510-82831662 客服电话:95570



		公司网站:www. glsc. com. cn
32	东莞证券有限责任公司	注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼 办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼 联系人:苏卓仁 联系电话:0769-22112062 公司网站:www. dgzq. com. cn
33	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址:天津市南开区宾水西道8号 法定代表人:杜庆平 联系人:王兆权 电话:022-28451861 传真:022-28451892 客服电话:400-651-5988 网址:www. bhzq. com
34	平安证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼 办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼 法定代表人:杨宇翔 联系人:郑舒丽 联系电话:0755-22626391 客服电话:95511-8 公司网站: http://www. pingan. com
35	国都证券有限责任公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 法定代表人:常喆 联系人:黄静 电话:010-84183333 传真:010-84183311-3389 客服电话:400-818-8118 网址:www. guodu. com
36	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区翠园路181号 办公地址:苏州工业园区翠园路181号 法定代表人:吴永敏 联系人:方晓丹 电话:0512-65581136 传真:0512-65588021 客服电话:4008601555

		网址： <a href="http://www.dwjq.com.cn/">http://www.dwjq.com.cn/</a>
37	广州证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 法定代表人：刘东 联系人：林洁茹 联系电话：020-88836999 客服电话：020-961303 公司网站： <a href="http://www.gzs.com.cn">www.gzs.com.cn</a>
38	南京证券股份有限公司	注册地址：江苏省南京市大钟亭8号 法定代表人：张华东 联系人：李铮 联系电话：025-83364032 公司网站： <a href="http://www.njzq.com.cn">www.njzq.com.cn</a>
39	华安证券有限责任公司	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：李工 联系人：甘霖 联系电话：0551-5161821 客服电话：96518，4008096518 公司网站： <a href="http://www.hazq.com">www.hazq.com</a>
40	浙商证券股份有限公司	办公地址：杭州杭大路1号黄龙世纪广场A6-7楼 法定代表人：吴承根 联系人：李凌芳 电话：021-64718888-1801 传真：021-64713795 客服电话：0571-967777 网址： <a href="http://www.stocke.com.cn">www.stocke.com.cn</a>
41	华宝证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼 法定代表人：陈林 联系人：宋歌 联系电话：021-68777222 客服电话：021-38929908 公司网站： <a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>

42	山西证券股份有限公司	<p>注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼          办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼          法定代表人：侯巍          联系人：郭熠          联系电话：0351—8686659          客服电话：400-666-1618          公司网站：www.i618.com.cn</p>
43	第一创业证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层          办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层          法定代表人：刘学民          联系人：崔国良          联系电话：0755-25832852          公司网站：www.fcsc.com</p>
44	华福证券有限责任公司	<p>注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层          办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层          法定代表人：黄金琳          联系人：张腾          电话：0591-87383623          传真：0591-87383610          客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）          网址：公司网址：www.hfzq.com.cn</p>
45	中山证券有限责任公司	<p>注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 29 层          办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 29 层          法定代表人：吴永良          联系人：李珍          联系电话：0755-82570586          客服电话：4001022011          公司网站：http://www.zszq.com</p>
46	中原证券股份有限公司	<p>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：石保上          联系人：程月艳、耿铭          联系电话：0371—65585670          客服电话：967218、400-813-9666          公司网站：www.ccnew.com</p>

47	西南证券股份有限公司	<p>注册地址：重庆市江北区桥北苑8号          办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦          法定代表人：余维佳          联系人：张煜          电话：023-63786141          传真：023-63786212          客服电话：4008-096-096          网址：www.swsc.com.cn</p>
48	财达证券有限责任公司	<p>注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层          办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层          法定代表人：翟建强          联系人：陈丽君          联系电话：0311-66006219          客服电话：4006128888          公司网站：www.S10000.com</p>
49	德邦证券有限责任公司	<p>注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼          办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼          法定代表人：姚文平          联系人：叶蕾          电话：021-68761616          传真：021-68767032          客服电话：4008888128          网址：www.tebon.com.cn</p>
50	中航证券有限公司	<p>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：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          法定代表人：杜航          联系人：戴蕾          电话：0791-86768681          传真：0791-86770178          客服电话：400-8866-567          网址：http://www.avicsec.com/</p>
51	国元证券股份有限公司	<p>注册地址：安徽省合肥市寿春路179号          办公地址：合肥市花园街花园宾馆14楼          法定代表人：蔡咏          联系电话：0551-2634400          客服电话：全国统一热线95578，4008888777，安徽省内热线96888          公司网站：www.gyzq.com.cn</p>

