

南华基金管理有限公司

南华丰淳混合型证券投资基金

招募说明书（更新）摘要

2019 年第 2 号

基金管理人：南华基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二零二零年一月

## 重要提示

南华丰淳混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2017年9月30日证监许可【2017】1786号文注册募集。本基金基金合同于2017年12月26日正式生效。

基金管理人保证《南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书》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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、本基金特有的风险及其他风险等。

本基金为混合型基金，风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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交易的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、权证、同业存单、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）以及现金，以及法律法规或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相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金初始募集面值为人民币 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过50%的除外。

本基金的目标客户不包括特定的机构投资者。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 12 月 25 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 9 月 30 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：南华基金管理有限公司

住所：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

办公地址：北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦三层

邮政编码：100007

法定代表人：朱坚

成立日期：2016年11月17日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]2371号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

联系人：吴海燕

联系电话：4008105599

股权结构：南华期货股份有限公司占公司注册资本的100%。

存续期间：持续经营

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

叶柯先生：董事长，博士。1992年参加工作，先后在中国证监会期货监管部、中国证监会稽查二局、中国证监会期货监管二部和南华期货股份有限公司工作。2016年12月加入南华基金管理有限公司。

朱坚先生：董事，硕士。1993年7月至1996年7月先后任职于浙江新华期货经纪有限公司、浙江远通期货经纪有限公司、浙江汇诚期货经纪有限公司；1996年7月至2002年6月任浙江金迪期货经纪有限公司营业部经理；2002年6月至2004年11月任浙江新华期货经纪有限公司总经理助理；2004年11月至2008年7月在南华期货股份有限公司从事业务

管理工作，自 2008 年 7 月起任南华期货股份有限公司总经理助理。2018 年 8 月加入南华基金管理有限公司，现任南华基金管理有限公司总经理，并代任督察长。

马易升先生：董事，博士。2010 年参加工作，任职于横店集团控股有限公司，担任企业运营分析部部长。

陈松男先生：独立董事，博士。1978 年参加工作，先后就职于马里兰大学、台湾政治大学，上海交通大学高级金融学院。历任马里兰大学教授、台湾政治大学教授兼系主任、上海交通大学高级金融学院教授。

王艳涛先生：独立董事，法学学士。1998 年参加工作，先后在北京市嘉和律师事务所、国浩律师集团（北京）事务所、北京市海铭律师事务所、北京市荣诚律师事务所工作。历任北京市嘉和律师事务所律师、国浩律师集团（北京）事务所律师、北京市海铭律师事务所合伙人律师、北京市荣诚律师事务所工作主任律师。

朱国华先生：独立董事，硕士研究生。1983 年参加工作，任职于上海财经大学。曾兼任上海金鹏期货经纪公司董事长、总经理。现任上海财经大学教授、博士生导师。

## 2、监事会成员

根据公司《章程》第六十六条规定，公司不设监事会，设一名执行监事，执行监事由职工代表连省担任。

连省先生：执行监事，大专，2000 年 7 月至 2005 年 10 月就职于中国工商银行资产托管部，2005 年 11 月至 2006 年 10 月就职于申万巴黎基金管理公司基金营运总部担任基金会计，2006 年 11 月至 2016 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司运作部从事注册登记。2016 年 12 月加入南华基金管理有限公司。

## 3、高级管理人员

叶柯先生：董事长，简历同上。

朱坚先生：总经理，并代任督察长，简历同上。

王明德先生：硕士，现任南华基金管理有限公司副总经理，1999 年至 2000 年任职于北京中怡康经济咨询有限责任公司，担任研究员。2000 年至 2002 年任职于北京国际信托投资公司，担任研究员。2002 年至 2011 年任职于国都证券有限责任公司，历任研究所副所长、所长。2011 年至 2015 年任职于东兴证券股份有限公司，担任研究所所长。2015 年至 2017 年任职于泓德基金管理有限公司，担任总经理助理兼投研总监。2017 年 4 月加入南华基金管理有限公司，现任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 4 月 10 日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019 年 4 月 11 日起

