**南方策略优化混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要**

（2016年第1号）

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:2016年03月30日

重要提示

本基金经中国证监会2010年1月6日证监许可[2010]9号文核准募集。本基金基金合同于2010年3月30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。

在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；本基金量化投资策略的有关风险等等。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本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。

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2016年3月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日（未经审计）。

§1基金管理人

1.1基金管理人概况

名称：南方基金管理有限公司

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：吴万善

注册资本：3亿元人民币

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。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

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师，中国籍。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、董事长兼党委副书记。现任江苏省农村信用社联合社理事长、党委书记；南方基金管理有限公司董事长。

张涛先生，董事，中共党员，管理学博士，中国籍。1994年8月加入华泰证券，历任总裁秘书、投资银行一部业务经理、上海总部投资银行业务部副总经理、深圳总部兼深圳彩田路营业部总经理、公司董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任、副总裁、党委委员。现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员；华泰长城期货有限公司董事长。

姜健先生，董事，中共党员，毕业于南京农业大学经济及管理专业，获硕士学位，中国籍。1994年12月加入华泰证券并一直在华泰证券工作，历任人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行总部股票事务部副总经理、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经理、资产管理总部总经理、投资银行总部业务总监、总裁助理、副总裁、董事会秘书等职务。现任华泰证券股份有限公司的副总裁、党委委员、董事会秘书；华泰联合证券有限责任公司董事、华泰金融控股(香港)有限公司董事、华泰紫金投资有限责任公司董事、江苏股权交易中心有限责任公司董事长、华泰瑞通投资管理有限公司董事、江苏银行股份有限公司董事、证通股份有限公司董事。

夏桂英女士，董事，中共党员，高级经济师，26年法律公司管理经济工作从业经历。毕业于中国政法大学法律专业，获法学硕士学位，中国籍。曾先后担任中国政法大学中国法制研究所教师、深圳市人大法工委办公室主任科员、深圳市光通发展有限公司办公室主任、深圳市投资管理公司总法律顾问、深圳市对外劳动服务有限公司党总支书记、董事长等职。2004年10月加入深圳市投资控股有限公司，历任法律事务部部长、企业一部部长职务。现任深圳市投资控股有限公司副总经理、深圳市通产集团有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司董事、深圳市城市建设开发（集团）公司董事、深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司董事。

项建国先生，董事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于中南财经大学财务会计专业，中国籍。曾在江西财经大学任教并担任审计教研室副主任，其后在深圳蛇口信德会计师事务所、深圳市商贸投资控股公司、深圳市投资控股有限公司任职，历任深圳市投资控股有限公司投资部部长、投资发展部部长、企业一部部长、战略发展部部长，长期从事投融资、股权管理、股东事务等工作。现任深圳市投控产业园区开发运营公司副总经理、中国深圳对外贸易（集团）有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司监事、华润五丰肉类食品（深圳）有限公司董事、深圳市建筑设计研究总院有限公司董事。

李自成先生，董事，中共党员，硕士研究生学历，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、厦门国际信托有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司总经理。

庄园芳女士，董事，工商管理硕士，经济师，中国籍。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、兴业创新资本管理有限公司董事、兴证（香港）金融控股有限公司董事。

杨小松先生，总裁，中共党员，经济学硕士，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。2012年加入南方基金，担任督察长，现任南方基金管理有限公司董事、总裁、党委副书记。

姚景源先生，独立董事，经济学硕士，中国籍。曾任国家经委副处长、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，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助教、讲师、副教授、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导师，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，工商管理博士，香港证券及投资学会高级资深会员，中国香港籍。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)，香港证券及期货专员办事处，及香港证券及期货事务监察委员会，退休前为该会的法规执行部总监。其后曾任该会法规执行部顾问及香港汇业集团控股有限公司独立非执行董事。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，中共党员，经济学硕士，20年以上证券从业经历，中国籍。毕业于财政部科研所，曾任职于北京市财政局、深圳蛇口中华会计师事务所、京都会计师事务所等机构，先后担任干部、经理、副主任等工作。现担任致同会计师事务所（特殊普通合伙）董事合伙人，中国证监会上市公司并购重组专家咨询委员会委员职务。

周蕊女士，独立董事，法学硕士，中国籍。曾工作于北京市万商天勤（深圳）律师事务所、北京市中伦（深圳）律师事务所、北京市信利（深圳）律师事务所，现任北京市金杜（深圳）律师事务所华南区管理合伙人，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、深商联公共服务联盟副主席、深圳市易尚展示股份有限公司独立董事。

1.2.2监事会成员

舒本娥女士，监事，15年的证券行业从业经历。毕业于杭州电子工业学院会计专业，获学士学位，中国籍。曾任职于熊猫电子集团公司，担任财务处处长工作。1998年10月加入华泰证券，历任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负责人；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、华泰紫金投资有限责任公司董事、华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士，监事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于深圳广播电视大学会计学专业，中国籍。曾在浙江兰溪马涧米厂、浙江兰溪纺织机械厂、深圳市建筑机械动力公司、深圳市建设集团、深圳市建设投资控股公司工作，2004年深圳市投资控股有限公司成立至今，历任公司计划财务部副经理、经理，财务预算部副部长，长期从事财务管理、投融资、股权管理、股东事务等工作，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。

苏荣坚先生，监事，中共党员，高级会计师，大学本科学历，中国籍。历任三明市财政局副科长，厦门信息信达有限公司计财部副经理，厦门国际信托有限公司财务部副总经理、自营业务部总经理、财务总监兼财务部总经理,现任厦门国际信托有限公司总经理助理。

林红珍女士,监事，高级工商管理硕士，中国籍。曾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；1994年进入兴业证券，先后担任计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、财务会计部计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副总经理（主持工作）、风险管理部总经理，现任兴业证券股份有限公司财务部总经理、兴业创新资本管理有限公司监事。

苏民先生，职工监事，硕士研究生，工程师，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监。

张德伦先生，职工监事，中共党员，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，2010年1月加入南方基金管理有限公司，现任人力资源部总监。

徐超先生，职工监事，工商管理硕士，中国籍。曾担任建设银行深圳分行科技部开发中心副经理，2000年10月加入南方基金管理有限公司，历任信息技术部主管、总监助理、副总监、执行总监，现任运作保障部总监。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，中国籍。先后担任金杜律师事务所证券业务部实习律师、浦东发展银行深圳分行资产保全部职员、银华基金管理有限公司监察稽核部法务主管、民生加银基金管理有限公司监察稽核部职员，2008年12月加入南方基金管理有限公司，历任监察稽核部经理、高级经理、总监助理、副总监，现任监察稽核部执行总监。

1.2.3公司高级管理人员

吴万善先生，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。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、南方资本管理有限公司董事长兼总经理。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士，中国籍。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，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，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，中国籍。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。

常克川先生，副总裁，中共党员，EMBA工商管理硕士，中国籍。历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，联合证券（现为华泰联合证券）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，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记、南方资本管理有限公司董事。