52	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 办公地址:江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 法定代表人:曾小普 联系人:徐美云 联系电话:0791-86285337 公司网站:www.gsstock.com
53	中国国际金融有限公司	注册地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 办公地址:北京市建国门外甲 6 号 SK 大厦 法定代表人:李剑阁 联系人:马强 联系电话:010-85679888 客服电话:(010)85679238(010)85679169 公司网站:www.ciccs.com.cn
54	大同证券经纪有限责任公司	注册地址:山西省大同市大北街 13 号 办公地址:山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人:董祥 联系人:薛津 电话:0351-4130322 传真:0351-4130322 客服电话:4007121212 网址:http://www.dtsbc.com.cn
55	方正证券股份有限公司	注册地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22—24 层 办公地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22—24 层 法定代表人:雷杰 联系人:彭博 联系电话:0731-85832343 客服电话:95571 公司网站:www.foundersc.com
56	财通证券有限责任公司	注册地址:杭大路 15 号嘉华国际商务中心 办公地址:杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 1602 室 法定代表人:沈继宁 联系人:徐轶青 联系电话:0571-87822359 客服电话 96336 (浙江), 40086-96336 (全国) 公司网站:www.ctsec.com

57	西部证券股份有限公司	<p>注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层          办公地址：陕西省西安市西五路 26 号海惠大厦 422 室          法定代表人：刘建武          联系人：冯萍          电话：029-87416787          传真：029-87417012          客服电话：95582          网址：<a href="http://www.westsecu.com/">http://www.westsecu.com/</a></p>
58	新时代证券有限责任公司	<p>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：刘汝军          联系人：孙恺          联系电话：010-83561149          客服电话：4006989898          公司网站：<a href="http://www.xsdzq.cn">www.xsdzq.cn</a></p>
59	瑞银证券有限责任公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层          办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层          法定代表人：刘弘          联系人：牟冲          联系电话：010-5832 8112          客服电话：400-887-8827          公司网站：<a href="http://www.ubssecurities.com">www.ubssecurities.com</a></p>
60	金元证券股份有限公司	<p>注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼          办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层          法定代表人：陆涛          联系人：许方迪          联系电话：0755- 21517910          客服电话：4008-888-228          公司网站：<a href="http://www.jyzq.com.cn">www.jyzq.com.cn</a></p>
61	万联证券有限责任公司	<p>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 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层          法定代表人：张建军          联系人：罗创斌          联系电话：020-38286651          客服电话：400-8888-133</p>

		公司网站: <a href="http://www.wlzq.com.cn">www.wlzq.com.cn</a>
62	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: 刘一宏 联系电话: 028-86690070 传真: 028-86690126 客服电话: 4006600109 网址: <a href="http://www.gjzq.com.cn">www.gjzq.com.cn</a>
63	财富证券有限责任公司	注册地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 办公地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼 法定代表人: 周晖 联系人: 郭磊 客服电话: 0731-84403333 公司网站: <a href="http://www.cfzq.com">www.cfzq.com</a>
64	恒泰证券股份有限公司	注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号 办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号 法定代表人: 庞介民 联系人: 王旭华 联系电话: 0471-4972343 网址: <a href="http://www.cnht.com.cn">www.cnht.com.cn</a>
65	华龙证券有限责任公司	注册地址: 兰州市城关区静宁路 308 号 办公地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 4 楼 法定代表人: 李晓安 联系人: 李昕田 电话: 0931-4890619 传真: 0931-4890628 客服电话: 4006-89-8888 网址: <a href="http://www.hlzqgs.com">www.hlzqgs.com</a>
66	华鑫证券有限责任公司	注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元 办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元 法定代表人: 洪家新 联系人: 陈敏 电话: 0755-82083788 传真: 0755-82083408 客服电话: 021-32109999, 029-68918888 网址: <a href="http://www.cfsc.com.cn">www.cfsc.com.cn</a>

67	日信证券有限责任公司	<p>注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路 18 号          办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西座 11 层          法定代表人：孔佑杰          联系人：文思婷          联系电话：010-83991737          公司网站：www.rxzq.com.cn</p>
68	英大证券有限责任公司	<p>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：赵文安          联系人：吴尔晖          联系电话：0755-83007159          客服电话：4000-188-688          公司网站：www.ydsc.com.cn</p>
69	中天证券有限责任公司	<p>注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲          办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲          法定代表人：李学琦          联系人：袁劲松          联系电话：024-86268007          客服电话：4006180315          公司网站：www.stockren.com</p>
70	五矿证券有限公司	<p>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：张永衡          联系人：赖君伟          电话：0755-23902400          传真：0755-82545500          客服电话：40018-40028          网址：www.wkzq.com.cn</p>
71	大通证券股份有限公司	<p>注册地址：大连市中山区人民路 24 号          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：张智河          联系人：谢立军          电话：0411-39673202          传真：0411-39673219          客服电话：4008-169-169          网址：www.daton.com.cn</p>



