

# 南方睿见定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）

## 摘要

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

截止日：2017年12月21日

### 重要提示

本基金经中国证监会2016年6月3日证监许可[2016]1211号文注册募集。本基金的基金合同于2016年12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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，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，本基金的特定风险等，详见招募说明书风险揭示章节。本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

投资有风险，投资人认购（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》等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现；基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的买者自负原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

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

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2017年12月21日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日（未经审计）。

### 1 基金管理人

#### 1.1 基金管理人概况

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

成立时间：1998年3月6日

法定代表人：张海波

注册资本：3亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：常克川

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[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号文批准进行了增资扩股，注册资本达1.5亿元人民币。2010年，经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。2014年公司进行增资扩股，注册资本金达3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

## 1.2 主要人员情况

### 1.2.1 董事会成员

张海波先生，董事长，1963年出生，籍贯安徽，工商管理硕士，十九年证券从业经历，中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员，江苏省人民政府办公厅调研员。1998年12月加入华泰证券，曾任总裁助理、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等职务，曾分管投资银行、固定收益投资、资产管理、直接投资、海外业务、计划财务、人力资源等工作。现任南方基金管理有限公司党委书记、董事长。

王连芬女士，董事，1966年出生，籍贯天津，金融专业硕士，二十四年证券从业经历，中国籍。历任赛格集团销售，深圳投资基金管理公司投资一部研究室主任，大鹏证券经纪业务部副总经理、深圳福虹路营业部总经理、南方总部总经理、总裁助理，第一证券总裁助理，华泰联合证券深圳华强北路营业部总经理、渠道服务部总经理、运营中心总经理、零售客户部总经理、执行办主任、总裁助理。现任华泰证券股份有限公司总裁助理兼深圳分公司总经理。

张辉先生，董事，1975年出生，籍贯浙江，管理学博士，十九年证券从业经历，中国籍。曾任职于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。2003年2月加入华泰证券，先后担任华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理。现任华泰证券股份有限公司董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生，董事，1966年出生，籍贯江西，工学学士，中国籍。历任陆军第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、深圳市纪委办公厅副主任、深圳市纪委党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、纪委书记、深圳市投控资本有限公司监事。

李平先生，董事，1981年出生，籍贯四川，工商管理硕士，中国籍。历任深圳市城建集团办公室文秘、董办文秘、深圳市投资控股有限公司办公室（信访办）高级主管、企业三部高级主管。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长、深圳市城市建设开发（集团）公司董事。

李自成先生，董事，1961年出生，籍贯福建，近现代史专业硕士，中国籍。历任厦门大学哲学系团总支副书记、厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、计财部经理、公司总经理助理、厦门国际信托投资有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

王斌先生，董事，1970年出生，籍贯安徽，临床医学博士，中国籍。历任安徽泗县人民医院临床医生、瑞金医院主治医师、兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理。现任兴业证券研究所总经理。

杨小松先生，董事，1970年出生，籍贯四川，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍。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、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。现任南方基金管理有限公司总裁、党委副书记。

姚景源先生，独立董事，1950年出生，籍贯山东，经济学硕士，中国籍。历任国家经委副处长、商业部

政策研究室副处长、国际合作司处长、副司长、中国国际贸易促进会商业行业分会副会长、常务副会长、国内贸易部商业发展中心主任、中国商业联合会副会长、秘书长、安徽省政府副秘书长、安徽省阜阳市政府市长、安徽省统计局局长、党组书记、国家统计局总经济师兼新闻发言人。现任国务院参事室特约研究员、中国经济 50 人论坛成员、中国统计学会副会长。

李心丹先生，独立董事，1966 年出生，籍贯湖南，金融学博士，国务院特殊津贴专家，国务院学位委员会、教育部全国金融硕士专业学位教学指导委员会委员，中国籍。历任东南大学经济管理学院教授、南京大学工程管理学院院长。现任南京大学-牛津大学金融创新研究院院长、金融工程研究中心主任、南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、教授、博士生导师、江苏省省委决策咨询专家、上海证券交易所上市委员会委员及公司治理委员会委员、上海证券交易所、深圳证券交易所、交通银行等单位的博士后指导教师、中国金融学年会常务理事、国家留学基金会评审专家、江苏省资本市场研究会会长、江苏省科技创新协会副会长。

