

南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 招募说明书（更新）摘要
(2018 年第 2 号)

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

截止日：2018 年 09 月 29 日

重要提示

本基金经中国证监会 2016 年 2 月 26 日证监许可[2016]366 号文注册募集。本基金的基金合同已于 2016 年 9 月 29 日正式生效。

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

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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是跟踪中证 1000 指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金被动跟踪标的指数“中证 1000 指数（及其未来可能发生的变更）”，因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资人办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到影响。

投资人投资本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证 1000 指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上

海证券交易所 A 股账户；如投资人需要使用中证 1000 指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资人保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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 2018 年 9 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日（未经审计）。

§ 1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

名称：南方基金管理股份有限公司

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

1998 年，南方基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]4 号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。2014 年公司进行增资扩股，注册资本金达 3 亿元人民币。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

1.2 主要人员情况

1.2.1 董事会成员

张海波先生，董事长，工商管理硕士，中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员，江苏省人民政府办公厅调研员，华泰证券总裁助理、投资银行部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务管理总部总经理，华泰证券副总裁兼华泰紫金投资有限责任公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事长、华泰证券（上海）资产管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司党委书记、董事长。

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

张辉先生，董事，管理学博士，中国籍。曾任职北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司干部，华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理。现任华泰证券股份有限公司董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生，董事，工学学士，中国籍。曾任职陆军第 124 师工兵营地爆连副连职排长、代政治指导员、师政治部组织科正连职干事，陆军第 42 集团军政治部组织处副营职干事，驻香港部队政治部组织处正营职干事，驻澳门部队政治部正营职干事，陆军第 163 师政治部宣传科副科长（正营职），深圳市纪委教育调研室主任科员、副处级纪检员、办公厅副主任、党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、纪委书记，深圳市投控资本有限公司监事。

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

李自成先生，董事，近现代史专业硕士，中国籍。曾任职厦门大学哲学系团总支副书记，厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、计财部经理、公司总经理助理，厦

门国际信托投资有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

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

杨小松先生，董事，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍。曾任职德勤国际会计师行会计专业翻译，光大银行证券部职员，美国 NASDAQ 实习职员，证监会处长、副主任，南方基金管理有限公司督察长。现任南方基金管理股份有限公司总裁、党委副书记，南方东英资产管理有限公司董事。

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

李心丹先生，独立董事，金融学博士，国务院特殊津贴专家，中国籍。曾任职东南大学经济管理学院教授，南京大学工程管理学院院长。现任南京大学-牛津大学金融创新研究院院长、金融工程研究中心主任，南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、教授、博士生导师，中国金融学年会常务理事，江苏省资本市场研究会会长，江苏省科技创新协会副会长。

周锦涛先生，独立董事，工商管理博士，法学硕士，香港证券及投资学会杰出资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察，香港证券及期货专员办事处证券主任，香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问。

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

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

1.2.2 监事会成员

吴晓东先生，监事会主席，法律博士，中国籍。曾任职中国证监会副处长、处长，华泰证券合规总监，华泰联合证券副总裁、党委书记、董事长。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董事长。

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

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

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

林红珍女士，监事，工商管理硕士，中国籍。曾任职厦门对外供应总公司会计，厦门中友贸易联合公司财务部副经理，厦门外供房地产开发公司财务部经理，兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副经理（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，企业管理硕士学历，中国籍。曾任职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。现任南方基金管理股份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，计算机硕士研究生，中国籍。曾任职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。现任南方基金管理股份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，民商法专业硕士，中国籍。曾任职金杜律师事务所证券业务部实习律师，上海浦东发展银行深圳分行资产保全部职员，银华基金监察稽核部法务主管，民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金管理股份有限公司监察稽核部董事。

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，工商管理硕士，经济师，中国籍。曾任职江苏省投资公司业务经理，江苏国际招商公司部门经理，江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理，江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理，南方资本管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

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

常克川先生，副总裁，EMBA 工商管理硕士，中国籍。曾任职中国农业银行副处级秘书，南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理，华泰联合证券董事会秘书、合规总监等职务，南方资本管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。曾任职美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师，南方基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、总裁助理兼固定收益投资总监，南方东英资产管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（固定收益）。

