



# Disclosure 信息披露

2015年4月25日 星期六  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

# B159

## （上接B157版）

（二）登记机构  
名称:南方基金管理有限公司  
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层塔楼31层法定代表人:吴万善  
电话:(0755) 82733849  
传真:(0755) 82733868  
联系人:古和顺  
（三）出具法律意见书的律师事务所  
名称:广东瀚闻律师事务所  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G14室  
负责人:李兆良  
电话:(0755)82087860  
传真:(0755)82087861  
经办律师:杨忠、戴耀冬  
（四）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号展恒大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:杨绍信  
联系电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238800  
联系人:陈燕  
经办会计师:薛岚、陈燕

## 四、基金名称

上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 五、基金的投资目标

股票型证券投资基金（ETF联接基金）

## 六、基金的投资范围

本基金主要投资于380ETF,标的指数的成份股、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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、股指期货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。其中投资于380ETF的比例不低于基金资产净值的90%。基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

## 八、基金的投资策略

（一）资产配置策略  
本基金为完全被动式公募基金,以380ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资380ETF,本基金并不参与380ETF的交易。  
（二）资产配置策略  
为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于380ETF,其余资产可投资于标的指数的成份股、备选成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。  
在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不得超过0.4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（三）成份股、备选成份股投资策略  
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购380ETF,因此可对投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（四）股指期货投资策略  
本基金股指期货投资将采用自上而下的投资策略,考虑宏观经济分析、资金面向分析等判断未来利率变化,并利用衍生品定价技术,进行一个选择,同时着重考虑股指期货的流动性管理需求,选取到期日在一年以内的股指期货合约进行配置。

（五）股指期货期权的投资策略  
本基金在股指期货期投资中主要遵循有效管理投资风险,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。  
本基金管理人将根据股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

（一）决策依据  
1. 国家有关法律、法规、本基金合同和标的指数的有关规定。  
2. 宏观经济发展态势、宏观经济运行环境和证券市场走势。  
3. 团队投资策略。本基金在投资决策委员会领导下,通过投资研究全体人员的共同努力与分工协作,由基金经理具体制定并执行投资计划,争取对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）决策体制  
本基金投资决策由基金经理在投资决策委员会领导下的团队决策机制。在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,通过投资研究全体人员的团队协作、分工协作,由基金经理具体制定并执行投资计划。

（三）决策程序  
1. 决定主要投资策略: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策略,确立基金的投资策略,审定基金资产的配置方案。  
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,通过投资研究全体人员的团队协作,并由基金经理具体执行投资决策。  
3. 金融工程部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险监测,并提供数量化风险分析报告;研究部门对标的指数的成份股中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告;市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告,供基金经理参考。

4. 投资决策委员会依据金融工程部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决议相关事项。  
5. 基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的前提下,采取适当的方法以降低交易成本,控制投资风险。  
6. 交易部门依据基金经理的指令,制定交易策略,通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖,同时判断执行该投资指令是否将发生违法违规行为,是否会发生特殊交易,是否将要超过比例限制等,履行一线风险监控职责。

7. 金融工程部门根据市场变化定期和定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告,基金经理根据评估报告分析该基金的投资操作,不定期与基金经理交流绩效评估,重点分析基金的跟踪误差和跟踪误差产生原因,现金控制情况,标的指数的成份调整前后的操作,以及成份股未来可能发生的变化等;风控团队对投资计划的执行情况进行日常监督和实时风险控制。  
8. 基金经理跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购赎回情况及组合投资绩效评估的情况,对投资组合进行监控和调整。

本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市场环境变化和实际需要调整上述投资策略,并不予以公告。  
**九、标的指数和业绩比较基准**  
本基金标的指数为上证380指数。  
上证380指数由上海证券交易所和中证指数有限公司于2010年11月29日正式发布,反映了上海证券交易所成长性蓝筹表现,成份股数量380只,上证380指数以2003年12月31日为基日,基点为1000点。  
本基金业绩比较基准为上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%  
如果业绩比较编制办法变更或停止上证380指数的编制、发布或授权,或上证380指数由其他指数替代,或由其他数据编制方法变更或停止上证380指数的编制、发布或授权,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,使得该ETF标的指数发生变更,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,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,变更标的指数及本基金投资范围和投资策略的实质变更,须经基金管理人向基金份额持有人的基金份额持有人大会,并经中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金份额持有人的权益无实质性不利影响(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。

**十、风险收益特征**  
本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,同时本基金为指数型基金,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。  
**十一、基金投资组合报告**  
基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告所载资料,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2014年12月31日(未经审计)。

（一）报告期末本基金资产组合情况

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

（三）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

（四）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债券投资明细

（五）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股指期货投资明细

（六）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权证投资明细

（七）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（八）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（九）投资组合报告附注

（十）其他资产构成

（十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（六十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（六十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（六十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

## （上接B157版）

（二）登记机构  
名称:南方基金管理有限公司  
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层塔楼31层法定代表人:吴万善  
电话:(0755) 82733849  
传真:(0755) 82733868  
联系人:古和顺  
（三）出具法律意见书的律师事务所  
名称:广东瀚闻律师事务所  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G14室  
负责人:李兆良  
电话:(0755)82087860  
传真:(0755)82087861  
经办律师:杨忠、戴耀冬  
（四）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号展恒大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:杨绍信  
联系电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238800  
联系人:陈燕  
经办会计师:薛岚、陈燕

## 四、基金名称

上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 五、基金的投资目标

本基金主要投资于380ETF,标的指数的成份股、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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、股指期货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。其中投资于380ETF的比例不低于基金资产净值的90%。基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