周锦涛先生，独立董事，1951 年出生，中国香港籍，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。历任香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察、香港证券及期货专员办事处证券主任、香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，1964 年出生，籍贯北京，经济学硕士、工商管理硕士、中国注册会计师，中国籍。历任北京市财政局干部、深圳蛇口中华会计师事务所经理、京都会计师事务所副主任。现任致同会计师事务所(特殊普通合伙)管理合伙人、中国证监会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。

周蕊女士，独立董事，1971 年出生，籍贯广东，法学硕士，中国籍。历任北京市万商天勤(深圳)律师事务所律师、北京市中伦(深圳)律师事务所律师、北京市信利(深圳)律师事务所律师、合伙人。现任金杜律师事务所合伙人、全联并购公会广东分会会长、广东省律师协会女律师工作委员会副主任、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深圳市女企业家协会理事。

#### 1.2.2 监事会成员

吴晓东先生，监事会主席，1969 年出生，籍贯江苏，法律博士，中国籍。历任中国证监会法律部法规处副处长、上市公司监管部并购监管处副处长、上市公司监管部公司治理监督处处长、发行监管部发审委处长、华泰证券合规总监、华泰联合证券党委书记、副总裁、董事长。现任南方基金管理有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司董事长。

舒本娥女士，监事，1964 年出生，籍贯江西，大学本科学历，十九年证券从业经历，中国籍。历任熊猫电子集团公司财务处处长、华泰证券计划资金部副总经理、稽查监察部副总经理、总经理、计划财务部总经理。现任华泰证券股份有限公司财务总监、华泰联合证券有限责任公司监事会主席、华泰长城期货有限公司副董事长、华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士，监事，1964 年出生，籍贯浙江，大学本科学历，高级会计师，中国籍。历任浙江兰溪马涧米厂主管会计、浙江兰溪纺织机械厂主管会计、深圳市建筑机械动力公司会计、深圳市建设集团计划财务部助理会计师、深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理、深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长。现任深圳市投资控股有限公司考核分配部部长、深圳经济特区房地产(集团)股份有限公司董事、深圳市建安(集团)股份有限公司董事、深圳市国际招标有限公司董事、深圳市深投物业发展有限公司董事。

王克力先生，监事，1961 年出生，籍贯福建，船舶工程专业学士，中国籍。历任厦门造船厂技术员、厦门汽车工业公司总经理助理、厦门国际信托有限公司国际广场筹建处副主任、厦信置业发展公司总经理、投资部副经理、自有资产管理部副经理职务。现任厦门国际信托有限公司投资发展部总经理。

林红珍女士，监事，1969 年出生，籍贯福建，工商管理硕士，中国籍。历任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、风险管理部副经理(主持工作)、风险管理部总经理。现任兴业证券财务部、资金运营管理部总经理、兴证期货管理有限公司董事、兴业创新资本管理有限公司监事。

张德伦先生，职工监事，1964年出生，籍贯山东，企业管理硕士学历，中国籍。历任北京邮电大学副教授、华为技术有限公司处长、汉唐证券人力资源管理总部总经理、海王生物人力资源总监、华信惠悦咨询公司副总经理、首席顾问。现任南方基金管理有限公司党委组织部部长、人力资源部总经理、执行董事、南方资本管理有限公司董事。

苏民先生，职工监事，1969年出生，籍贯安徽，计算机硕士研究生，中国籍。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经理、执行董事。

林斯彬先生，职工监事，1977年出生，籍贯广东，民商法专业硕士，中国籍。历任金杜律师事务所证券业务部实习律师、上海浦东发展银行深圳分行资产保全部职员、银华基金监察稽核部法务主管、民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金管理有限公司监察稽核部董事。

