# 南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之改革A与改革B上市交易公告书

## 基金管理人:南方基金管理有限公司
## 基金托管人:海通证券股份有限公司

公告日期:二〇一五年六月十日

### 一、重要声明与提示

《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人南方基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人海通证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2015年5月22日《中国证券报》、2015年5月25日《证券时报》及南方基金管理有限公司网站(www.nffund.com)上公告的《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金招募说明书》。

### 二、基金概览

1、基金名称:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

2、基金类型:股票型

3、基金运作方式:契约型开放式

4、基金份额分级:

本基金的基金份额包括南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称“改革基金”,基金代码:160136)、南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之A份额(场内简称“改革A”,基金代码:150295)与南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之B份额(场内简称“改革B”,基金代码:150296)。其中,改革A份额和改革B份额的数量保持1:1的比例不变。

5、本基金的存续期为不定期。

6、改革A、改革B与改革基金的资产合并运作。

7、南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额的申购与赎回:投资人可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和其他场外销售机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。改革A份额与改革B份额只上市交易,不接受申购和赎回。

8、场内份额配对转换:场内份额配对转换指根据基金合同约定,南方国企改革份额与国企改革A份额和国企改革B份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份场内南方国企改革份额按照1:1的份额配比转换成1份国企改革A份额与1份国企改革B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份国企改革A份额与1份国企改革B份额按照1:1的基金份额配比转换成2份场内南方国企改革份额的行为。场外的南方国企改革份额不进行份额配对转换。在场外的南方国企改革份额通过跨系统转托管至场内后,可按照场内份额配对转换规则进行操作。

9、基金份额折算:基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是基础份额的基金份额净值大于或等于1.5000元时,或改革B的基金份额参考净值小于或等于0.2500元时。有关基金份额折算的约定,参见基金合同“二十、基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。

10、基金份额总额:截至2015年6月8日,本基金的份额总额为868,733,957.36份;其中,基础份额为228,097,334.36份;改革A为320,318,311份;改革B为320,318,312份。

11、基金份额净值:截至2015年6月8日,基础份额的基金份额净值为1.0001元,改革A的基金份额参考净值为1.0009元,改革B的基金份额参考净值为0.9993元。

12、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:份额简称:改革A,交易代码:150295;份额简称:改革B,交易代码:150296。

13、本次上市交易份额:改革A:320,318,311份;改革B:320,318,312份

14、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

15、上市交易日期:2015年6月15日

16、基金管理人:南方基金管理有限公司

17、基金托管人:海通证券股份有限公司

18、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

### 三、基金的募集与上市交易

(一)本次基金上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册批复文号:中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕886号。

2、基金运作方式:契约型开放式

3、基金存续期:不定期

4、发售日期:2015年5月25日至2015年5月29日

5、发售价格:1.00元人民币

6、发售方式:本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

7、发售机构:

①场外销售机构:

1)直销机构:南方基金管理有限公司

2)代销机构:中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、乌鲁木齐市商业银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、河北银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中万宏源证券有限公司、光大证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中万宏源西部证券有限公司、湘财证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、安信证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、中航证券有限公司、国盛证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、大同证券经纪有限责任公司、东海证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、日信证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、五矿证券有限公司、大通证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、联讯证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、宜信普泽投资顾问(北京)有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、泛华普益基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、海银基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、北京增财基金销售有限公司(上述排名不分先后)

②场内代销机构:

场内代销机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

1)已经具有基金代销业务资格的深交所会员单位,具体名单如下:

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国证券、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后,若有变动,以深圳证券交易所网站披露为准)。

2)本基金募集期结束前获得基金代销资格同时具备深交所会员单位资格的证券公司也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。

3)尚未取得基金代销资格,但属于深交所会员的其他机构,可在本基金上市交易后,代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的上市交易。