任职）。

曾媛：学士学位，现任南华基金管理有限公司副总经理。2003年7月至2006年12月于招商银行深圳上步支行，任客户经理；2007年1月至2010年7月于华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级渠道经理。2010年8月至2013年6月于上投摩根基金管理有限公司，任华南区域中心代销总监。2014年1月至2015年6月于圆信永丰基金管理有限公司，任全国渠道总监兼华南区总经理。2015年8月至2019年9月于信达澳银基金管理有限公司，任销售总监。2019年9月加入南华基金管理有限公司。

蔡晓永先生：大专，现任南华基金管理有限公司首席信息官。2006年8月至2019年7月，在南华期货股份有限公司网络工程部工作，2009年7月起先后任该部门副经理、经理职务。2019年8月入职南华基金管理有限公司。

周昱峰先生：经济学硕士，注册会计师。现任南华基金管理有限公司总经理助理，量化投资与产品负责人。历任华夏证券有限公司交易部、经纪业务管理总部高级经理。华泰柏瑞基金管理有限公司营销管理总部总监。方正富邦基金管理有限公司产品总监。方正富邦创融资产管理有限公司副总经理，投资经理。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年12月14日起任职）。

蔡峰先生：经济学博士，现任南华基金管理有限公司总经理助理。2010年至2016年任职于国元证券股份有限公司金融工程部；2016年至2018年任职于华商基金管理有限公司机构投资二部。2018年7月加入南华基金管理有限公司。

#### 4、本基金基金经理

刘斐先生：硕士，现任南华基金管理有限公司权益投资部基金经理。2008年至2009年，任职于天相投资顾问有限公司，担任研究员。2009年至2012年，任职于国都证券有限责任公司，担任研究员。2012年至2013年，任职于长城证券股份有限公司，担任研究员。2013年至2015年，任职于东兴证券股份有限公司，担任研究员。2015年至2017年，任职于泓德基金管理有限公司，担任研究员。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理（2017年8月16日起任职）、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理（2017年12月26日起任职）。

曹进前先生：硕士，注册会计师，现任南华基金管理有限公司固定收益部基金经理。2008年至2010年任职于毕马威华振会计师事务所，担任审计师。2010年至2015年任职于泰康资产管理有限责任公司，担任年金投资部投资助理。2015年至2017年任职于泓德基金有限公司交易部，担任中央交易员、债券交易主管。2017年3月加入南华基金管理有限公司，

现任南华丰淳混合型证券投资基金基金经理（2017年12月26日起任职）、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年3月15日起任职）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理（2019年1月17日起任职）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理（2019年1月29日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019年4月11日起任职）、南华价值启航纯债债券型证券投资基金基金经理（2019年11月22日起任职）。

#### 5、投资决策委员会成员

##### 主席：

王明德先生：副总经理，简历同上。

##### 成员：

朱坚先生：总经理，代任督察长，简历同上。

曹进前先生：基金经理，简历同上。

刘斐先生：基金经理，简历同上。

尹粒宇先生：硕士，现任南华基金管理有限公司基金经理。2009年至2012年任职于成都银行新都支行。2012年至2013年任马来西亚丰隆银行环球金融市场部外币及衍生品交易员。2013年至2017年任成都银行资金部本币市场交易员。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年3月15日起任职）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理（2019年1月17日起任职）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理（2019年1月29日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019年4月11日起任职）、南华价值启航纯债债券型证券投资基金基金经理（2019年11月22日起任职）。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### 三、基金管理人的职责

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，确定基金份额申购、赎回的价格；

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者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者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前提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、面临解散、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。

#### 四、基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事使基金承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人

在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，或以变更后的规定为准进行运作，不需要经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

- （1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取利益。
- （2）不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密以及尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
- （4）不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

#### 五、基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

- （1）健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- （2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。
- （3）独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
- （4）相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

（5）成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 2、内部控制的主要内容

内部控制的内容包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

### （1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构和内部控制体系。董事会下设风险控制委员会，负责审查公司监察稽核、风险管理工作情况，负责对公司合规管理制度、风险控制制度的执行情况进行监督，监督公司内部审计制度的实施，对重大关联交易进行审查和评价。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，经理层下设投资决策委员会和风险管理委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议，投资决策委员会是基金的最高投资决策机构。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事会和中国证监会报告。