### 1.2.3 公司高级管理人员

张海波先生，董事长，简历同上。

杨小松先生，总裁，简历同上。

俞文宏先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，经济师，中国籍。曾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，曾任南方资本管理有限公司董事长，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士，中国籍。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，曾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。

常克川先生，副总裁，中共党员，EMBA工商管理硕士，中国籍。曾任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；2011年加入南方基金，任职董事会秘书、纪委书记、南方资本管理有限公司董事，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。曾任美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师，2002年加入南方基金管理有限公司，曾任高级研究员、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、总经理助理兼固定收益投资总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、首席投资官（固定收益）。

史博先生，副总裁，经济学硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍。曾任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。2009年加入南方基金管理有限公司，曾任基金经理、研究部总监、总经理助理兼首席投资官（权益），现任南方基金管理有限公司副总裁、首席投资官（权益）。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士，中国籍。曾任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，1998年加入南方基金，曾任运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总经理助理，现任南方基金管理有限公司督察长、南方资本管理有限公司董事。

### 1.2.4 基金经理

本基金历任基金经理为：2016年12月至今，刘霄汉、李璇。

刘霄汉女士，经济学硕士，具有基金从业资格。曾就职于中邮基金管理有限公司，历任研究员、研究组组长，2010年5月至2015年3月担任中邮核心主题股票型基金基金经理。2015年4月加入南方基金，现任南方基金刘霄汉工作室负责人。2015年8月至今，任南方国策动力基金经理；2015年11月至今，任南方医保基金经理；2015年12月至今，任南方沪港深价值、南方改革机遇基金经理；2016年12月至今，任南方睿见混合基金经理。

李璇女士，清华大学金融学学士、硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007年加入南方基金，担任信用债高级分析师，现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月

至 2012 年 6 月，担任南方宝元基金经理；2012 年 12 月至 2014 年 9 月，担任南方安心基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 2 月，担任南方润元基金经理；2013 年 7 月至 2017 年 9 月，担任南方稳利基金经理；2016 年 8 月至 2017 年 12 月，担任南方通利、南方荣冠基金经理；2010 年 9 月至今，担任南方多利基金经理；2012 年 5 月至今，担任南方金利基金经理；2016 年 8 月至今，担任南方丰元基金经理；2016 年 9 月至今，担任南方多元基金经理；2016 年 11 月至今，任南方荣安基金经理；2016 年 12 月至今，任南方睿见混合基金经理；2017 年 1 月至今，任南方宏元、南方和利基金经理；2017 年 3 月至今，任南方荣优基金经理；2017 年 5 月至今，任南方荣尊基金经理；2017 年 6 月至今，任南方荣知基金经理；2017 年 7 月至今，任南方荣年基金经理；2017 年 9 月至今，任南方兴利基金经理。

#### 1.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官（固定收益）李海鹏先生，副总裁兼首席投资官（权益）史博先生，首席投资官（专户）兼权益专户投资部总经理蒋峰先生，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，指数投资部兼量化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砾先生。

#### 1.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 2 基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称招商银行）

成立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：075583199084

传真：075583195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2017 年 9 月 30 日，本集团总资产 61,692.39 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.01%，权重法下资本充足率 12.26%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 76 人。

2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立因势而变、先您所想的托管理念和财富所托、信守承诺的托管核心价值，独创 6S 托管银行品牌体系，以保护您的业务、保护您的财富为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推

出网上托管银行系统、托管业务综合系统和 6 心托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只 1+N 基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》中国最佳托管专业银行。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》中国最佳托管银行奖，成为国内唯一获奖项国内托管银行；托管通获得国内《银行家》2016 中国金融创新十佳金融产品创新奖；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】最佳资产托管银行；2017 年 6 月再度荣膺《财资》中国最佳托管银行奖，全功能网上托管银行 2.0 荣获《银行家》2017 中国金融创新十佳金融产品创新奖；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》中国年度托管银行奖，进一步扩大我行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