8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为868,670,319.65元人民币,认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计66,765.59元人民币,按照本基金基金合同和招募说明书的约定,其中63,637.71元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有;其余的3,127.88元为利息折份额计算尾差归入基金财产。

本次募集有效认购总户数为11189户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,募集期募集资金及利息结转的基金份额共计868,733,957.36份,场外认购的基金份额为228,097,334.36份(含募集期利息结转的份额),场内认购的基金份额为640,636,623.00份(含募集期利息结转的份额)。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为3,000.13份(含募集期利息结转的份额),占本基金总份额的比例为0.0003%;本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人认购本基金份额总量的数量区间为0;本基金基金经理认购本基金份额总量的数量区间为0。

募集资金已于2015年6月3日划入本基金在基金托管人处开立的基金托管专户。

10、本基金募集备案情况: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》等相关法律、法规的规定以及《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关约定,本基金募集结果符合备案条件,南方基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2015年6月3日获中国证监会书面确认,本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日:2015年6月3日

12、基金合同生效日的基金份额总额:868,733,957.36份

(二)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上〔2015〕259号

2、上市交易日期:2015年6月15日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

4、基础份额简称及代码:南方中证国有企业改革指数分级,场内简称:改革基金,基金代码:160136。

5、上市交易份额简称及代码:改革A,基金代码:150295;改革B,基金代码:150296。6、本次上市交易份额:改革A为320,318,311份;改革B为320,318,312份

7、基金资产净值的披露:开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值及基础份额的基金份额净值、改革A份额和改革B份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统“市盈率Ⅰ”揭示。根据《基金法》,开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的改革基金份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为改革A份额和改革B份额即可上市流通;对于托管在场外的份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为改革A份额和改革B份额即可上市流通。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期:2015年6月15日,具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)本基金基金份额持有情况

截至2015年6月8日,南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额(“改革基金”)的持有人总户数为6,886户,其中场外持有人总户数为6,886户;改革A持有人总户数为4,299户,全部为场内持有人;改革B持有人总户数为4,299户,全部为场内持有人;改革基金平均每户持有的场外基金份额为33,124.79份,改革A平均每户持有的场内基金份额为74,509.96份,改革B平均每户持有的场内基金份额为74,509.96份。

(二)场内基金份额持有人结构

改革A:场内机构投资者持有的基金份额20,942,897份,占比6.5382%;场内个人投资者持有的基金份额299,375,414份,占比93.4618%。

改革B:场内机构投资者持有的基金份额20,942,891份,占比6.5381%;场内个人投资者持有的基金份额299,375,421份,占比93.4619%。

(三)截至2015年6月8日,场内基金份额前十名持有人情况

1、基金简称:改革A 基金代码:150295

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有基金份额 | 占场内基金份额的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 罗静 | 5,375,366 | 1.68 |
| 2 | 上海大正投资有限公司 | 5,000,340 | 1.56 |
| 3 | 左传丽 | 2,500,170 | 0.78 |
| 4 | 富安达基金-海通证券-富安达-东海恒信6期资产管理计划 | 2,500,049 | 0.78 |
| 5 | 深圳平安大华汇通财富-平安银行-平安汇通-戈方多策略对冲增强8号特定客户资产管理计划 | 2,500,049 | 0.78 |
| 6 | 北京千石创富-华泰证券-南京银行股份有限公司 | 2,500,049 | 0.78 |
| 7 | 陈建国 | 2,000,155 | 0.62 |
| 8 | 陈健 | 1,500,116 | 0.47 |
| 9 | 包一晨 | 1,500,029 | 0.47 |
| 10 | 徐瑞 | 1,500,029 | 0.47 |
| 合计 | | 26,876,352 | 8.39 |