史博先生，副总裁，经济学硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍。曾任职博时基金管理有限公司研究员、市场部总助，中国人寿资产管理有限公司股票部高级投资经理，泰达宏利基金管理有限公司投资副总监、研究总监、首席策略分析师、基金经理，南方基金管理有限公司基金经理、研究部总监、总裁助理兼首席投资官（权益）。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（权益）。

鲍文革先生，督察长，经济学硕士，中国籍。曾任职财政部中华会计师事务所审计师，南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理。现任南方基金管理股份有限公司督察长，南方资本管理有限公司董事。

1.2.4 基金经理

周豪先生，北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任数

量化投资部高级研究员；2016 年 4 月至今，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至今，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至今，任 1000ETF 基金经理；2017 年 8 月至今，任南方有色金属基金经理；2017 年 9 月至今，任南方有色金属联接基金经理；2018 年 1 月至今，任南方中证 100 基金经理；2018 年 2 月至今，任南方消费活力基金经理。

1.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官（固定收益）李海鹏先生，副总裁兼首席投资官（权益）史博先生，权益研究部总经理茅炜先生，交易管理部总经理王珂女士，权益投资部总经理张原先生，指数投资部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铄先生。

1.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

§ 2 基金托管人

四、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：0755—83199084

传真：0755—83195201

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 2018 年 3 月 31 日，本集团总资产 62,522.38 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.51%，权重法下资本充足率 12.79%。

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 81 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”，2018 年 1 月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项，同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月招商银行荣获公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

（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 2018 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 364 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制度，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：

一级风险防范是在招商银行总行层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银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；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，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。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全体人员参与。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求，以有效防范各种风险作为内部控制的核心。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，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能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够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。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

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

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、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。

4、

内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务操作流程、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、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在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(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、托管业务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，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，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级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

(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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如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，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律法规及基金合同允许的调整期限。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。基金管理人对于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。

四、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”）

设立日期：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：0755—83199084

传真：0755—83195201

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 2018 年 3 月 31 日，本集团总资产 62,522.38 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.51%，权重法下资本充足率 12.79%。

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 81 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”，2018 年 1 月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项，同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月招商银行荣获公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

（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 2018 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 364 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制度，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：

一级风险防范是在招商银行总行层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银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；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，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。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全体人员参与。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求，以有效防范各种风险作为内部控制的核心。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，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能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够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。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

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

(8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、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。

4、

内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务操作流程、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、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在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(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、托管业务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，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，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管理。

(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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如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，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整

改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。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。基金管理人对于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。

§ 3 相关服务机构

3.1 销售机构

3.1.1 申购赎回代理证券公司

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路 228 号 法定代表人：周易 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
2	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：周杨 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：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：杨德红 联系人：芮敏祺 电话：021-38676666 客服电话：4008888666 网址：www.gtja.com
6	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
7	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
8	广发证券股份有限公司	注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄岚 客服电话：95575 或致电各地营业网点 网址：广发证券网 http://www.gf.com.cn
9	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 办公地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦 14、16、17 层 法定代表人：丁益 联系人：金夏 联系电话：0755-83516289 客服电话：0755-33680000 4006666888 网址：www.cgws.com
10	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

		<p>A 座 38—45 层 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</p>
11	中信证券股份有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 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</p>
12	申万宏源证券有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层 法定代表人：李梅 联系人：李玉婷 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com</p>
13	申万宏源西部证券有限公司	<p>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：韩志谦 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</p>
14	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：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn</p>