72	天相投资顾问有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701          办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层          法定代表人：林义相          联系人：林爽          客服电话：010-66045678          传真：010-66045527          公司网址：<a href="http://www.txsec.com">http://www.txsec.com</a>          公司基金网网址：<a href="http://www.jjm.com.cn">www.jjm.com.cn</a></p>
73	诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	<p>注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室          办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室          法定代表人：汪静波          联系人：方成          电话：021-38602377          传真：021-38509777          客服电话：400-821-5399          网址：<a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a></p>
74	深圳众禄基金销售有限公司	<p>注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元          办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元          法定代表人：薛峰          联系人：汤素娅          电话：0755-33227950          传真：0755-82080798          客服电话：4006-788-887          网址：<a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a> 及 <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a></p>
75	上海好买基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室          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          法定代表人：杨文斌          联系人：张茹          电话：021-58870011          传真：021-68596916          客服电话：400-700-9665          网址：<a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a></p>

76	杭州数米基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号 办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼 法定代表人：陈柏青 联系人：周熾旻 电话：0571-28829790，021-60897869 传真：0571-26698533 客服电话：4000-766-123 网址：http://www.fund123.cn/
77	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 法定代表人：张跃伟 联系人：沈雯斌 电话：021-58788678-8201 传真：021-58787698 客服电话：400-089-1289 网址：www.erichfund.com
78	上海天天基金销售有限公司	全称：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：上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座9楼 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：021-54509998-7019 传真：021-64385308 客服电话：400-1818188 网址：www.1234567.com.cn
79	其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。	

## （二）注册登记机构

南方基金管理有限公司

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

法定代表人：吴万善

电话：(0755) 82763849

传真：(0755) 82763868

联系人：古和鹏

## （三）律师事务所

名称：广东华瀚律师事务所

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

负责人：李兆良

电话：(0755)82687860

传真：(0755)82687861

经办律师：杨忠、戴瑞冬

#### （四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：陈熹

经办会计师：薛竞、陈熹

#### 四、基金名称

南方保本混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金按照恒定比例投资组合保险机制进行资产配置，在确保保本到期时本金安全的基础上，力争基金资产的稳定增值。

#### 七、基金的投资范围

本基金可以投资于股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对安全资产（包括债券、货币市场工具等固定收益资产）和风险资产（股票、权证等权益资产）的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。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。

## 八、投资策略

本基金采用恒定比例投资组合保险策略 (Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI) 来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险策略不仅能从投资组合资产配置层面上使基金保本到期日基金净值低于本金的概率最小化, 而且还能在一定程度上使保本基金受益于股票市场在中长期内整体性上涨的特点。

CPPI 是国际通行的一种投资组合保险策略, 它主要是通过数量分析, 根据市场的波动来调整、修正风险资产的可放大倍数 (风险乘数), 以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值, 从而达到对投资组合保值增值的目的。在基金资产可放大倍数的管理上, 基金管理人的金融工程团队在定量分析的基础上, 根据 CPPI 数理机制、历史模拟和目前市场状况定期出具保本基金资产配置建议报告, 给出放大倍数的合理上限的建议, 供基金管理人投资决策委员会和基金经理作为基金资产配置的参考。

CPPI 的投资步骤可分为:

第一步, 基金管理人金融工程团队基于 CPPI 策略计算防守垫大小, 根据对市场波幅的历史数据和对未来的展望, 给出最大放大倍数, 并形成相应的报告提交给投资决策委员会。

第二步, 投资决策委员会根据金融工程报告, 确定股票投资比例上限, 下达给基金经理。

第三步, 基金经理在投资决策委员会所确定的股票投资比例上限之内进行股票和债券的组合管理。

假设在调整时刻  $t$  资产总值和底值分别为  $A_t$  和  $F_t$ , 那么在  $t + \Delta t$  时刻组合可投资于风险资产的值为  $E_{t+\Delta t} = m(A_t - F_t)$ ,  $\Delta t$  为调整所需要的交易时间, 与整个投资期相比是一个很小的量。