2、基金简称:改革B 基金代码:150296

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有基金份额 | 占场内基金份额的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 罗静 | 5,375,365 | 1.68% |
| 2 | 上海大正投资有限公司 | 5,000,340 | 1.56% |
| 3 | 左传丽 | 2,500,170 | 0.78% |
| 4 | 富安达基金-海通证券-富安达-东海恒信6期资产管理计划 | 2,500,048 | 0.78% |
| 5 | 深圳平安大华汇通财富-平安银行-平安汇通-戈方多策略对冲增强8号特定客户资产管理计划 | 2,500,048 | 0.78% |
| 6 | 北京千石创富-华泰证券-南京银行股份有限公司 | 2,500,048 | 0.78% |
| 7 | 陈建国 | 2,000,156 | 0.62% |
| 8 | 陈健 | 1,500,115 | 0.47% |
| 9 | 包一晨 | 1,500,029 | 0.47% |
| 10 | 徐瑞 | 1,500,029 | 0.47% |
| 合计 | | 26,876,348 | 8.39% |

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

### 五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、名称:南方基金管理有限公司

2、法定代表人:吴万善

3、总裁:杨小松

4、注册资本:人民币3亿元

5、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

6、设立批准文号:中国证监会证监基字〔1998〕4号

7、工商登记注册的法人营业执照文号:440301103129537

8、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

9、股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

10、内部组织结构及职能:

| 委员会名称 | 职责 |
|---|---|
| 投资决策委员会 | 指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则 |
| 风险控制委员会 | 研究制定风险管理政策和制度,提出重大风险的解决方案,指导和监督各职能部门开展风险管理工作 |
| 估值委员会 | 负责公司估值原则的确定及调整;对特殊品种及特殊情况的估值予以确定。 |
| 信息技术治理委员会 | 负责公司中长期信息技术的规划及信息技术治理工作。 |
| 市场营销委员会 | 审议公司营销、宣传、产品设计等方案;督促并指导市场体系各部门的工作; |
| 年金投资决策委员会 | 对年金大类资产配置进行决策。 |

| 部门名称 | 职能定位 |
|---|---|
| 投资部 | 负责公募股票类基金产品的投资管理 |
| 研究部 | 负责宏观策略、行业与上市公司研究 |
| 专户投资管理部 | 负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理 |
| 固定收益部 | 负责固定收益类基金产品及资产的投资管理 |
| 国际业务部 | 负责国际基金的投资管理与业务合作 |
| 数量化投资部 | 负责数量化基金、指数基金的投资运作及数量化投资策略、金融工程的研究 |
| 产品开发部 | 负责产品开发、设计、报批及产品管理工作 |
| 养老金业务部 | 负责企业年金基金的市场开拓与服务 |
| 机构业务部 | 负责机构直销及一对一专户产品的业务拓展及服务工作 |
| 企划部 | 负责品牌及产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护 |
| 市场管理部 | 负责对各营销中心的监督管理、代销渠道总部的开发及维护、渠道经理的培训等 |
| 北京分公司 | 负责所辖片区的渠道、机构销售业务及政府部门、监管机构、行业协会的公共关系维护和相关接待及后勤服务工作 |
| 上海分公司 | |
| 合肥分公司 | |
| 成都分公司 | |
| 深圳分公司 | |
| 电子商务部 | 负责基金产品的网上销售及公司网站建设 |
| 客户服务部 | 为基金持有人提供专业服务及投资理财资讯服务 |
| 合肥理财中心 | CALL-CENTER 客户营销及服务中心 |
| 监察稽核部 | 负责合规及运作风险的全面管理 |
| 风险管理部 | 负责投资风险识别、评估、控制、应急处理及业绩归因分析 |
| 交易管理部 | 负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控 |
| 信息技术部 | 负责信息技术平台建设,保障业务开展 |
| 运作保障部 | 负责投资交易与产品销售的后台清算、核算及投资运作的定期信息披露 |
| 人力资源部 | 负责人力资源管理与服务,使公司获取并保持人力资源竞争优势 |
| 综合管理部 | 负责办公管理、财务管理、后勤保障及公司社会公益事业建设,党务及共青团、工会工作 |
| 基建办 | 负责公司办公大楼的基建工作 |