15	中信证券（山东）有限责任公司	<p>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</p> <p>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</p> <p>法定代表人：姜晓林</p> <p>联系人：刘晓明</p> <p>联系电话：0531-89606165</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：www.zxzqsd.com.cn</p>
16	华西证券股份有限公司	<p>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</p> <p>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</p> <p>法定代表人：杨炯洋</p> <p>联系人：谢国梅</p> <p>联系电话：010-52723273</p> <p>客服电话：95584</p> <p>网址：www.hx168.com.cn</p>
17	平安证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层</p> <p>办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层</p> <p>法定代表人：刘世安</p> <p>联系人：周一涵</p> <p>联系电话：021-38637436</p> <p>客服电话：95511-8</p> <p>网址：stock.pingan.com</p>
18	国海证券股份有限公司	<p>注册地址：广西省桂林市辅星路 13 号</p> <p>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</p> <p>法定代表人：何春梅</p> <p>联系人：牛孟宇</p> <p>电话：0755-83709350</p> <p>传真：0755-83704850</p> <p>客服电话：95563</p> <p>网址：http://www.ghzq.com.cn</p>
19	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</p> <p>法定代表人：廖庆轩</p> <p>联系人：周青</p> <p>联系电话：023-63786633</p> <p>客服电话：4008096096</p> <p>网址：www.swsc.com.cn</p>
20	方正证券股份有限公司	<p>注册地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22—24 层</p>

		<p>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：高利 联系人：丁敏 联系电话：010-59355997 客服电话：95571 网址：www.foundersc.com</p>
21	财通证券股份有限公司	<p>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：沈继宁 联系人：夏吉慧 联系电话：0571-87925129 客服电话：95336,40086-96336 网址：www.ctsec.com</p>
22	中国民族证券有限责任公司	<p>注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F 办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F 法定代表人：赵大建 联系人：齐冬妮 电话：010-59355807 传真：010-56437030 客服电话：4008895618 网址：www.e5618.com</p>
23	宏信证券有限责任公司	<p>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：张鋈 电话：010-64083702 传真：028-86199382 客服电话：4008366366 网址：www.hxzq.cn</p>
24	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.1.2 二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司

3.2 登记机构

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

3.3 出具法律意见书的律师事务所

北京市盈科（深圳）律师事务所
注册地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 B 座 3 层
负责人：姜敏
电话：(0755)36866820
传真：(0755)36866661
经办律师：戴瑞冬、付强

3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
执行事务合伙人：李丹
联系人：曹阳
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办注册会计师：薛竞、曹阳

§ 4 基金名称

南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

§ 5 基金的类型

股票型证券投资基金

§ 6 基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

§ 7 基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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。

§ 8 基金的投资策略

8.1 投资策略

1、投资策略

本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动

性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

2、投资管理体制和程序

（1）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。

（2）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、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

（3）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。

研究支持：指数化投资团队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。

投资决策：投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告，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。

组合构建：根据标的指数，基金经理构建组合。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。

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。

投资绩效评估：投资绩效评估：指数化投资团队定期或不定期对基金进行投资绩效评估，以确认组合是否实现了投资预期、组合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。

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，密切跟踪标的指数。

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管理体制和程序做出调整，并在《招募说明书》中列示。

8.2 投资组合管理

8.3 投资决策依据和决策程序

1、构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、适当替代和逐步购入。

本基金采取复制法确定目标组合，其投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性不佳的个股将采用合理方法寻求替代。

2、日常投资组合管理

(1) 可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪，分析其对指数跟踪的影响。

(2) 投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合调整方案，并利用自动化指数交易系统调整投资组合，以实现更好的跟踪标的指数的目的。

(3) 制作并公布申购、赎回清单：以 T 日标的指数权重为基础，考虑 T 日可能发生的上市公司变动情况，设计 T 日的申购赎回清单并公告。

3、定期投资组合管理

基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：

- (1) 定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案并实施；
- (2) 根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案并实施；
- (3) 根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

4、投资绩效评估

- (1) 定期对基金的绩效评估进行，主要是对跟踪偏离度进行评估；
- (2) 指数化投资团队对本基金的运行情况进行量化评估；
- (3) 基金经理根据量化评估报告，重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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

§ 9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 1000 指数。

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

§ 10 基金的风险收益特征

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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§ 11 基金投资组合报告

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

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

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 6 月 30 日（未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	97,204,649.75	96.64
	其中：股票	97,204,649.75	96.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,679.22	0.00
	其中：债券	2,679.22	0.00
	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	2,980,388.12	2.96
8	其他资产	413,600.59	0.41
	合计	100,601,317.68	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而以下“报告期末按行业分类的股票投资组合”的合计项中不含可退替代款估值增值。