根据 CPPI, 该保本策略成功的充分必要条件为:

风险资产在调整点之间的损失金额  $\leq$  防守垫 - 价值底线在调整点之间的增加额

防守垫 = 风险资产投资额  $\div$  放大倍数

等价于: 风险资产在调整点之间下跌比例  $\leq 1/\text{放大倍数 } m$

根据 CPPI 进行资产配置是一个动态调整的过程, 在投资的过程中, 设定一系列的调整点来调整资产配置比例来达到保本的目的。在基金资产可放大倍数的管理上, 基金管理人的金融工程团队在定量分析的基础上, 根据 CPPI 数理机制、历史模拟和目前市场状况定期出

具保本基金资产配置建议报告，给出放大倍数的合理上限的建议，供基金管理人投资决策委员会和基金经理作为基金资产配置的参考。

举例说明 CPPI 策略：

假设期初投资 100 万元于股票和债券，投资期限为三年，放大倍数选为 3。债券三年预期收益率为 10%。

根据股票资产投资金额计算公式（以下简称“股票资产计算公式”）：

$$\left(1 - \frac{1}{\text{放大倍数}}\right) \times \text{股票资产} + (\text{总资产} - \text{股票资产}) \times (1 + \text{债券预期收益率}) = 100 \text{ 万元}$$

可计算得出期初投资于股票资产的金额为：23.08 万元（保留至小数点后 2 位）。

因此，投资于债券资产的金额为：100-23.08=76.92 万元。

a、运作一段时间后，在 T1 时刻，假设股票资产上涨 10%，而债券资产在此期间的投资收益为 1%，预期至保本期到期时的收益率为 9%。

则 T1 基金总资产为：23.08 × (1+10%) + 76.92 × (1+1%) = 103.08 万元。

根据股票资产计算公式，可计算得出 T1 时刻可投资于股票资产的金额为：29.19 万元。

可投资于债券资产的金额为：103.08-29.19=73.89 万元。

故在 T1 时刻将 29.19 万元投资于股票，将 73.89 万元投资于债券，由于此时基金拥有的债券市值为 77.69 万元（76.92 × (1+1%) = 77.69），故基金管理人卖出 3.80 万元债券（77.69-73.89=3.80），同时买入 3.80 万元股票。

b、继续运作一段时间后，在 T2 时刻，假设股票资产下跌 5%，而债券资产在此期间的投资收益为 1%，预期至保本期到期时的收益率为 8%。

则此时基金总资产为：29.19 × (1-5%) + 73.89 × (1+1%) = 102.36 万元。

根据股票资产计算公式，可计算得出 T2 时刻可投资于股票资产的金额为：25.52 万元。

可投资于债券资产的金额为：102.36-25.52=76.84 万元。

故在 T2 时刻将 25.52 万元投资于股票，将 76.84 万元投资于债券，由于此时基金拥有的股票市值为 27.73 万元（29.19 × (1-5%) = 27.73），故基金管理人卖出 2.21 万元股票（27.73-25.52=2.21），同时买入 2.21 万元债券。

因此如果股票上涨，那么投资组合净值上涨，防守垫增大，更多的资金从债券转到股票；如果股票下跌，那么投资组合净值下跌，防守垫缩小，更多的资金从股票转到债券；但投资组合净值最多下跌至底线，即防守垫最多缩小为零，这时投资组合全部转换为债券，投资组合沿着底线增值，到期增至本金 100 万元，从而实现保本的目的。

### 1、资产配置策略

本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和安全资产的配置，该层次以恒定比例组合保险策略为依据，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过安全资产部分所产生的收益；另一层为对风险资产部分的配置策略，依据稳健投资、风险第一的原则，以低风险性、在保本期内具备中期上涨潜力为主要标准，构建风险资产组合。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。

### 2、债券投资策略

本基金将密切关注经济运行的质量与效率，把握领先指标，预测未来走势，深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金对宏观经济运行中的价格指数与中央银行的货币供给与利率政策研判将成为投资决策的基本依据，并作为债券组合的久期配置的依据。在宏观分析及其决定的久期配置范围下，本基金将进行类属配置以贯彻久期策略。对不同类属债券，本基金将对其收益和风险情况进行评估，评估其为组合提供持有期收益和价差收益的能力，同时关注其利率风险、信用风险和流动性风险。本基金的债券投资策略还包括以下几方面：

（1）持有相当数量剩余期限与保本期相近的国债、金融债，其中一部分严格遵循持有到期原则，首要考虑收益性，另一部分兼顾收益性和流动性。这部分投资可以保证债券组合收益的稳定性，尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。