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，历任高级研究员、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）、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士，中国籍。历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，历任运作保障部总监、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：2010年3月至2013年3月，刘治平；2013年3月至2013年5月，杨德龙；2013年5月至2015年6月，杨德龙、罗文杰；2015年6月至2016年3月，杨德龙、雷俊；2016年3月至今，雷俊。

雷俊先生，北京大学工学硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员；2014年12月至今，任南方恒生ETF基金经理；2015年4月至今，任南方中证500工业ETF基金经理；2015年4月至今，任南方中证500原材料ETF基金经理；2015年4月至今，任大数据100基金经理；2015年6月至今，任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据300、南方500信息、南方量化成长的基金经理。

1.2.5投资决策委员会成员

总裁杨小松先生，副总裁兼固定收益首席投资官、南方东英资产管理有限公司（香港）董事李海鹏先生，总裁助理兼权益首席投资官史博先生，交易管理部总监王珂女士，专户投资管理部总监蒋峰先生，固定收益部总监韩亚庆先生，数量化投资部总监刘治平先生，研究部执行总监茅炜先生，投资部副总监张原先生。

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”）

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。截止,2015年12月31日，本集团总资产5.475万亿元人民币，高级法下资本充足率12.57%，权重法下资本充足率11.91%。

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60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）、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。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截止3月末新增托管公募开放式基金12只，新增首发公募开放式基金托管规模114.94亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入11.835亿元，同比增长6.789%，托管资产余额7.596万亿元，同比增长104.08%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

（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。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

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2016年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管163只开放式基金及其它托管资产，托管资产为7.596万亿元人民币。

(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。

1. 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。

1. 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。

1. 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级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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《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。

基金管理人有义务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有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据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

3.1.1直销机构

南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田中心区福华一路6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