## （二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006 年 3 月至 2008 年 6 月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008 年 6 月至 2012 年 6 月，任北京分行行长、党委书记；2012 年 6 月至 2013 年 11 月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013 年 11 月至 2014 年 12 月，任招商银行总行行长助理；2015 年 1 月起担任本行副行长；2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。

2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

## （三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 316 只开放式基金。

## （四）托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

### 3、内部控制原则

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

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

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

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

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

### 4、内部控制措施

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

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

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

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

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

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

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

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

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，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、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 3 相关服务机构

#### 3.1 销售机构

代销银行：

序号 代销机构名称 代销机构信息

1 招商银行股份有限公司 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

2 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](http://www.abchina.com)

3 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

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

4 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：牛锡明

联系人：张宏革

联系电话：021-58781234



客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

5 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](http://www.spdb.com.cn)

6 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：北京东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦

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/>

7 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：洪崎

联系人：穆婷

电话：010-58560666

传真：010-57092611

客服电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

8 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：010-63639709

客服电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

9 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](http://www.cib.com.cn)

10 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

11 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:赵姝

传真:010-66225309

客服电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

12 北京农村商业银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼

办公地址:北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼

法定代表人:王金山

联系人:鲁娟

电话:010-89198762

客服电话:96198; 400-88-96198; 400-66-96198

网址:www.bjrcb.com

13 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

办公地址:上海市浦东新区银城中路 8 号

法定代表人:冀光恒

联系人:陈玲

联系电话:021-38576830

客服电话:021-962999、4006962999

网址:www.srcb.com

14 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:吴照群

联系电话:0769-22119061

客服电话:4001196228

网址:www.dongguanbank.cn

15 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

16 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

17 江苏张家港农村商业银行股份有限公司 注册地址:张家港市杨舍镇人民中路 66 号

办公地址：张家港市杨舍镇人民中路 66 号

法定代表人：王自忠

联系人：施圆圆

联系电话：0512-56968212

客服电话：0512-96065

网址：[www.zrcbank.com](http://www.zrcbank.com)

18 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：杨亢

电话：0769-22866270

传真：0769-22866282

客服电话：0769-961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

19 乌鲁木齐银行股份有限公司 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：杨黎

联系人：余戈

电话：0991-4525212

传真：0991-8824667

客服电话：0991-96518

网址：[www.uccb.com.cn](http://www.uccb.com.cn)

20 渤海银行股份有限公司 注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客服电话：95541

网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

21 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](http://www.hebbank.com)

22 徽商银行股份有限公司 注册地址：安徽合肥安庆路 79 号天徽大厦 A 座

办公地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：李宏鸣

联系人：叶卓伟

电话：0551-62667635

传真：0551-62667684

客服电话: 4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)

网址: [www.hsbank.com.cn](http://www.hsbank.com.cn)

23 广东顺德农村商业银行股份有限公司 注册地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号

办公地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号

法定代表人: 姚真勇

联系人: 陈素莹

电话: 0757-22385879

传真: 0757-22388235

客服电话: 0757-22223388

网址: [www.sdebank.com](http://www.sdebank.com)

24 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: 王继康

联系人: 刘强

电话: 020-22389067

传真: 020-22389031

客服电话: 95313

网址: [www.grcbank.com](http://www.grcbank.com)

25 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: 0755-82817529

传真: 0755-82811423

客服电话: 96588(广东省外加拨 0756), 4008800338

网址: [www.crbank.com.cn](http://www.crbank.com.cn)

26 江苏江南农村商业银行股份有限公司 注册地址: 常州市天宁区延宁中路 668 号

办公地址: 常州市天宁区延宁中路 668 号

法定代表人: 陆向阳

联系人: 包静

电话: 0519-80585939

传真: 0519-89995066

客服电话: 96005

网址: [www.jnbank.cc](http://www.jnbank.cc)