## 八、基金的投资策略

（一）资产配置策略  
本基金为完全被动式公募基金,以380ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资380ETF,本基金并不参与380ETF的交易。  
（二）资产配置策略  
为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于380ETF,其余资产可投资于标的指数的成份股、备选成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。  
在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不得超过0.4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（三）成份股、备选成份股投资策略  
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购380ETF,因此可对投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（四）股指期货投资策略  
本基金股指期货投资将采用自上而下的投资策略,考虑宏观经济分析、资金面向分析等判断未来利率变化,并利用衍生品定价技术,进行一个选择,同时着重考虑股指期货的流动性管理需求,选取到期日在一年以内的股指期货合约进行配置。

（五）股指期货期权的投资策略  
本基金在股指期货期投资中主要遵循有效管理投资风险,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。  
本基金管理人将根据股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证,运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

（一）决策依据  
1. 国家有关法律、法规、本基金合同和标的指数的有关规定。  
2. 宏观经济发展态势、宏观经济运行环境和证券市场走势。  
3. 团队投资策略。本基金在投资决策委员会领导下,通过投资研究全体人员的共同努力与分工协作,由基金经理具体制定并执行投资计划,争取对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）决策体制  
本基金投资决策由基金经理在投资决策委员会领导下的团队决策机制。在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,通过投资研究全体人员的团队协作、分工协作,由基金经理具体制定并执行投资计划。

（三）决策程序  
1. 决定主要投资策略: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策略,确立基金的投资策略,审定基金资产的配置方案。  
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,通过投资研究全体人员的团队协作,并由基金经理具体执行投资决策。  
3. 金融工程部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险监测,并提供数量化风险分析报告;研究部门对标的指数的成份股中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告;市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告,供基金经理参考。

4. 投资决策委员会依据金融工程部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决议相关事项。  
5. 基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的前提下,采取适当的方法以降低交易成本,控制投资风险。  
6. 交易部门依据基金经理的指令,制定交易策略,通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖,同时判断执行该投资指令是否将发生违法违规行为,是否会发生特殊交易,是否将要超过比例限制等,履行一线风险监控职责。

7. 金融工程部门根据市场变化定期和定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告,基金经理根据评估报告分析该基金的投资操作,不定期与基金经理交流绩效评估,重点分析基金的跟踪误差和跟踪误差产生原因,现金控制情况,标的指数的成份调整前后的操作,以及成份股未来可能发生的变化等;风控团队对投资计划的执行情况进行日常监督和实时风险控制。  
8. 基金经理跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购赎回情况及组合投资绩效评估的情况,对投资组合进行监控和调整。

本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市场环境变化和实际需要调整上述投资策略,并不予以公告。  
**九、标的指数和业绩比较基准**  
本基金标的指数为上证380指数。  
上证380指数由上海证券交易所和中证指数有限公司于2010年11月29日正式发布,反映了上海证券交易所成长性蓝筹表现,成份股数量380只,上证380指数以2003年12月31日为基日,基点为1000点。  
本基金业绩比较基准为上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%  
如果业绩比较编制办法变更或停止上证380指数的编制、发布或授权,或上证380指数由其他指数替代,或由其他数据编制方法变更或停止上证380指数的编制、发布或授权,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,使得该ETF标的指数发生变更,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,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,变更标的指数及本基金投资范围和投资策略的实质变更,须经基金管理人向基金份额持有人的基金份额持有人大会,并经中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金份额持有人的权益无实质性不利影响(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。

**十、风险收益特征**  
本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,同时本基金为指数型基金,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。  
**十一、基金投资组合报告**  
基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告所载资料,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2014年12月31日(未经审计)。

（一）报告期末本基金资产组合情况

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

（三）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

（四）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债券投资明细

（五）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股指期货投资明细

（六）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权证投资明细

（七）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（八）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（九）投资组合报告附注

（十）其他资产构成

（十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（二十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（三十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（四十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十三）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十四）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十五）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十六）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十七）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十八）基金资产净值及基金份额持有人信息

（五十九）基金资产净值及基金份额持有人信息

（六十）基金资产净值及基金份额持有人信息

（六十一）基金资产净值及基金份额持有人信息

（六十二）基金资产净值及基金份额持有人信息

## （上接B157版）

（二）登记机构  
名称:南方基金管理有限公司  
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层塔楼31层法定代表人:吴万善  
电话:(0755) 82733849  
传真:(0755) 82733868  
联系人:古和顺  
（三）出具法律意见书的律师事务所  
名称:广东瀚闻律师事务所  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G14室  
负责人:李兆良  
电话:(0755)82087860  
传真:(0755)82087861  
经办律师:杨忠、戴耀冬  
（四）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号展恒大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:杨绍信  
联系电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238800  
联系人:陈燕  
经办会计师:薛岚、陈燕

## 四、基金名称

上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 五、基金的投资目标

本基金主要投资于380ETF,标的指数的成份股、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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、股指期货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。其中投资于380ETF的比例不低于基金资产净值的90%。基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

## 八、基金的投资策略

（一）资产配置策略  
本基金为完全被动式公募基金,以380ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资380ETF,本基金并不参与380ETF的交易。  
（二）资产配置策略  
为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于380ETF,其余资产可投资于标的指数的成份股、备选成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。  
在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不得超过0.4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（三）成份股、备选成份股投资策略  
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购380ETF,因此可对投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（四）股指期货投资策略  
本基金股指期货投资将采用自上而下的投资策略,考虑宏观经济分析、资金面向分析等判断未来利率变化,并利用衍生品定价技术,进行一个选择,同时着重考虑股指期货的流动性管理需求,选取到期日在一年以内的股指期货合约进行配置。

（五）股指期货期权的投资策略  
本基金在股指期货期投资中主要遵循有效管理投资风险,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,