3.1.2代销机构

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 公司网址：www.cmbchina.com |
| 2 | 中国工商银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人：姜建清 联系人：陶仲伟 客服电话：95588 公司网址：www.icbc.com.cn |
| 3 | 中国建设银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街25号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人：王洪章 电话：010－66275654 传真：010－66275654 联系人：王嘉朔 客服电话：95533 公司网址：www.ccb.com |
| 4 | 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 客服电话：95599 公司网址：www.abchina.com |
| 5 | 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：田国立 客服电话：95566 公司网址：www.boc.cn |
| 6 | 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 公司网址：www.bankcomm.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：王硕 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：高天、虞谷云 联系电话：021-61618888 客服电话：95528 公司网址：www.spdb.com.cn |
| 9 | 中信银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号 办公地址：北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦 法定代表人：常振明 联系人：廉赵峰 电话：010-89937369 客服电话：95558 公司网址：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 公司网址：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：洪崎 联系人：王继伟 电话：010-58560666 传真：010-57092611 客服电话：95568 公司网址：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：010-63639709 客服电话：95595 公司网址：www.cebbank.com |
| 13 | 兴业银行股份有限公司 | 注册地址:福州市湖东路154号 办公地址:福州市湖东路154号 法定代表人:高建平 联系人:李博、卞晸煜 联系电话:021-52629999-218966 客服电话:95561 公司网址:www.cib.com.cn |
| 14 | 平安银行股份有限公司 | 地址：深圳市深南东路5047号 法定代表人：孙建一 联系人：张莉 联系电话：021-38637673 客服电话：95511-3 公司网址:bank.pingan.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：严峻 联系电话：0571-85108309 客服电话：95398 公司网址：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：金煜 联系人：汤征程 联系电话：021-68475521 客服电话：95594 公司网址：www.bankofshanghai.com |
| 17 | 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：孔超 传真：010-66226045 客户服务电话：95526 公司网址：www.bankofbeijing.com.cn |
| 18 | 北京农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区朝阳门北大街16号 办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街16号 法定代表人：王金山 联系人：董汇 电话：010-85605588 传真：010-85605340 客服电话：96198；400-88-96198；400-66-96198 公司网址：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168号 办公地址：上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人：金煜 联系人：李晨 联系电话：021-38575084 客服电话：95594 公司网址：www.bankofshanghai.com |
| 21 | 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：陈幸 联系电话：0769-22119061 客服电话：4001196228 公司网址：www.dongguanbank.cn |
| 22 | 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 公司网址：www.hxb.com.cn |
| 23 | 青岛银行股份有限公司 | 注册地址：山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦 办公地址：山东省青岛市市南区香港中路68号华普大厦 法定代表人：郭少泉 联系人：余庆君 联系电话：0532-68602127 客服电话：（青岛）96588，（全国）400-66-96588 公司网址：www.qdccb.com |
| 24 | 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 公司网址：www.nbcb.com.cn |
| 25 | 南京银行股份有限公司 | 注册地址：南京市玄武区中山路288号 法定代表人：林复 联系人：刘晔 联系电话：025-86775335 客服电话：96400 公司网址：www.njcb.com.cn |
| 26 | 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：山东省临沂市兰山区北京路37号 法定代表人：钱进 联系人：田宇 吕芳芳 联系电话：0539-7877821 0539-7877773 客服电话：400-699-6588 公司网址：www.lsbchina.com |
| 27 | 汉口银行股份有限公司 | 注册地址：江汉区建设大道933号汉口银行大厦 办公地址：江汉区建设大道933号汉口银行大厦 法定代表人：陈新民 联系人：曾武 联系方式：027-82656704 客服电话：96558（武汉）、40060-96558（全国） 公司网址：http://www.hkbchina.com |
| 28 | 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 公司网址：www.zrcbank.com |
| 29 | 浙商银行股份有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市庆春路288号 办公地址：浙江省杭州市庆春路288号 法定代表人：沈仁康 联系人：唐燕 联系电话：0571-87659056 客服电话：95527 公司网址：www.czbank.com |
| 30 | 温州银行股份有限公司 | 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 公司网址：www.wzbank.cn |
| 31 | 重庆银行股份有限公司 | 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：甘为民 联系人：孔文超 电话：023-63799379 传真：023-63792412 客服电话：400-70-96899 公司网址：www.cqcbank.com |
| 32 | 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：王璇 联系电话：0755－25188269 传真：0755-25188785 客服电话：4001961200 公司网址：www.4001961200.com |
| 33 | 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：何沛良 联系人：杨亢 电话：0769-22866270 传真：0769-22866282 客服电话：0769-961122 公司网址：www.drcbank.com |
| 34 | 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：遇玺 电话：0451-86779018 传真：0451-86779018 客服电话：95537，400-60-95537 公司网址：www.hrbb.com.cn |
| 35 | 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：杨黎 联系人：余戈 电话：0991-4525212 传真：0991-8824667 客服电话：0991-96518 公司网址：www.uccb.com.cn |
| 36 | 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：天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦 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 公司网址：www.cbhb.com.cn |
| 37 | 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：唐荟 电话：020-28302742 传真：020-37590726 客服电话：020-96699 公司网址：www.gzcb.com.cn |
| 38 | 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 公司网址：www.hebbank.com |
| 39 | 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 办公地址：大连市中山区中山路88号天安国际大厦 法定代表人：陈占维 联系人：李格格 电话：0411-82356627 传真：0411-82356590 客服电话：400-664-0099 公司网址：www.bankofdl.com |
| 40 | 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) 公司网址：www.hsbank.com.cn |
| 41 | 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：胡健强 电话：0757-22386489 传真：0757-22388235 客服电话：0757-22223388 公司网址：www.sdebank.com |
| 42 | 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：袁福华 联系人：李岩 电话：022-28405684 传真：022-28405631 客服电话：4006-960296 公司网址：www.bank-of-tianjin.com |
| 43 | 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：何赛丽 电话：0579-82178270 传真：0579-82178321 客服电话：400-711-6668 公司网址：www.jhccb.com.cn |
| 44 | 包商银行股份有限公司 | 注册地址：内蒙古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 联系电话：0472-5189051 传真：0472-5189057 客服电话：96016 公司网址：http://www.bsb.com.cn/ |
| 45 | 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：周兆光 电话：020-28019432 传真：020-22389031 客服电话：95313 公司网址：www.grcbank.com |
| 46 | 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：蒋伟 联系人：钟春苗 电话：0756-8121095 传真：0756-8121775 客服电话：96588(广东省外加拨0756)，4008800338 公司网址：www.crbank.com.cn |
| 47 | 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：韩璐 电话：0519-89995066 传真：0519-89995066 客服电话：96005 公司网址：www.jnbank.cc |
| 48 | 吉林银行股份有限公司 | 注册地址：吉林省长春市东南湖大路1817号 办公地址：吉林省长春市东南湖大路1817号 法定代表人：张宝祥 联系人：孙琦 电话：0431-84999627 传真：0431-84992649 客服电话：400-88-96666(全国)96666(吉林省) 公司网址：www.jlbank.com.cn |
| 49 | 杭州联合农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：杭州市建国中路99号 办公地址：杭州市建国中路99号 法定代表人：张晨 联系人：胡莹 电话：0571-87923324 传真：0571-87923214 客服电话：96592 公司网址：www.urcb.com |
| 50 | 厦门银行股份有限公司 | 注册地址：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦 办公地址：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦 法定代表人：吴世群 联系人：刘冬阳 电话：0592-2275261 传真：0592-5373973 客服电话：400-858-8888 公司网址：www.xmbankonline.com |
| 51 | 威海市商业银行股份有限公司 | 注册地址：威海市宝泉路9号  办公地址：威海市宝泉路9号 法定代表人：谭先国 联系人：刘文静 电话：0631-5211651 传真：0631-5215726 客服电话：省内96636、境内4000096636 公司网址：www.whccb.com/www.whccb.com.cn |
| 52 | 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：周坤玉 电话：0536-5293756 传真：0536-5293756 客服电话：0536-96633 |
| 53 | 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司 | 注册地址： 浙江绍兴柯桥笛扬路1363号 办公地址：浙江绍兴柯桥笛扬路1363号 法定代表人： 俞俊海 联系人： 孔张海 电话：0575-84788101 传真：0575-84788100 客服电话：4008896596 公司网址：www.borf.cn |
| 54 | 西安银行股份有限公司 | 注册地址：中国陕西西安高新路60号 办公地址：西安市雁塔区高新路60号 法定代表人：郭军 联系人：白智  电话：029-88992881  传真：029-88992891 客服电话：4008696779 公司网址：www.xacbank.com |
| 55 | 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：熊志强  电话：0512-69868390  传真：0512-69868370 客服电话：96067 公司网址：www.suzhoubank.com |
| 56 | 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：董嘉文  电话：0351-6819579  传真：0351-6819926 客服电话：9510-5588 公司网址：www.jshbank.com |
| 57 | 华融湘江银行股份有限公司 | 注册地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段828号杰座大厦 办公地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段828号杰座大厦 法定代表人：刘永生 联系人：杨舟  电话：0731-89828900  传真：0731- 89828806 客服电话：0731-96599 公司网址：www.hrxjbank.com.cn.cn |