11、人员情况:

截止到2015年3月,我公司共有员工414人,博士20人、硕士234人、本科141人、其他19人。

12、信息披露负责人:鲍文革

咨询电话:400-889-8899

13、基金管理业务情况简介:

截至2015年3月底,南方基金管理有限公司旗下共管理60只开放式基金及多只专户产品、社保投资组合和企业年金投资组合,管理总资产规模约2800亿元人民币,旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南方多利、南稳贰号、南方绩优、南方隆元、南方成份、南方价值、南方盛元、南方恒元、南方300联接、南方500、深成ETF、南方深成、南方全球、南方策略、小康ETF、南方小康、南方广利、南方金砖、南方成长、南方50债、南方保本、380ETF、南方380、南方中国、南方消费、南方金利、南方润元、南方理财14天、南方高端装备、南方理财60天、南方安心、南方理财30天、500ETF、300ETF、南方永利、南方中票、南方稳利、南方丰元、南方聚利、南方医保、南方现金通、南方新优享、南方通利、中国梦基金、南方薪金宝、南方天元、南方启元、500医药、南方绝对收益、南方理财金、恒指ETF、南方产业活力、南方双元、南方创新经济;以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

14、本基金基金经理简介

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。

(二)基金托管人

1、基本情况

名称:海通证券股份有限公司

住所:上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦

法定代表人:王开国

成立时间:1988年8月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行银复〔1988〕383号

组织形式:股份有限公司

注册资本:95.8472亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:证监许可〔2013〕1643号

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

2、主要人员情况

王开国先生,海通证券董事长兼执行董事、党委书记,厦门大学经济学博士,高级经济师。1990年7月至1995年2月在国家国有资产管理局科研所担任多个职位,并任科研所副所长,1992年3月至1994年2月担任国家国有资产管理局政策法规司政研处处长。1995年2月担任海通证券副总经理,1997年11月担任海通证券总经理,1998年5月起担任海通证券董事长,1998年12月起担任海通证券党委书记,1999年4月起担任上交所理事,2002年7月起担任中国证券业协会副会长。

陈春钱先生,海通证券总经理助理,负责公司经纪业务。陈先生还兼任公司经纪业务委员会主任、国际业务协调委员会委员、战略发展与IT治理委员会委员和中国证券业协会证券经纪业专业委员会委员。陈先生于1988年7月获安徽财经学院经济学硕士学位并于1995年7月获厦门大学经济学博士学位,拥有17年的证券业工作及管理经验。1997年10月至1998年1月,担任公司深圳分公司业务部负责人;1998年1月至2000年3月,担任国际业务部副总经理;2000年3月至2000年12月,担任深圳分公司副总经理;2000年12月至2006年5月,担任投资管理部(深圳)总经理;2006年5月至2013年2月,担任销售交易总部总经理,其间2007年11月至2009年3月兼任机构业务部总经理。

朱元元女士,海通证券基金托管部总经理,本科学历,高级经济师,拥有22年证券业工作及管理经验。1995年7月加入海通证券,曾任海通证券绍兴营业部业务部副经理、绍兴营业部投资银行部经理、绍兴营业部总经理助理、绍兴营业部副总经理。2005年3月起任海通证券绍兴营业部总经理,2010年1月起任海通证券浙江分公司总经理,2014年6月起任海通证券基金托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

海通证券于2013年12月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格,是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司,海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。