### （2）风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

1) 董事会下属的风险控制委员会和督察长对公司内外部风险进行评估；

2) 公司经理层下设的风险管理委员会负责对公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；

3) 各级部门负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

### （3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离等政策、程序或措施。

控制活动体现为：自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度、授权制度、资产分离制度等，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

### （4）信息与沟通

公司建立双向的信息交流途径，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。公司根据组织架构和授权制度，建立了清晰的业务报告系统。

#### （5）内部监控

内部监控由公司风险控制委员会、督察长、风险管理委员会和监察稽核部等部门在各自的职权范围内开展。督察长和监察稽核部门履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

- （1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- （2）上述关于内部控制的披露真实、准确；
- （3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1.基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)

住所：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A座

法定代表人：张金良

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：810.31亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复〔2006〕484号

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2009〕673号

联系人：马强

联系电话：010—68857221

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

## 2.主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、产品管理处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工 27 人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，90%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

## 3.托管业务经营情况

2009 年 7 月 23 日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第 16 家托管银行。2012 年 7 月 19 日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2019 年 9 月 30 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 97 只。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 39978.5 亿元。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### 1.内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2.内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制处室，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

### 3.内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、

使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、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

#### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，对违法违规行为及时予以风险提示，要求其限期纠正，同时报告中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，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开支情况进行检查监督。

#### 2. 监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：南华基金管理有限公司

注册地址：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

办公地址：北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦三层

法定代表人：朱坚

全国统一客户服务电话：4008105599

传真：010-58965905

联系人：张艳梅

电话：010-58965981

公司网站：[www.nanhuafunds.com](http://www.nanhuafunds.com)

个人投资者还可通过本公司网上交易系统认购本基金，网上交易系统网址：  
<https://trade.nanhuafunds.com/etrading/>。

#### 2、其他销售机构

##### （1）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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

联系人：张建伟

电话：010-66594587

客户服务电话：95566

##### （2）交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：彭纯

联系人：王菁

电话：021-58781234



传真：021-58408483

客户服务电话：95559

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

（3）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：广东省广州市天河北路183号大都会广场18楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

客户服务电话：95575

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

（4）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45层（邮编200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：陈宇

联系电话：021-33388214

（5）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层陆家嘴金融服务广场二期11层

法定代表人：张跃伟

联系人：朱睿

电话：021-20691942

传真：021-20691861

客户服务电话：400-820-2899

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

（6）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：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：何薇

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户服务电话：95021/400-181-8188

网址：<http://www.1234567.com.cn/>

（7）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

法定代表人：李琦

传真：0991-2301927

客户服务电话：400-800-0562

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

联系人：陈宇

联系电话：021-33388214

（8）南华期货股份有限公司

注册地址：杭州市西湖大道 193 号二层、三层

办公地址：杭州市西湖大道 193 号二层、三层

法定代表人：罗旭峰

联系人：王雨晴

电话：021-68755275

传真：021-50431973

客户服务电话：400-8888-910

网址：[www.nanhua.net](http://www.nanhua.net)

（9）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路 355 号岗厦皇庭中心 8 楼 E

法定代表人：高锋

联系人：付燚杰

电话：0755-83655518

客户服务电话：400-804-8688

网址：<https://www.keynesasset.com/>

（10）天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：李明然

电话：010-59013825

客户服务电话：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

（11）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客户服务电话：95310

（12）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：袁伟涛

电话：029-63387256

客户服务电话：95325/400-860-8866

（13）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

联系人：孟召社

电话：021-20324176

客户服务电话：400-928-2266

注：公司自 2019 年 1 月 29 日起暂停该机构办理本公司旗下基金产品的认购、申购、定期定额投资及转换业务，赎回业务正常办理。

（14）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：秦夏

电话：010-60838614

客户服务电话：95548

（15）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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：0532-85022026