| 58 | 龙江银行股份有限公司 | 注册地址：黑龙江哈尔滨市道里区友谊路436号 办公地址：黑龙江哈尔滨市道里区友谊路436号 法定代表人：张建辉 联系人：闫勇  电话：0451-85706107 传真：0451-85706036 客服电话：4006458888 公司网址：www.lj-bank.com |
| 59 | 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： 蒋尚军 联系人： 张碧华  电话：010-89026813 传真：010-89025421 客服电话：4006696569 公司网址：http://www.klb.cn |
| 60 | 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 公司网址：www.guilinbank.com.cn. |
| 61 | 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：王燕玲  电话：0595-22551071 传真：0595-412411870 客服电话：96312 公司网址: http://www.qzccbank.com/ |
| 62 | 长安银行股份有限公司 | 注册地址：西安市高新技术产业开发区高新四路13号1幢1单元10101室 办公地址：西安市高新技术产业开发区高新四路13号 法定代表人：毛亚社 联系人： 闫石 传真：029-88609566 客服电话：（029）96669、400-05-96669 公司网址：www.ccabchina.com |
| 63 | 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 公司网址：www.jinzhoubank.com |
| 64 | 浙江乐清农村商业银行股份有限公司 | 注册地址： 浙江省乐清市城南街道伯乐西路99号 办公地址：浙江省乐清市城南街道伯乐西路99号  法定代表人： 高剑飞 联系人： 金晓娇 电话：0577-61566028 传真：0577-61566063 客服电话：4008896596 公司网址：www.yqbank.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：吴万善 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 公司网址：http://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：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层 法定代表人：兰荣 联系人：柯延超 联系电话：0591-38507950 客服电话：95562 公司网址：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 公司网址：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：邓颜 联系电话：010-66568292 客服电话：4008-888-888 公司网址：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 公司网址：www.gtja.com |
| 6 | 中泰证券股份有限公司 | 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：马晓男 电话：021-20315255 传真：021-20315137 客服电话：95538 公司网址：www.zts.com.cn |
| 7 | 海通证券股份有限公司 | 注册地址：上海市广东路689号 办公地址：上海市广东路689号 法定代表人：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 公司网址：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 公司网址：广发证券网http://www.gf.com.cn |
| 10 | 长城证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦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 公司网址：www.cgws.com |
| 11 | 招商证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层 法定代表人：宫少林 联系人：黄婵君 联系电话：0755-82960167 客服电话：95565、4008888111 公司网址：www.newone.com.cn |
| 12 | 中信证券股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人：张佑君 联系人：顾凌 电话：010-60838696 传真：010-60833739 客服电话：95558 公司网址：www.cs.ecitic.com |
| 13 | 申万宏源证券有限公司 | 注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号40层 法定代表人：李梅 联系人：李玉婷 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523或4008895523 公司网址: www.swhysc.com |
| 14 | 光大证券股份有限公司 | 注册地址:上海市静安区新闸路1508号 办公地址:上海市静安区新闸路1508号 法定代表人:薛峰 联系人:刘晨 联系电话:021-22169999 客服电话：95525 公司网址：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:高涛 联系人：刘毅 联系电话：0755-82023442 传真0755-82026539 客服电话：400-600-8008、95532 公司网址：www.china-invs.cn |
| 16 | 申万宏源西部证券有限公司 | 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人：李季 电话：010-88085858 传真：010-88085195 联系人：李巍 客户服务电话：400-800-0562 公司网址：www.hysec.com |
| 17 | 湘财证券股份有限公司 | 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：吴昊 联系电话：021-68634510-8620 客服电话：400-888-1551 公司网址：www.xcsc.com |
| 18 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 公司网址：www.essence.com.cn |
| 19 | 中信证券（山东）有限责任公司 | 注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层 办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层 法定代表人：杨宝林 联系人：吴忠超 联系电话：0532-85022326 客服电话：95548 公司网址：www.citicssd.com |
| 20 | 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：王炜哲 联系电话：021-20328309 公司网址：www.bocichina.com |
| 21 | 信达证券股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 法定代表人：张志刚 联系人：唐静 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：95321 公司网址：www.cindasc.com |
| 22 | 民生证券股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A 座16-18层 办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A 座16-18层 法定代表人：余政 联系人：赵明 联系电话：010-85127622 客服电话：4006198888 公司网址：www.mszq.com |
| 23 | 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、23层、25层-29层 办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层 法定代表人：潘鑫军 联系人：胡月茹 联系电话：021-63325888 客服电话：95503 公司网址：www.dfzq.com.cn |
| 24 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街8号 办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12-18层 法定代表人：祝献忠 基金业务联系人：李慧灵 联系电话：010-85556100 传真：010-85556088 客服电话：400-898-9999 公司网址：www.hrsec.com.cn |
| 25 | 华西证券股份有限公司 | 注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人：杨炯洋 联系人：谢国梅 联系电话：010-52723273 客服电话：95584 公司网址: www.hx168.com.cn |
| 26 | 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：杨泽柱 客户服务热线：95579或4008-888-999 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 长江证券客户服务公司网址：www.95579.com |
| 27 | 世纪证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40/42层 办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40/42层 法定代表人：姜昧军 联系人：袁媛 联系电话：0755-83199511 客服电话：4008323000 公司网址：www.csco.com.cn |
| 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：李福春 联系人:安岩岩 联系电话:0431-85096517 客服电话:4006000686，0431-85096733 公司网址：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 办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼 法定代表人：龚德雄 联系人：许曼华 联系电话：021-53686888 客户服务电话：021-962518 传真：021-53686100，021-53686200 公司网址：www.962518.com |
| 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：周俊 电话：0451-85863726 传真：0451-82337279 客服电话：400-666-2288 公司网址：www.jhzq.com.cn |
| 31 | 国联证券股份有限公司 | 注册地址:江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 办公地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 法定代表人:姚志勇 联系人:沈刚 联系电话:0510-82831662 客服电话:95570 公司网址:www.glsc.com.cn |
| 32 | 东莞证券股份有限公司 | 注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 联系人:李荣 联系电话：0769-22115712 传真：0769-22115712 客服电话：95328 公司网址: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：王春峰 联系人:蔡霆 电话：022-28451991 传真：022-28451892 客服电话：400-651-5988 公司网址：www.ewww.com.cn |
| 34 | 平安证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 法定代表人：谢永林 联系人:周一涵 联系电话:021-38637436 客服电话:95511-8 公司网址：stock.pingan.com |
| 35 | 国都证券股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 法定代表人：常喆 联系人：黄静 电话：010-84183333 传真：010-84183311-3389 客服电话：400-818-8118 公司网址：www.guodu.com |
| 36 | 东吴证券股份有限公司 | 注册地址：苏州工业园区星阳街5号 办公地址：苏州工业园区星阳街5号 法定代表人：范力 联系人：方晓丹 电话：0512-65581136 传真：0512-65588021 客服电话：4008601555 公司网址： www.dwzq.com.cn |
| 37 | 广州证券股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 法定代表人：邱三发 联系人：梁微 联系电话：95396 客服电话:020-961303 公司网址：www.gzs.com.cn |
| 38 | 华林证券有限责任公司 | 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号 办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼 法人代表：陈永健 联系人：曲浩元 联系电话：0755-82707988 客服电话:400-188-3888 公司网址:www.chinalions.com |
| 39 | 南京证券股份有限公司 | 注册地址：南京市玄武区大钟亭8号 办公地址：南京市玄武区大钟亭8号 法定代表人：歩国旬 联系人：陈秀丛 联系电话：025-52310550 客服电话：4008285888 公司网址：www.njzq.com.cn |
| 40 | 华安证券股份有限公司 | 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座 法定代表人：李工 联系人：范超 联系电话：0551-65161821 客服电话：95318，4008096518 公司网址：www.hazq.com |
| 41 | 红塔证券股份有限公司 | 注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼 办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼 法定代表人：况雨林 联系人：高国泽 联系电话：0871-63577946 客服电话：4008718880 公司网址：http://www.hongtastock.com |
| 42 | 银泰证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼 办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼 法定代表人：黄冰 联系电话：0755-83706665 客服电话：4008-505-505 公司网址：www.ytzq.com |
| 43 | 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：刘闻川 电话：021-68778790客服电话：4008209898 公司网址：www.cnhbstock.com |
| 44 | 山西证券股份有限公司 | 注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 联系人：郭熠 联系电话：0351－8686659 客服电话：400-666-1618，95573 公司网址：www.i618.com.cn |
| 45 | 第一创业证券股份有限公司 | 注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼  办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼 法定代表人:刘学民 联系人:毛诗莉 联系电话:0755-23838750 客服电话：95358 公司网址:www.firstcapital.com.cn |
| 46 | 华福证券有限责任公司 | 注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18楼 法定代表人：黄金琳 联系人：郭相兴 电话：021-20655175 传真：021-20655196 客服电话：96326（福建省外请先拨0591） 公司网址：www.hfzq.com.cn |