（2）综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。这部分投资包括中长期的国债、金融债，企业债，以及中长期逆回购等等。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。

（3）利用银行间市场和交易所市场现券存量进行国债回购所得的资金积极参与新股申购、新股增发和配售，以获得股票一级市场的可能投资回报。

（4）利用未来可能推出的利率远期、利率期货、利率期权等金融衍生工具，有效地规避利率风险。

### 3、股票投资策略

本基金注重对股市趋势的研究，在股票投资限额之下，发挥时机选择能力，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。

本基金依据稳健投资、风险第一的原则，以低风险性、在保本期内具备中期上涨潜力为主要标准，构建股票组合，同时兼顾股票的流动性。

根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。在行业选择中，本基金注重宏观经济景气状况及所处阶段，主要分析目前经济增长的构成、来源、景气状况，寻找在当前增长模式下增长空间和弹性最大的行业，寻找经济转型中受益程度最高的行业，结合动态分析行业发展周期、与上下游关系与谈判地位，寻找产业链中由弱转强或优势扩大的行业。

在个股的选择上，首先按照风险性由低至高、中期上涨潜力由高至低和流动性由高到低对股票池内的股票进行排名，累加三项排名得到综合排名，取综合排名靠前的股票构建股票组合，进行组合投资。

本基金通过选择风险低的股票，保证组合的稳定性；通过选择具中期上涨潜力的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资和流动性管理，降低个股集中性风险和流动性风险。

#### 4、股指期货投资策略

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

##### （1）利用股指期货调整风险资产的比例

本基金管理人将根据 CPPI 策略与市场的变化不断调整风险资产和安全资产之间的比例。在需要调整风险资产的头寸时，本基金将适当通过买卖股指期货对风险资产头寸进行调整。当需要增加风险资产头寸时，可根据相应的  $\beta$  值建立股指期货多头头寸；反之，当需要降低风险资产头寸时，可根据相应的  $\beta$  值建立股指期货空头头寸。

##### （2）调整投资组合的 $\beta$ 值

风险资产的  $\beta$  值是决定组合表现的重要因素，基金管理人将通过在弱市中降低风险资产组合的  $\beta$  值，在强市中提高风险资产组合的  $\beta$  值，以提升组合的业绩表现。基金管理人将通过建立多头或者空头股指期货头寸实现对风险资产组合  $\beta$  值的控制。

##### （3） $\alpha$ 策略

在投资组合中分离出系统风险，寻求具有长期稳定的超额收益的投资品种，并利用股指期货规避系统风险。

本基金管理人正式投资股指期货前将与担保人协商确定股指期货相关风险控制流程。本基金的股指期货投资将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品

种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

#### 5、权证投资策略

本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：3 年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

本基金是保本型基金，保本期为三年，以三年期银行定期存款税后收益率+0.5%作为本基金的业绩比较基准，在投资期限上较为类似，并且能够使本基金投资者判断本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

### 十、风险收益特征

本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

### 十一、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 12 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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



本投资组合报告所载数据截至 2012 年 9 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	442,407,965.89	9.63
	其中：股票	442,407,965.89	9.63
2	固定收益投资	2,945,764,849.77	64.15
	其中：债券	2,945,764,849.77	64.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,114,088,225.35	24.26
6	其他资产	89,727,462.90	1.95
7	合计	4,591,988,503.91	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	16,538,390.00	0.40
C	制造业	222,107,458.85	5.35
C0	食品、饮料	143,335,738.50	3.45
C1	纺织、服装、皮毛	18,688,950.00	0.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,135,156.08	0.68
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,277,846.64	0.03
C7	机械、设备、仪表	14,108,483.58	0.34
C8	医药、生物制品	16,561,284.05	0.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	66,743,020.00	1.61
E	建筑业	3,212,355.12	0.08
F	交通运输、仓储业	79,095,010.00	1.90
G	信息技术业	15,966,000.00	0.38
H	批发和零售贸易	14,461,481.51	0.35
I	金融、保险业	19,926,000.00	0.48
J	房地产业	4,358,250.41	0.10
K	社会服务业	-	-