客户服务电话：95548

（16）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：刘宏莹

电话：010-60833754

客户服务电话：400-990-8826

## （17）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市益田路江苏大厦 38-46 层

办公地址：中国深圳福田区益田路江苏大厦 A 座 30 楼

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

客户服务电话：95565

## （18）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

联系人：徐步夷

电话：021-23154405

客户服务电话：95553/400-8888001

## （19）粤开证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系电话：0755-83331195

客户服务电话：95564

公司网址：<http://www.ykzq.com>

## （20）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：北京东城区朝内大街 2 号 凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

电话：010-85156310

客户服务电话：400-888-8108

## （21）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人：林卓

联系人：徐江

电话：0411-88891212

客户服务电话：400-0411-001

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

（22）中国银河证券股份有限公司

住 所：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 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-83574507

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

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

（23）首创证券有限责任公司

住 所：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

联系人：刘宇

电话：010-59366070

客户服务电话：400-620-0620

网址：<http://www.sczq.com.cn/>

（24）湘财证券股份有限公司

住 所：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：江恩前

电话：021-38784580

客户服务电话：95351

网址：<http://www.xcsc.com/>

（25）深圳前海财厚基金销售有限公司

住 所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道 深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

联系人：胡馨宁

电话：0755-22676026

客户服务电话：400-128-6800

网址：[www.caiho.cn](http://www.caiho.cn)

（26）西藏东方财富证券股份有限公司

住 所：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

（27）上海联泰基金销售有限公司

住 所：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：中国（上海）长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

电话：021-52822063

客服电话：400-166-6788

公司网址：<http://www.66liantai.com/>

（28）上海基煜基金销售有限公司

住 所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077

客服电话：400-820-5369

公司网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

（29）南京苏宁基金销售有限公司

住 所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1 号苏宁总部

法定代表人：王锋

联系人：张慧

电话：025-66996699-882796

客服电话：95177

公司网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

（30）东海证券股份有限公司

住 所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

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：陈耀庭

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：95531；400-888-8588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（31）诺亚正行基金销售有限公司

住 所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

电话：021-80358749

客服电话：400-821-5599

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)



## （32）杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市下城区庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市下城区庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：陈震山

联系人：汪绪恒

联系电话：0571-87094708

客服电话：95398

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

## （33）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

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

## （34）珠海盈米基金销售有限公司

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 12 楼 B1201-1203

法人：肖雯

联系人：熊艳芳

联系电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

## （35）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客服电话：400-673-7010

传真：010-65330699

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

(36) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(37) 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 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

电话：010-59336544

传真：010-59336586

客服电话：4008-909-998

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

(38) 扬州国信嘉利基金销售有限公司

公司地址：扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320

法定代表人：刘晓光

联系人：苏曦

联系电话：0514-82099618

客服电话：400-021-6088

网址：[www.gxjlc.cn](http://www.gxjlc.cn)

(39) 上海陆金所基金销售有限公司

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

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客服电话：400-821-9031

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

（40）海银基金销售有限公司

注册地址：上海市自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市自由贸易试验区银城中路8号402室

法定代表人：巩巧丽

联系人：秦琼

联系电话：021-80134149

客服电话：400-808-1016

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

（41）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

联系电话：010-62680527

客服电话：400-619-9059

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

（42）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

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客服电话：95318

网址：<http://www.hazq.com/>

## 二、基金登记机构

名称：南华基金管理有限公司

注册地址：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

注册登记业务办公地址：北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦三层

法定代表人：朱坚

全国统一客户服务电话：4008105599

传真：010-58965908

联系人：王磊

三、律师事务所及经办律师

名称：浙江天册律师事务所

住所：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座11楼

办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座8楼、11楼

负责人：章靖忠

电话：0571-87901111

传真：0571-87901501

经办律师：俞晓瑜、刘森

四、会计师事务所及经办注册会计师

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：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：张勇、郭蕙心

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张勇

## 第四部分 基金的名称

南华丰淳混合型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

混合型证券投资基金

## 第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力求实现基金资产的持续稳健增值。

## 第七部分 基金的投资方向

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交易的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、权证、同业存单、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）以及现金，以及法律法规或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相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 第八部分 基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将由投资研究团队及时跟踪资本市场环境变化,根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、资本市场运行状况等因素的深入研究,分别判断股票和债券等市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析、公司盈利能力与现金流状况,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略,将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。其中,当股票市场资产价格明显上涨时,适当增加股票资产配置比例;当股票市场处于下行周期且市场风险偏好下降时,适当增加债券和现金资产配置比例,并通过灵活运用衍生品合约的套期保值与对冲功能,最终力求实现基金资产组合收益的最大化,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。