27 四川天府银行股份有限公司 注册地址: 四川省南充市涪江路 1 号

办公地址: 四川省成都市锦江区下东大街 258 号

法定代表人: 黄光伟

联系人: 樊海波

电话: 028-67676033

客服电话: 400-16-96869

网址: [www.tf.cn](http://www.tf.cn)

28 富滇银行股份有限公司 注册地址: 云南省昆明市拓东路 41 号

办公地址: 云南省昆明市拓东路 41 号

法定代表人: 夏蜀

联系人：杨翊琳

电话：0871-63140324

传真：0871-63194471

客服电话：4008896533

网址：<http://www.fudian-bank.com/>

29 山东寿光农村商业银行股份有限公司 注册地址：山东省寿光市银海路 19 号

办公地址：山东省寿光市银海路 19 号

法定代表人：颜廷军

联系人：武翔宇

电话：0536-5293756

传真：0536-5293756

客服电话：0536-96633

30 广东南海农村商业银行股份有限公司 注册地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号

办公地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号

法定代表人：李宜心

联系人：廖雪

电话：0757-86266566

传真：0757-86250627

客服电话：96138

网址：[www.nanhaibank.com](http://www.nanhaibank.com)

31 苏州银行股份有限公司 注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

联系人：朱瑞良

电话：0512-69868364

传真：0512-69868370

客服电话：96067

网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

32 晋商银行股份有限公司 注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座

办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座

法定代表人：阎俊生

联系人：卫奕信

电话：0351-6819926

传真：0351-6819926

客服电话：9510-5588

网址：[www.jshbank.com](http://www.jshbank.com)

33 昆仑银行股份有限公司 注册地址：新疆克拉玛依市世纪大道 7 号

办公地址：北京市西城区金融街 1 号 B 座

法定代表人：闫宏

联系人：张碧华

电话：010-89026813

传真：010-89025421

客服电话：4006696569

网址：[www.klb.cn](http://www.klb.cn)

34 桂林银行股份有限公司 注册地址：桂林市中山南路 76 号

办公地址：桂林市中山南路 76 号

法定代表人：王能

联系人：周佩玲

电话：0773-3810130

传真：0773-3851691

客服电话：400-86-96299

网址：[www.guilinbank.com.cn](http://www.guilinbank.com.cn)

35 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：傅彩芬

电话：0595-22551071

传真：0595-22578871

客服电话：96312

网址：<http://www.qzccb.com/>

36 成都农村商业银行股份有限公司 注册地址：四川省成都市武侯区科华中路 88 号

办公地址：四川省成都市武侯区科华中路 88 号

法定代表人：陈萍

联系人：杨琪

电话：028-85315412

传真：028-85190961

客服电话：95392

网址：<http://www.cdrcb.com/>

37 锦州银行股份有限公司 注册地址：辽宁省锦州市松山新区科技路 68 号

办公地址：辽宁省锦州市松山新区科技路 68 号

法定代表人：张伟

联系人：庞璐璐

电话：0416-3220085

传真：0416-3220186

客服电话：400-66-96178

网址：[www.jinzhoubank.com](http://www.jinzhoubank.com)

38 浙江泰隆商业银行股份有限公司 注册地址：浙江省台州市路桥区南官大道 188 号

办公地址：浙江省杭州市上城区望江东路 59 号

法定代表人：王钧

联系人：陈妍宇

电话：0571-87788979

传真：0571-87788818

客服电话：400-88-96575

网址：[www.zjtlcb.com](http://www.zjtlcb.com)

39 浙江富阳农村商业银行股份有限公司 注册地址：杭州市富阳区鹿山街道依江路 501 号第 1 幢

办公地址：杭州市富阳区鹿山街道依江路 501 号第 1 幢

法定代表人：马富华

联系人：陈硕

电话: 0571-63280253

传真: 0571-63360418

客服电话: 4008896596

网址: [www.fyrcbk.com](http://www.fyrcbk.com)