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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	888,178.80	0.89
B	采矿业	2,269,020.16	2.27
C	制造业	61,854,308.06	61.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,320,267.63	2.32
E	建筑业	2,650,406.33	2.65
F	批发和零售业	4,139,456.26	4.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,277,029.60	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,885,129.24	9.88
J	金融业	388,415.00	0.39
K	房地产业	3,155,701.94	3.15
L	租赁和商务服务业	1,228,687.64	1.23
M	科学研究和技术服务业	985,433.90	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	1,116,857.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	963,711.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	1,676,691.14	1.68
S	综合	807,387.00	0.81
	合计	96,606,680.70	96.57

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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	513,276.96	0.51
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	85,818.69	0.09
	合计	599,095.65	0.60

1.2.2 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。

1.3 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 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300142	沃森生物	33,500	669,330.00	0.67
2	600779	水井坊	9,200	508,116.00	0.51
3	300347	泰格医药	8,200	507,334.00	0.51
4	300601	康泰生物	6,840	424,422.00	0.42

5	300168	万达信息	19,600	399,840.00	0.40
6	300176	鸿特科技	4,400	364,892.00	0.36
7	600567	山鹰纸业	87,100	336,206.00	0.34
8	002821	凯莱英	3,800	331,474.00	0.33
9	002507	涪陵榨菜	12,800	328,704.00	0.33
10	000735	罗牛山	25,100	324,292.00	0.32

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000048	*ST 康达	7,600	166,440.00	0.17
2	600399	抚顺特钢	20,900	114,950.00	0.11
3	002263	*ST 东南	35,100	103,896.00	0.10
4	300747	锐科激光	1,286	103,342.96	0.10
5	600784	鲁银投资	10,000	54,600.00	0.05

1.4 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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	2,679.22	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	2,679.22	0.00

1.5 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	128023	亚太转债	9	783.45	0.00
2	128019	久立转 2	6	551.10	0.00
3	128037	岩土转债	5	433.25	0.00
4	128018	时达转债	4	347.08	0.00

5	123007	道氏转债	3	305.40	0.00
---	--------	------	---	--------	------

1.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 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。

1.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1812	IC1812	2	2,003,360.00	-178,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-178,640.00
股指期货投资本期收益（元）					-152,520.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-160,960.00

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 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

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。

1.11.2 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。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	412,870.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	729.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	413,600.59

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值 （人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	128023	亚太转债	783.45	0.00
2	128019	久立转 2	551.10	0.00
3	128018	时达转债	347.08	0.00

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

期末积极投资前五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	000048	*ST 康达	166,440.00	0.17	重大事项
2	600399	抚顺特钢	114,950.00	0.11	重大事项
3	002263	*ST 东南	103,896.00	0.10	重大事项
4	600784	鲁银投资	54,600.00	0.05	重大事项

§ 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	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
2016.09.29-2016.12.31	-5.41%	0.88%	-1.18%	0.98%	-4.23%	-0.10%
2017.01.01-2017.12.31	-13.08%	1.01%	-17.35%	1.02%	4.27%	-0.01%
2018.01.01-2018.06.30	-18.83%	1.50%	-20.08%	1.50%	1.25%	0.00%
基金成立-2018.06.30	-33.26%	1.15%	-34.72%	1.17%	1.46%	-0.02%

§ 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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；

- 9、基金上市费及年费；
- 10、基金相关账户的开户及维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人自动于次月前 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：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人自动于次月前 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、基金合同生效后的指数许可使用费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。

指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 1 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。许可使用基点费的支付方式为每季度支付一次。自基金合同生效日起，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内支付上一季度的指数许可使用基点费。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 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。

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，自基金合同生效之日起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，由基金管理人于基金合同生效之日起一个月后的 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。

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、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无需召开基金份额持有人大会。除根据法律法规要求提高该等报酬标准以外，提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

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

2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

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

§ 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“释义”部分,对“释义”进行了更新。
- 3、在“基金管理人”部分,对“基金管理人概况”进行了更新,对“主要人员情况”进行了更新。
- 4、在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。
- 5、在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新,对“审计基金财产的会计师事务所”进行了更新。
- 6、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。
- 7、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。
- 8、在“其他应披露事项”部分,对“其他应披露事项”进行了更新。
- 9、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理股份有限公司
2018年11月6日