### 2、股票投资策略

本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上,选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票,以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。

#### (1) 行业分析与配置

本基金将根据各行业所处生命周期、产业竞争结构、近期发展趋势等数方面因素对各行业的相对盈利能力及投资吸引力进行评价,并根据行业综合评价结果确定股票资产中各行业的权重。

一个行业的进入壁垒、原材料供应方的谈判能力、制成品买方的谈判能力、产品的可替代性及行业内现有竞争程度等因素共同决定了行业的竞争结构,并决定行业的长期盈利能力及投资吸引力。另一方面,任何一个行业演变大致要经过发育期、成长期、成熟期及衰退期等阶段,同一行业在不同的行业生命周期阶段以及不同的经济景气度下,亦具有不同的盈利能力与市场表现。本基金对于那些具有较强盈利能力与投资吸引力、在行业生命周期中处于成长期或成熟期、且预期近期经济景气度有利于行业发展的行业,给予较高的权重;而对于那些盈利能力与投资吸引力一般、在行业生命周期中处于发育期或衰退期,或者当前经济景

气不利于行业发展的行业，给予较低的权重。

#### （2）公司财务状况评估

在对行业进行深入分析的基础上，对上市公司的基本财务状况进行评估。结合基本面分析、财务指标分析和定量模型分析，根据上市公司的财务情况进行筛选，剔除财务异常和经营不够稳健的股票，构建基本投资股票池。

#### （3）价值评估

基于对公司未来业绩发展的预测，采用现金流折现模型等方法评估公司股票的合理内在价值，同时结合股票的市场价格，挖掘具有持续增长能力或者价值被低估的公司，选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。

#### （4）股票选择与组合优化

综合定性分析与定量价值评估的结果，选择定价合理或者价值被低估的股票构建投资组合，并根据股票的预期收益与风险水平对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。同时监控组合中各个证券的估值水平，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

### 3、债券投资策略

债券投资策略包括利率策略、信用策略、债券选择与组合优化策略、可转换债券投资策略等。

#### （1）利率策略

研究 GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期，以规避债券价格下降的风险和资本损失，获得较高的再投资收益；预期市场利率将下降时，提高组合的久期，在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益，并获得较高利息收入。

#### （2）信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景，发行人业务发展状况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根



据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定债券的信用风险利差与投资价值。

### （3）债券选择与组合优化

本基金将根据债券市场情况，基于利率期限结构及债券的信用级别，在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。

### （4）可转换债券投资

可转换债券兼具股票与债券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，是本基金的重要投资对象之一。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金可投资包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券。本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

## 5、衍生品投资策略

### （1）股指期货投资策略

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案比例。

### （2）国债期货投资策略

本基金以提高对利率风险管理能力，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货

投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### （3）权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合，力求取得最优的风险调整收益。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金，风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

本投资组合的报告期为2019年7月1日起至2019年9月30日止(财务数据经审计)。

### (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	5,895,820.70	90.63
	其中:股票	5,895,820.70	90.63
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	559,626.23	8.60
8	其他资产	49,603.94	0.76
9	合计	6,505,050.87	100.00

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,844,490.79	59.71

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	1,698,655.91	26.38
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	352,674.00	5.48
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,895,820.70	91.58

## 2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### (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

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	600588	用友网络	17,900	552,931.00	8.59
2	600309	万华化学	11,641	513,950.15	7.98
3	600276	恒瑞医药	4,508	363,705.44	5.65
4	300760	迈瑞医疗	1,946	358,959.16	5.58
5	603882	金域医学	6,300	352,674.00	5.48
6	601100	恒立液压	8,583	330,445.50	5.13
7	002371	北方华创	4,799	314,718.42	4.89

8	300059	东方财富	18,616	275,144.48	4.27
9	000977	浪潮信息	10,563	271,469.10	4.22
10	600570	恒生电子	3,587	265,186.91	4.12