40 长春农村商业银行股份有限公司 注册地址: 吉林省长春市二道区自由大路 5755 号

办公地址: 吉林省长春市绿园区正阳街 4288 号

法定代表人: 马铁刚

联系人: 张俊峰

电话: 0431-89115109

传真: 0431-89115154

客服电话: 96888-0-1

网址: <http://www.cccb.cn>

41 齐商银行股份有限公司 注册地址: 山东省淄博市张店区金晶大道 105 号

办公地址: 山东省淄博市张店区金晶大道 105 号

法定代表人: 臧传勇

联系人: 焦浦

电话: 0533-2178888-9907

传真: 0533-6120373

客服电话: 96588

网址: [www.qsbank.cc](http://www.qsbank.cc)

42 浙江萧山农村商业银行股份有限公司 注册地址: 杭州市萧山区人民路 258 号

办公地址: 杭州市萧山区人民路 258 号

法定代表人: 王云龙

联系人: 冯亮

电话: 0571-82739513

传真: 0571-82739513

客服电话: 96596

网址: <http://www.zjxsbank.com>

43 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](http://www.jzbank.com)

代销券商及其他代销机构:

序号 代销机构名称 代销机构信息

1 华泰证券股份有限公司 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 本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告

### 3.2 登记机构

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

法定代表人：张海波

电话：（0755）82763849

传真：（0755）82763868

联系人：古和鹏

### 3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：陈颖华

电话：(8621)31358666

传真：(8621)31358600

经办律师：黎明、陈颖华

### 3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：薛竞、陈熹

## 4 基金名称

南方睿见定期开放混合型发起式证券投资基金

## 5 基金的类型

混合型证券投资基金

## 6 基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。

## 7 基金的投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（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（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-30%。开放期内，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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

## 8 基金的投资策略

### 8.1 投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

#### 2、股票投资策略

本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向，努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值水平，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

#### 3、债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。

本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

#### 4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

#### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

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。

### 8.2 投资决策依据和决策程序

#### 1、决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；
- (2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础；
- (3) 投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本基金维护投资人利益的重要保障。

#### 2、决策程序

- (1) 决定主要投资原则：投资决策委员会决定基金的主要投资原则，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
- (2) 提出投资建议：研究员以外部研究报告以及其他信息来源作为参考，对市场进行研究，提出市场运

行趋势的分析观点，在重点关注的投资产品范围内根据自己的研究选出有投资价值的各类证券向基金经理做出投资建议。研究员根据基金经理提出的要求对各类投资品种进行研究并提出投资建议。

(3) 制定投资决策：基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

(4) 进行风险评估：风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估，并出具风险监控报告。

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

## 9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 30%+上证国债指数收益率 70%

沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深 300 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

上证国债指数由上交所编制，具有较长的编制和发布历史，以及较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金债券投资部分的基准。

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，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准，通过书面形式告知托管人并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

## 10 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 11 基金投资组合报告

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

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

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2017 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	----------	--------------

1	权益投资	18,446,948.56	4.15
---	------	---------------	------

其中：股票	18,446,948.56	4.15
-------	---------------	------

2	基金投资	--	--
---	------	----	----

3	固定收益投资	408,891,644.90	91.97
---	--------	----------------	-------

其中：债券	408,891,644.90	91.97
-------	----------------	-------

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 9,562,399.46 2.15

----

- 其他资产 7,672,329.17 1.73

- 合计 444,573,322.09 100.00

## 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 --

B 采矿业 --

C 制造业 2,375,663.56 0.74

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 --

F 批发和零售业 13,631,285.00 4.27

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 544,200.00 0.17

J 金融业 1,895,800.00 0.59

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 --

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 --

R 文化、体育和娱乐业 --

S 综合 --

合计 18,446,948.56 5.78

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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 000028 国药一致 120,000 8,120,400.00 2.54