| 47 | 中山证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层 办公地址：深圳市华侨城深南大道9010号 法定代表人：黄扬录 联系人：罗艺琳 联系电话：0755-82570586 客服电话：4001022011 公司网址：http://www.zszq.com |
| 48 | 国海证券股份有限公司 | 注册地址：广西省桂林市辅星路13号 办公地址：广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F 法定代表人：何春梅 联系人：牛孟宇 电话：0755-83709350 传真：0755-83704850 客服电话：95563 公司网址：http://www.ghzq.com.cn |
| 49 | 中原证券股份有限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号 法定代表人：菅明军 联系人：程月艳 范春艳 联系电话：0371-69099882 联系传真：0371-65585899 客服电话：95377 公司网址：www.ccnew.com |
| 50 | 西南证券股份有限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号 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：023-63786633 传真：023-63786212 客服电话：4008-096-096 公司网址：www.swsc.com.cn |
| 51 | 财达证券有限责任公司 | 注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 法定代表人：翟建强 联系人：马辉 联系电话：0311-66006342 客服电话：4006128888 公司网址：www.S10000.com |
| 52 | 德邦证券股份有限公司 | 注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼 办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼 法定代表人：姚文平 联系人：朱磊 电话：021-68761616 传真：021-68767032 客服电话：4008888128 公司网址：www.tebon.com.cn |
| 53 | 中航证券有限公司 | 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼 办公地址：北京市朝阳区安立路60号润枫德尚6号楼3层中航证券 法定代表人：王宜四 联系人：史江蕊 电话：010-64818301 传真：010-64818443 客服电话：400-8866-567 公司网址：http://www.avicsec.com/ |
| 54 | 国元证券股份有限公司 | 注册地址：安徽省合肥市寿春路179号 办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座25层 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 公司网址：www.gyzq.com.cn |
| 55 | 国盛证券有限责任公司 | 注册地址:江西省南昌市北京西路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:俞驰 联系电话:0791-86283080 客服电话：4008222111 公司网址:www.gsstock.com |
| 56 | 中国国际金融股份有限公司 | 注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 办公地址：北京市建国门外甲6号SK大厦 法定代表人：丁学东 联系人：杨涵宇 联系电话：010-65051166 客服电话：400-910-1166 公司网址：www.cicc.com.cn |
| 57 | 大同证券有限责任公司 | 注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层 办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13 法定代表人：董祥 联系人：薛津 电话：0351-4130322 传真：0351-4192803 客服电话：4007121212 公司网址：http://www.dtsbc.com.cn |
| 58 | 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：何其聪 联系人：高洋 联系电话：010-68546709 客服电话：95571 公司网址：www.foundersc.com |
| 59 | 财通证券股份有限公司 | 注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716  办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716  法定代表人：沈继宁 联系人：夏吉慧 联系电话：0571-87925129 客服电话：95336,40086-96336 公司网址：www.ctsec.com |
| 60 | 东海证券股份有限公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼 办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人：朱科敏 联系人：梁旭 客服电话：95531；400-888-8588 公司网址：www.longone.com.cn |
| 61 | 西部证券股份有限公司 | 注册地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层 办公地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦6楼616室 法定代表人：刘建武 联系人：梁承华 电话：029-87406168 传真：029-87406710 客服电话：95582 公司网址：http://www.westsecu.com/ |
| 62 | 新时代证券股份有限公司 | 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 法定代表人：田德军 联系人：田芳芳 联系电话：010-83561146　 客服电话：4006989898 公司网址：www.xsdzq.cn |
| 63 | 瑞银证券有限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 法定代表人：程宜荪 联系人：冯爽 联系电话：010-58328373 客服电话：400-887-8827 公司网址：www.ubssecurities.com |
| 64 | 金元证券股份有限公司 | 注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼 办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层 法定代表人：陆涛 联系人：马贤清 联系电话：0755-83025022 客服电话：4008-888-228 公司网址：www.jyzq.cn |
| 65 | 万联证券有限责任公司 | 注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层 办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层 法定代表人：张建军 联系人:王鑫 联系电话：020-38286651 客服电话:400-8888-133 公司网址：www.wlzq.com.cn |
| 66 | 国金证券股份有限公司 | 注册地址：成都市东城根上街95号 办公地址：成都市东城根上街95号 法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪 联系电话：028-86690057 传真：028-86690126 客服电话：4006600109 公司网址：www.gjzq.com.cn |
| 67 | 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：蔡一兵 客服电话： 400-88-35316（全国） 公司网址:www.cfzq.com |
| 68 | 恒泰证券股份有限公司 | 注册地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 办公地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 法定代表人：庞介民 联系人：魏巍 客服电话：4001966188 公司网址：www.cnht.com.cn |
| 69 | 华龙证券股份有限公司 | 注册地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦 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：邓鹏怡 电话：0931-4890208 传真：0931-4890628 客服电话：95368 公司网址：www.hlzq.com |
| 70 | 华鑫证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号 法定代表人：俞洋 联系人：王逍 电话：021-64339000 传真：021-54967293 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918 公司网址：www.cfsc.com.cn |
| 71 | 日信证券有限责任公司 | 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层 法定代表人：孔佑杰 联系人:陈文彬 客服电话：400-660-9839 公司网址：www.rxzq.com.cn |
| 72 | 英大证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 法定代表人：吴骏 联系人：吴尔晖 联系电话：0755-83007159 客服电话：4000-188-688 公司网址：www.ydsc.com.cn |
| 73 | 中天证券有限责任公司 | 注册地址：沈阳市和平区光荣街23甲 办公地址：沈阳市和平区南五马路121号万丽城晶座4楼中天证券经纪事业部 法定代表人：马功勋 联系人：王力华 联系电话：024-23280810 客服电话：4006180315 公司网址：www.stockren.com |
| 74 | 五矿证券有限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元 办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元 法定代表人：赵立功 联系人：马国栋 电话：0755-83252843 传真：0755-82545500 客服电话：40018-40028 公司网址：www.wkzq.com.cn |
| 75 | 大通证券股份有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层 办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层 法定代表人：李红光 联系人：谢立军 电话：0411-39991807 传真：0411-39673219 客服电话：4008-169-169 公司网址：www.daton.com.cn |
| 76 | 天相投资顾问有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层 法定代表人：林义相 联系人：李景平 客服电话：010-66045678 传真：010-66045518 公司网址：http://www.txsec.com 公司基金网公司网址：www.jjm.com.cn |
| 77 | 联讯证券股份有限公司 | 注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼 法定代表人：徐刚 联系人：郭晴 电话：0752-2119391 传真：0752-2119369 客服电话：95564 公司网址：www.lxzq.com.cn |
| 78 | 东兴证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层 办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层 法定代表人：魏庆华 联系人：汤漫川 电话：010-66555316 传真：010-66555133 客服电话：4008888993 公司网址：www.dxzq.net |
| 79 | 开源证券股份有限公司 | 注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 法定代表人：李刚 联系人：黄芳 电话：029-81887063 传真：029-88447611 客服电话：400-860-8866 公司网址：http://www.kysec.cn |
| 80 | 中邮证券有限责任公司 | 注册地址：陕西省西安市唐延路5号陕西邮政信息大厦9~11层 办公地址：北京市东城区珠市口东大街17号 法定代表人：丁奇文 联系人：邱丽君 电话：010-67017788-9194 传真：010-67017788-9696 客服电话：4008888005 公司网址：www.cnpsec.com |
| 81 | 中国民族证券有限责任公司 | 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：李微 电话：010-59355941 传真：010-56437030 客服电话：4008895618 公司网址：www.e5618.com |
| 82 | 太平洋证券股份有限公司 | 注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层 办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元 法定代表人： 李长伟 联系人：谢兰 电话：010-88321613 传真：010-88321763 客服电话：400-665-0999 公司网址：www.tpyzq.com |
| 83 | 宏信证券有限责任公司 | 注册地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼 办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼 法定代表人： 刘晓亚 联系人：郝俊杰 电话：028-86199278 传真：028-86199382 客服电话：4008366366 公司网址：www.hxzq.cn |
| 84 | 网信证券有限责任公司 | 注册地址：沈阳市沈河区热闹路49号 办公地址： 沈阳市沈河区热闹路49号恒信大厦C座 法定代表人： 王媖 联系人：付钢 电话：024-22955400 传真：024-22955426 客服电话：400-618-3355 公司网址：www.wxzq.com |
| 85 | 天风证券股份有限公司 | 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼 办公地址： 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼 法定代表人： 余磊 联系人：杨晨 电话：027-87107535 传真：027-87618863 客服电话：4008005000 公司网址：www.tfzq.com |
| 86 | 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12F 法定代表人：汪静波 联系人：张裕  电话：021-38509735 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 公司网址：www.noah-fund.com |
| 87 | 深圳众禄金融控股股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 公司网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com |
| 88 | 上海好买基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室；上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-20613999 传真：021-68596916 客服电话：400-700-9665 公司网址：www.ehowbuy.com |
| 89 | 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文一西路1218号1栋202室 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F  法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬 客服电话：4000-766-123 公司网址：www.fund123.cn |