(三)验资机构

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:杨绍信

联系人:陈熹

联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:汪棣 陈熹

### 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

### 七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金2015年6月8日资产负债表如下:

| 资产 | 期末余额 | 负债和所有者权益 | 期末余额 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | 负债: | |
| 银行存款 | 868,670,319.65 | 短期借款 | |
| 结算备付金 | | 交易性金融负债 | |
| 存出保证金 | | 衍生金融负债 | |
| 交易性金融资产 | | 卖出回购金融资产款 | |
| 其中:股票投资 | | 应付证券清算款 | |
| 基金投资 | | 应付赎回款 | |
| 债券投资 | | 应付管理人报酬 | 119,007.37 |
| 资产支持证券投资 | | 应付托管费 | 23,801.47 |
| 衍生金融资产 | | 应付销售服务费 | |
| 买入返售金融资产 | | 应交税费用 | |
| 应收证券清算款 | | 应付税费 | |
| 应收利息 | 195,450.80 | 应付利息 | |
| 应收股利 | | 应付利润 | |
| 应收申购款 | | 其他负债 | 9,087.72 |
| 其他资产 | 66,765.59 | 负债合计 | 151,896.56 |
| | | 所有者权益: | |
| | | 实收基金 | 868,733,957.36 |
| | | 未分配利润 | 46,682.12 |
| | | 所有者权益合计 | 868,780,639.48 |
| 资产合计: | 868,932,536.04 | 负债与持有人权益总计: | 868,932,536.04 |

### 八、基金投资组合

截止到2015年6月8日,南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金的投资组合如下:

(一)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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 868,670,319.65 | 99.97 |
| 7 | 其他资产 | 262,216.39 | 0.03 |
| 8 | 合计 | 868,932,536.04 | 100.00 |

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

(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

注:本基金本报告期末未持有股票。

(四)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。

(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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

(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。

(七)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。

(八)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。

(九)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。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(十)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。

(十一)投资组合报告附注

1.其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | |
| 2 | 应收证券清算款 | |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收利息 | 195,450.80 |
| 5 | 应收申购款 | |
| 6 | 其他应收款 | 66,765.59 |
| 7 | 待摊费用 | |
| 8 | 其他 | |
| 9 | 合计 | 262,216.39 |

2.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期内未投资可转换债券。

3.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

### 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

### 十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

### 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《证券基金法》、《公开募集证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二)根据《证券基金法》、《公开募集证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算及基础份额的基金份额净值、改革A份额和改革B份额的基金份额参考净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反《证券基金法》、《公开募集证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;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,基金托管人将及时向中国证监会报告。

### 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

### 十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。

(一)中国证监会准予南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金注册的批复

(二)《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金托管协议》

(四)《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金招募说明书》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

(八)中国证监会要求的其他文件。

南方基金管理有限公司
二〇一五年六月十日

**附件:基金合同摘要**

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

①依法募集资金;

②自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

③依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

④销售基金份额;

⑤按照规定召集基金份额持有人大会;

⑥依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

⑦在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

⑧选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

⑨担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务;

⑩依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

⑪在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和配对转换申请;

⑫依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

⑬在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通;

⑭以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

⑮选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

⑯在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、配对转换、定投和非交易过户等业务规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金份额调高管理费率、托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

⑰在遵守届时有效的法律法规和监管规定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项,基金管理人有权代表基金份额持有人在必要限度内以基金资产作为质押进行融资;

⑱委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务;

⑲法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

①依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

②办理基金备案手续;

③自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

⑥除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

⑦依法接受基金托管人的监督;

⑧采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定南方国企改革份额申购、赎回的价格、国企改革A份额和国企改革B份额的基金份额参考净值;

⑨进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

⑩编制季度、半年度和年度基金报告;

⑪严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

⑫保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

⑬按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

⑭按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

⑮依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

⑯按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

⑰确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

⑱组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

⑲履临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

⑳因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

㉑监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

㉒当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

㉓以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;㉔基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

㉕执行生效的基金份额持有人大会的决议;

㉖建立并保存基金份额持有人名册;

㉗法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

①自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

②依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

③监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

④根据相关市场规则,为基金开设证券账户、期货账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货等交易资金清算;

⑤提议召开或召集基金份额持有人大会;

⑥在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

⑦法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法