2 002462 嘉事堂 138,900 4,812,885.00 1.51

3 600030 中信证券 50,000 909,500.00 0.28

4 000538 云南白药 10,000 907,000.00 0.28

5 000419 通程控股 100,000 698,000.00 0.22

6 601009 南京银行 70,000 553,700.00 0.17

7 002517 恺英网络 30,000 544,200.00 0.17

8 300424 航新科技 17,972 498,363.56 0.16

9 601211 国泰君安 20,000 432,600.00 0.14

10 002185 华天科技 50,000 419,500.00 0.13

#### 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	499,750.00	0.16
2	央行票据	--	--
3	金融债券	9,959,000.00	3.12
	其中：政策性金融债	--	--
4	企业债券	98,946,894.90	31.00
5	企业短期融资券	221,005,000.00	69.25
6	中期票据	59,155,000.00	18.54
7	可转债（可交换债）	--	--
8	同业存单	19,326,000.00	6.06
	----		
	- 其他	--	--
	- 合计	408,891,644.90	128.12

#### 5.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	1011754079	17 澜沧江 SCP004	200,000	20,060,000.00	6.29
2	101769014	17 首旅 MTN001B	200,000	19,986,000.00	6.26
3	112561	17 万科 02	200,000	19,930,000.00	6.24
4	136276	16 南山 01	180,000	17,550,000.00	5.50
5	101754032	17 潞安 MTN002	100,000	10,212,000.00	3.20

#### 6.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序的前五名贵金属投资明细

注：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序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 11.投资组合报告附注

##### 11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券(600030)，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。根据 2017 年 5 月 24 日中信证券股份有限公司（下称中信证券，股票代码：600030）《中信证券股份有限公司关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，中信证券近日收到了《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57 号），依据《证券公司监督管理条例》相关规定，证监会拟决定：责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币 61,655,849.78 元，并处人民币 308,279,248.90 元罚款。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

##### 11.2

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。

##### 11.3 其他资产构成

序号 名称 金额（人民币元）

1	存出保证金	21,543.92
2	应收证券清算款	449,033.67
3	应收股利	-
4	应收利息	7,201,751.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	-	-
8	其他	-
9	合计	7,672,329.17

#### 11.4 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。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 12 基金业绩

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

阶段 份额净值收益率（1） 份额净值收益率标准差（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)

2016.12.21-2016.12.31 0.00% 0.08% 0.14% 0.18% -0.14% -0.10%

2017.01.01-2017.09.30 1.50% 0.07% 5.01% 0.18% -3.51% -0.11%

自基金成立起至今 1.50% 0.06% 5.16% 0.18% -3.66% -0.12%

#### 13 基金的费用概览

##### 13.1 与基金运作有关的费用

###### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

###### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.2\%$  当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.1\%$  当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、从基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 1.2\%$  当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 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、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

上述一、基金费用的种类中第 4-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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

### 13.2 与基金销售有关的费用

1、本基金不收取申购费用

2、本基金的赎回费

本基金赎回费率最高不超过 2.5%，随申请份额持有封闭期的数增加而递减。具体如下表所示：

申请份额持有封闭期数 赎回费率

持有 1 个及以下封闭期 2.5%

连续持有 2 个封闭期 2.0%

连续持有 3 个封闭期 1.5%

连续持有 4 个封闭期 1.0%

连续持有 5 个封闭期 0.5%

连续持有 6 个及以上封闭期 0

赎回费全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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。

#### 14 对招募说明书更新部分的说明

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

- 1、在重要提示部分，对重要提示进行了更新。
- 2、在绪言部分，对绪言进行了更新。
- 3、在释义部分，对释义进行了更新。
- 4、在基金管理人部分，对基金管理人概况进行了更新，对主要人员情况进行了更新。
- 5、在基金托管人部分，对基金托管人进行了更新。
- 6、在相关服务机构部分，对销售机构进行了更新。
- 7、在基金的投资部分，对基金投资组合报告进行了更新，对基金业绩进行了更新。
- 8、在基金份额持有人服务部分，对基金份额持有人服务进行了更新。
- 9、在其他应披露事项部分，对其他应披露事项进行了更新。
- 10、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2018 年 1 月 26 日