| 90 | 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：单丙烨 电话：021-20691832 传真：021-20691861 客服电话：400-820-2899 公司网址：www.erichfund.com |
| 91 | 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7楼 法定代表人：其实 联系人：黄妮娟 电话：021-54509998 传真：021-64385308 客服电话：400-1818188 公司网址：www.1234567.com.cn |
| 92 | 北京展恒基金销售股份有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层 法定代表人：闫振杰 联系人：翟文、马林 电话：010-59601366 传真：010-62020355 客服电话：4008188000 公司网址：www.myfund.com |
| 93 | 浙江同花顺基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室 办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼 法定代表人：凌顺平 联系人：吴杰 电话：0571-88911818-8653 传真：0571-86800423 客服电话：4008-773-772 公司网址：www.5ifund.com |
| 94 | 中期资产管理有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号 办公地址：北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层 法定代表人：姜新 联系人：侯英建 电话：010-65807865 传真：010-65807864 客服电话：010-65807609 公司网址：http://www.cifcofund.com |
| 95 | 众升财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内 办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08 法定代表人：李招弟 联系人：付少帅 电话：010-59497361 传真：010-64788016 客服电话：400-059-8888  公司网址：www.wy-fund.com |
| 96 | 和讯信息科技有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人：王莉 联系人：张紫薇 电话：0755-82021122  传真：0755-82029055 客服电话：4009200022 公司网址：licaike.hexun.com |
| 97 | 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809 法定代表人：沈伟桦 联系人：王巨明 电话：010-52855713 传真：010-85894285 客服电话：4006099200 公司网址：www.yixinfund.com |
| 98 | 浙江金观诚财富管理有限公司 | 注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室 办公地址：杭州市拱墅区登云路43号金诚集团（锦昌大厦）13楼 法人：徐黎云 联系人：来舒岚 电话：0571-88337888 传真：0571-88337666 客服电话：400-068-0058 公司网址：www.jincheng-fund.com |
| 99 | 泛华普益基金销售有限公司 | 注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 法定代表人：于海锋 联系人：邓鹏 电话：13981713068 传真：028-82000996-805 客服电话：400-8588588 公司网址：http://www.pyfund.cn |
| 100 | 嘉实财富管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 法定代表人：赵学军 联系人：景琪 电话：021-20289890 传真：021-20280110 客服电话：400-021-8850 公司网址：www.harvestwm.cn |
| 101 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 法定代表人：杨懿 联系人：张燕 电话：010-83363099 传真：010-83363072 客服电话：400-166-1188 公司网址：https:/8.jrj.com.cn |
| 102 | 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人：梁越 联系人：马鹏程 电话：010-56810780 传真：010-57756199 客服电话：400-786-8868-5 公司网址：www.chtfund.com |
| 103 | 北京钱景财富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 法定代表人：赵荣春 联系人：高静 电话：010-59158281 传真：010-57569671 客服电话：400-893-6885 公司网址：www.qianjing.com |
| 104 | 深圳宜投基金销售有限公司 | 注册地址：深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405 法定代表人：华建强 联系人：黄晶龙 电话：0755-23601676 传真：0755-88603185 客服电话：4008955811 公司网址：www.ucffund.com |
| 105 | 深圳前海汇联基金销售有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区软件产业基地5栋425 法定代表人： 万勇  联系人：贾海霞 联系电话： 0755-26908083 客服电话：0755-26900826 公司网址：http://www.flyingfund.com.cn |
| 106 | 中国国际期货有限公司 | 注册地址： 北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层 办公地址： 北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层 法定代表人：王兵  联系人： 赵森 电话：010-59539864 传真：010-59539985 客服电话：95162、400-8888-160 公司网址：www.cifco.net |
| 107 | 北京创金启富投资管理有限公司 | 注册地址： 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址： 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  法定代表人： 梁蓉  联系人： 张旭  电话：010-66154828  传真：010-88067526  客服电话：400-6262-818  公司网址：www.5irich.com |
| 108 | 海银基金销售有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元 办公地址：上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场6楼 法定代表人：刘惠 联系人：刘艳妮 电话：021- 80133827 传真：021-80133413 客服电话：400-808-1016 公司网址：www.fundhaiyin.com |
| 109 | 上海联泰资产管理有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层 法定代表人：燕斌 联系人：陈东 电话：021-52822063 传真：021-52975270 客服电话：4000-466-788 公司网址：http://www.66zichan.com |
| 110 | 北京增财基金销售有限公司 | 注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208  办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208  法定代表人：罗细安 联系人：史丽丽 电话：010-67000988-6028 传真：010-67000988-6000 客服电话：010-67000988 公司网址：www.zcvc.com.cn |
| 111 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人：沈继伟 联系人：曹怡晨 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服电话：4000676266 公司网址： www.leadfund.com.cn |
| 112 | 上海汇付金融服务有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层 办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号7层 法定代表人： 金佶 联系人： 陈云卉 电话：021-33323999 传真：021-33323837 客服电话：400-820-2819 公司网址：https://chinapnr.com |
| 113 | 厦门市鑫鼎盛控股有限公司 | 注册地址： 厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 办公地址： 厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 法定代表人：陈洪生 联系人：李智磊 电话：0592-3122716 传真：0592-3122701 客服电话：400-918-0808 公司网址：www.xds.com.cn |
| 114 | 泰康人寿保险股份有限公司 | 注册地址： 北京市复兴门内大街156号泰康人寿大厦 办公地址： 北京市复兴门内大街156号泰康人寿大厦 法定代表人：陈东升 联系人：陈倩 电话：010-61047989 传真：010-61047968 客服电话：400-009-5522 公司网址：www.taikang.com |
| 115 | 中信建投期货有限公司 | 注册地址： 重庆 办公地址： 渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C 法定代表人： 彭文德 联系人：万恋 电话：021-68762007 传真：021-68763048 客服电话：400-8877-780 公司网址：www.cfc108.com |
| 116 | 上海陆金所资产管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人： 郭坚 联系人： 宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 公司网址：www.lufunds.com |
| 117 | 中经北证（北京）资产管理有限公司 | 注册地址： 北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  办公地址： 北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  法定代表人： 徐福星 联系人：李美 电话：18810595051 传真：010-68292941 客服电话：010-68292940 公司网址：www.bzfunds.com |
| 118 | 中信期货有限公司 | 注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 法定代表人： 张皓 联系人： 洪诚 电话：0755-23953913 传真：0755-83217421 客服电话：400-990-8826 公司网址：http://www.citicsf.com |
| 119 | 北京乐融多源投资咨询有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 法定代表人： 董浩 联系人： 张婷婷 电话：18510450202 客服电话：400-068-1176 公司网址：www.jimufund.com |
| 120 | 北京新浪仓石基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦903、906室 法定代表人： 张琪 联系人： 付文红  电话：010-62675657 客服电话：010-62675369 公司网址：http://www.xincai.com |
| 121 | 珠海盈米财富管理有限公司 | 注册地址： 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址： 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔B1201-1203室 法定代表人：肖雯  联系人：黄敏嫦  电话：020-89629099 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 公司网址：www.yingmi.cn |
| 122 | 深圳富济财富管理有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室  法定代表人：齐小贺  联系人：陈勇军 电话：0755-83999907-806  传真：0755-83999926 客服电话：0755-83999907 公司网址：www.jinqianwo.cn |
| 123 | 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司 | 注册地址： 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 办公地址： 北京朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座303 法定代表人： 张鑫 联系人： 刘美薇 电话：010-53570572/13121820670 传真：010-59200800 客服电话：400-819-9868 公司网址：http://www.tdyhfund.com/ |
| 124 | 上海凯石财富基金销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 法定代表人： 陈继武 联系人： 李晓明 电话：021-6333319 传真：021-63332523 客服电话：4000178000 公司网址：www.lingxianfund.com |
| 125 | 大泰金石投资管理有限公司 | 注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室 办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼 法定代表人：袁顾明 联系人：何庭宇 电话：13917225742 传真：021-22268089 客服电话：400-928-2266/021-22267995 公司网址：www.dtfunds.com |
| 126 | 济安财富（北京）资本管理有限公司 | 注册地址： 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室 办公地址： 北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层 济安财富 法定代表人： 杨健 联系人：付志恒  电话：010-65309516-802 传真：010-65330699 客服电话：400-075-6663 公司网址：http://www.jianfortune.com |
| 127 | 中证金牛（北京）投资咨询有限公司 | 注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室 办公地址： 北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F 法定代表人：彭运年 联系人： 孙雯 电话：010-59336519 传真：010-59336500 客服电话：4008-909-998 公司网址：www.jnlc.com |
| 128 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室 办公地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室 法定代表人： 齐凌峰 联系人：阮志凌 电话：010-82151989 传真：010-82158631 客服电话：400-158-5050 公司网址：www.9ifund.com |
| 129 | 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