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	442,407,965.89	10.65

## 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	000858	五粮液	2,701,330	91,575,087.00	2.20
2	600098	广州发展	10,000,000	62,900,000.00	1.51
3	601006	大秦铁路	10,159,100	61,970,510.00	1.49
4	600309	烟台万华	2,032,887	28,135,156.08	0.68
5	000568	泸州老窖	599,939	23,097,651.50	0.56
6	600000	浦发银行	2,700,000	19,926,000.00	0.48
7	002154	报喜鸟	1,785,000	18,688,950.00	0.45
8	600009	上海机场	1,450,000	17,124,500.00	0.41
9	600028	中国石化	2,761,000	16,538,390.00	0.40
10	600406	国电南瑞	900,000	15,966,000.00	0.38

## 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	-	-
2	央行票据	144,840,000.00	3.49
3	金融债券	89,979,000.00	2.17
	其中：政策性金融债	89,979,000.00	2.17
4	企业债券	1,317,420,849.77	31.72
5	企业短期融资券	681,004,000.00	16.40
6	中期票据	712,521,000.00	17.15
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,945,764,849.77	70.92

## 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	122079	11 上港 02	1,500,010	152,986,019.90	3.68
2	115001	钒钛债 1	1,494,201	148,717,825.53	3.58
3	115002	国安债 1	1,520,000	147,155,760.00	3.54
4	1101082	11 央行票据 82	1,500,000	144,840,000.00	3.49
5	126014	08 国电债	1,180,140	111,346,209.00	2.68

## 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

注：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名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8、投资组合报告附注

8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

### 8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	296,562.07
2	应收证券清算款	9,695,100.99
3	应收股利	-
4	应收利息	79,735,799.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,727,462.90

### 8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600098	广州发展	62,900,000.00	1.51	非公开发行
2	600406	国电南瑞	15,966,000.00	0.38	重大资产重组

## 十二、基金的业绩

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

### 南方保本混合型证券投资基金

阶段	净值增长率 (1)	净值增长率 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)

2011.6.21-2011.12.31	2.10%	0.08%	2.91%	0.00%	-0.81%	0.08%
2012.1.1-2012.9.30	3.23%	0.11%	3.92%	0.00%	-0.69%	0.11%
自基金成立起至今	5.40%	0.10%	6.84%	0.00%	-1.44%	0.10%

### 十三、基金费用概览

#### 一、基金费用的种类

##### （一）与基金运作有关的费用

##### 1、基金费用的种类：

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）《基金合同》生效后的信息披露费用；
- （4）基金份额持有人大会费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金财产拨划支付的银行费用；
- （8）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用；

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法規规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法規和基金合同另有规定时从其规定。

##### 3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.2\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

保本期内，担保费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

##### （2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.2%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

若保本期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“南方平衡配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法同上。

(3) 上述(一)中 3 到 7 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。

### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致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。基金募集期间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。

### 4、费用调整

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和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在至少一家指定媒体上刊登公告。

### 5、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。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费用和赎回费用

(1) 在本基金的保本期内，一般不接受申购申请。特殊情况经基金管理人与基金托管人、担保人协商并报中国证监会备案后可接受申购申请，具体规则由基金管理人在开始办理申购的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。申购费率不高于基金申购金额的 5%，具体费率以届时公告为准。

在本基金保本期到期后，如转入下一保本期，本基金过渡期申购费用采用前端收费模式。本基金申购费率最高不高于 1.2%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额 ( M )	申购费率
------------	------

M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 500 万	0.8%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.4%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

若保本期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为变更后的“南方平衡配置混合型证券投资基金”，申购费率不高于基金申购金额的 5%，具体费率以届时公告为准。

(2) 本基金赎回费率不高于 2.0%，随申请份额持有时间增加而递减（其中 1 年为 365 天，1.5 年为 547 天）。具体如下表所示：

申请份额持有时间 ( N )	赎回费率
N < 1.5 年	2.0%
1.5 年 ≤ N < 3 年	1.0%
N ≥ 3 年	0

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，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，赎回费归入基金财产的比例不得低于 50%。

若保本期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为变更后的“南方平衡配置混合型证券投资基金”，赎回费率最高不超过 5%，具体费率以届时公告为准。

(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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照有关规定在至少一家指定媒体公告。

(4) 对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“基金管理人”部分，更新了主要人员情况。
- 2、在“基金托管人”部分，对“基金托管人概况”、“主要人员情况”和“基金托管业务经营情况”进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”部分，对代销银行、代销券商和其他代销机构名单进行了更新。
- 4、在“基金的投资”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
- 5、在“基金的业绩”部分，更新了本基金最近一期的业绩报告。
- 6、对“基金份额持有人服务”进行了更新。
- 7、对“其他应披露事项”进行了更新。
- 8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

二〇一三年二月二日