南方基金管理有限公司

住所及办公地址：广东省深圳市福田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

3.3出具法律意见书的律师事务所

广东华瀚律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室

负责人：李兆良

电话：(0755)82687860

传真：(0755)82687861

经办律师：杨忠、戴瑞冬

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

南方策略优化混合型证券投资基金

§5基金的类型

混合型证券投资基金

§6基金的投资目标

本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

§7基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的各类股票、债券、短期金融工具、现金、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%～95%，债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资占基金资产的比例范围为5%～40%。固定收益类工具主要包括国债、金融债、公司债（企业债）、央行票据、短期融资券、可转换债券、回购、资产证券化产品、货币市场工具等，其中现金以及到期日在1年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他投资品种,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

本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于Black-Litterman模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业内具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。

（一）资产配置策略

本基金在对全球宏观经济情况及证券市场走势把握的基础上，运用国际化的视野审视中国经济和证券市场，并对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，确定本基金的资产配置比例。同时，基金管理人还将严格控制组合风险，调整组合配置，追求风险调整后的最大收益。

（二）行业配置策略

本基金的行业配置策略采用基金管理人开发的基于Black-Litterman模型的“南方量化行业配置模型”。该模型在充分考虑市场均衡的行业配置比例的基础上，加入基金管理人对于各个行业风险收益的预期，从而测算出满足条件的最优化行业配置比例。

“南方量化行业配置模型”根据市场均衡计算出基础行业配置，按Markowitz收益-方差最优化过程得到市场均衡收益的估计值。基金管理人根据宏观经济与行业景气的相关性分析和行业周期性变化特征确定行业评级、行业预期收益等指标，并将上述行业分析的结果构建数量化模型，建立行业预期收益和风险的矩阵，之后将该矩阵作为参数导入“南方量化行业配置模型”，加入特定约束条件后通过数量方法求解，得到经过优化的行业配置比例。

（三）个股投资策略

基于对国内外股票市场大量的实证研究，基金管理人开发了“南方多因子量化选股模型”，模型将影响个股超额收益的因素归纳为以下四个主要方面：

（1）基本面因子

基本面因子主要包括上市公司的盈利能力、现金流情况、财务杠杆水平以及未来成长性等，如主营业务收入、毛利率、每股收益、总资产回报率、企业现金流、资产负债率等指标，上述因子反映了上市公司的当前价值和成长潜力。通过对上市公司大量财务数据的筛选和加工，基金管理人构建了比较完整的股票数据库，其中也包括市场对于上述主要指标的一致预期数据。采用相应的一致预期数据，“南方多因子量化选股模型”可以测算出整体市场对于各个上市公司盈利水平和成长潜力的预期。

（2）价值因子

价值因子主要是指股票的绝对和相对估值水平。价值因子既包含上市公司基本面的信息，也包含股票价格的信息。对于不同行业的股票，该模型根据上市公司经营的特点和历史实证检验结果，采用不同的估值指标，如市盈率、市净率、市现率、市销率、EV/EBITDA等，挑选具有绝对或相对估值吸引力的股票。

（3）市场面因子

市场面因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票所处风格板块的轮动，股票价格的历史波动等。在构建模型的过程中，通过历史数据实证检验的方法确定各个行业最适用的市场面因子，同时动态跟踪相关市场数据，对模型进行不断地检验和修正。

（4）流动性因子

流动性因子也是“南方多因子量化选股模型”的重要组成部分，该因子直接影响投资组合的构建。“南方多因子量化选股模型”采用移动时间窗的方法计算平均成交量、平均流通市值、Amivest流动比率等各种指标，对个股流动性进行衡量。

此外，基金管理人还将对上市公司治理结构、对股价有影响的潜在事件等作进一步定性分析，对模型筛选出的结果进行复核和优化，追求同等条件下的较高收益。

综上，基金管理人将利用“南方多因子量化选股模型”对股票进行综合评分，并根据评分结果配置各行业内具有超额收益能力或潜力的优势个股，从而构建本基金的股票组合。

（四）其他资产投资策略

1、债券投资策略

依据资产配置结果，本基金将在部分阶段以改善组合风险构成为出发点配置债券资产。首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为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和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响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，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

2、权证投资策略

在进行权证投资时,基金管理人将通过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,主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

8.2投资决策依据和决策程序

（一）决策依据

(1)国家有关法律、法规和本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作出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障。

(4)团队投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过投资研究人员的共同努力与分工协作，确定资产配置，由基金经理参考量化分析结果具体执行投资计划。

(5)策略优化投资方式。本基金采用严格的量化股票投资策略，力争克服人为情绪干扰，取得超过业绩基准的稳定收益。

（二）决策程序

(1)决定主要投资原则：投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，决定基金的主要投资原则，确立基金的投资方针及投资方向，审定基金的资产及行业配置方案。

(2)团队投资与投资决策制定：在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，通过投资、研究人员的团队投资、分工协作，由基金经理具体执行投资计划：1)依据投资研究团队对宏观经济、股市政策、市场趋势的判断，结合基金合同、投资制度的要求提出本基金的资产配置建议；2)在投资决策委员会授权及批准的范围内，通过量化分析决定基金的行业配置方案；3)依据投资研究团队对各行业的具体分析与股票候选名单，按照南方基金量化选股模型，结合基金合同、投资制度的要求，在投资决策委员会授权及批准的范围内，制定基金的个股投资方案。

(3)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。

(4)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。

基金管理人将致力于对上述量化选股模型、组合构建方式和投资操作流程不断地进行改造、提高和完善，并在更新的《招募说明书》中列示。

§9基金业绩比较基准

业绩基准为：80％×沪深300指数＋20％×上证国债指数

本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准。沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势。沪深300指数中的成份股的发布和调整均由交易所完成,具有较强的公正性与权威性。债券组合的业绩基准则采用了上证国债指数，上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数,反映我国债券市场整体变动状况,具有较强的市场代表性。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、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业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，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。

§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2015年12月31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 | 400,981,001.22 | 87.32 |
|  | 其中：股票 | 400,981,001.22 | 87.32 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 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 | 52,205,864.66 | 11.37 |
| 8 | 其他资产 | 6,019,564.46 | 1.31 |
| 9 | 合计 | 459,206,430.34 | 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 | 7,557,158.60 | 1.67 |
| B | 采矿业 | 7,784,936.70 | 1.72 |
| C | 制造业 | 261,303,182.73 | 57.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,505,985.99 | 3.42 |
| E | 建筑业 | 14,701,506.80 | 3.25 |
| F | 批发和零售业 | 28,502,102.94 | 6.29 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,968,754.00 | 0.88 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,595,501.46 | 1.24 |
| J | 金融业 | 23,883,860.47 | 5.27 |
| K | 房地产业 | 19,103,454.04 | 4.22 |
| L | 租赁和商务服务业 | 38,400.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 46,900.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,938,184.72 | 1.97 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 189,480.00 | 0.04 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,861,592.77 | 0.85 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 400,981,001.22 | 88.52 |

**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 | 000838 | 财信发展 | 86,500 | 3,479,895.00 | 0.77 |
| 2 | 000002 | 万科A | 137,300 | 3,354,239.00 | 0.74 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 165,500 | 2,825,085.00 | 0.62 |
| 4 | 000018 | 神州长城 | 56,559 | 2,782,702.80 | 0.61 |
| 5 | 002295 | 精艺股份 | 113,700 | 2,682,183.00 | 0.59 |
| 6 | 600774 | 汉商集团 | 94,400 | 2,511,040.00 | 0.55 |
| 7 | 000605 | 渤海股份 | 75,900 | 2,503,941.00 | 0.55 |
| 8 | 600766 | 园城黄金 | 119,500 | 2,435,410.00 | 0.54 |
| 9 | 002656 | 卡奴迪路 | 84,809 | 2,426,385.49 | 0.54 |
| 10 | 000055 | 方大集团 | 168,000 | 2,415,840.00 | 0.53 |

**4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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。

**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（元） |
| 1 | 存出保证金 | 174,806.74 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,656,947.62 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,949.21 |
| 5 | 应收申购款 | 4,176,860.89 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,019,564.46 |

**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**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 000002 | 万科A | 3,354,239.00 | 0.74 | 临时停牌 |

§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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
| 2010.3.3至2010.12.31 | -2.80% | 1.42% | -5.01% | 1.32% | 2.21% | 0.10% |
| 2011.1.1至2011.12.31 | -30.43% | 1.29% | -19.67% | 1.04% | -10.76% | 0.25% |
| 2012.1.1至2012.12.31 | -1.96% | 1.22% | 7.04% | 1.02% | -9.00% | 0.20% |
| 2013.1.1至2013.12.31 | -3.69% | 1.31% | -5.30% | 1.11% | 1.61% | 0.20% |
| 2014.1.1至2014.12.31 | 48.40% | 1.09% | 41.16% | 0.97% | 7.24% | 0.17% |
| 2015.1.1至2015.12.31 | 62.43% | 2.46% | 6.98% | 1.99% | 55.45% | 0.47% |
| 自基金成立起至今 | 53.90% | 1.54% | 16.80% | 1.29% | 37.10% | 0.25% |

§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、基金财产拨划支付的银行费用；

4、基金合同生效后的信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7、基金的证券交易费用；

8、按照国家有关规定和基金合同可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、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1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关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。

三、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。基金合同生效前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。

四、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《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在至少一家指定媒体上刊登公告。

五、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。

13.2与基金销售有关的费用

1、  本基金提供两种申购费用的支付模式。本基金在申购时收取的申购费用称为前端申购费用，在赎回时收取的申购费用称为后端申购费用。基金投资者可以选择支付前端申购费用或后端申购费用。

本基金前端申购费率最高不高于1.5%，且随申购金额的增加而递减，后端申购费率最高不高于1.8%，且随持有时间的增加而递减，如下表所示：

前端收费：

|  |  |
| --- | --- |
| 购买金额（M） | 申购费率 |
| M＜100万 | 1.5% |
| 100万≤M＜500万 | 0.9% |
| 500万≤M＜1000万 | 0.3% |
| M≥1000万 | 每笔1000元 |

后端收费（其中1年为365天）：

|  |  |
| --- | --- |
| **持有期限**（N） | **申购费率** |
| N＜1年 | 1.8% |
| 1年≤N＜2年 | 1.5% |
| 2年≤N＜3年 | 1.2% |
| 3年≤N＜4年 | 0.8% |
| 4年≤N＜5年 | 0.4% |
| N≥5年 | 0 |

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、 本基金赎回费率不高于0.5%，随申请份额持有时间增加而递减（其中1年为365天）。具体如下表所示：

|  |  |
| --- | --- |
| 申请份额持有时间（N） | 赎回费率 |
| N＜1年 | 0.5% |
| 1年≤N＜2年 | 0.3% |
| N≥2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，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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》的有关规定在至少一家指定媒体上公告。

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“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。

3、在“基金托管人”部分，对“基金托管人”进行了更新。

4、在“相关服务机构”部分，对“销售机构”进行了更新。

5、在“基金份额的申购和赎回”部分，对“申购与赎回的数额限制”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。

南方基金管理有限公司

2016年5月5日