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末, 本基金未持有债券。

(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

报告期末, 本基金未持有债券。

(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

报告期末, 本基金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

报告期末, 本基金未持有贵金属投资。

(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

报告期末, 本基金未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内, 本基金未参与股指期货交易。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内, 本基金未参与国债期货交易。

(十一) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

2、本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,020.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	143.85
5	应收申购款	1,439.56
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	49,603.94

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第十二部分 基金的业绩

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

### 一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南华丰淳混合 A 净值表现:

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
2019.7.1- 2019.9.30	5.06%	1.30%	-0.05%	0.72%	5.11%	0.58%

南华丰淳混合 C 净值表现:

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
2019.7.1- 2019.9.30	4.59%	1.30%	-0.05%	0.72%	4.64%	0.58%

二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较:

(1) 南华丰淳混合 A 基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2017年12月26日至2019年9月30日)





(2) 南华丰淳混合 C 基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2017年12月26日至2019年9月30日)



注:

本基金建仓期为2017年12月26日至2018年6月25日,截至本报告期末,本基金已完成建仓;建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合基金合同的规定。

## 第十三部分 费用概览

### 一、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、本基金从 C 类基金份额基金的财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、公证费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 5 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后进行支付。若遇法定节假日、休息日等，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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 5 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 5 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

4、证券、期货账户开户费用：证券、期货账户开户费由基金管理人垫付，运作后由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金资产中一次性支付给基金管理人。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### （四）基金相关费用的调整

在法律法规允许的条件下，基金管理人和基金托管人协商一致并履行适当的程序后，可根据基金发展情况酌情调整基金管理费、基金托管费或 C 类基金份额销售服务费等相关费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费

本基金 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用；投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 C 类基金份额不收取申购费。具体费用安排如下表所示：

基金的申购费率结构

费用种类	A 类基金份额		C 类基金份额
申购费率	M < 100 万	1.2%	0%
	100 万 ≤ M < 300 万	1.0%	
	300 万 ≤ M < 500 万	0.8%	
	M ≥ 500 万	按笔收取，1,000 元/笔	

注：M 为金额。

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

### 2、赎回费

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有 A、C 类份额持有期少于 30 天的，收取的赎回费全额计入基金财产；对于持有 A 类份额持有期少于 3 个月的，不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对于持有 A 类份额持有期长于 3 个月但小于 6 个月的，不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对于持有 A 类份额持有期长于 6 个月的，不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。上述“月”是指 30 个自然日。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，具体费率如下：

基金的赎回费率结构

费用种类	A 类基金份额		C 类基金份额	
	持有期限	赎回费率	持有期限	赎回费率
赎回费率	Y < 7 天	1.50%	Y < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ Y < 30 天	0.75%		
	30 天 ≤ Y < 180 天	0.50%	7 天 ≤ Y < 30 天	0.50%
	180 天 ≤ Y < 1 年	0.10%		
	1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%	Y ≥ 30 天	0%

	Y $\geq$ 2 年	0%		
--	--------------	----	--	--

注：Y 为持有期限，1 年指 365 天。

3、赎回费用未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

### 三、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。

## 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书（更新）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金管理人于 2019 年 1 月 31 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容截止日及财务数据和净值表现数据截止日。
- 2、更新了“第一部分、绪言”中的相关内容。
- 3、更新了“第二部分、释义”中相关内容。
- 4、更新了“第三部分、基金管理人”中相关内容。
- 5、更新了“第四部分、基金托管人”中相关内容。
- 6、更新了“第五部分、相关服务机构”中相关内容。
- 7、更新了“第八部分、基金份额的申购与赎回”中的相关内容。
- 8、在“第九部分、基金的投资”中更新了“基金投资组合报告”相关内容，该部分内容均按有关规定编制。
- 9、更新了“第十部分、基金的业绩”的相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
- 10、更新了“第十二部分、基金资产的估值”中相关内容。
- 11、更新了“第十四部分、基金的收益与分配”中相关内容。
- 12、更新了“第十五部分、基金的会计与审计”中的相关内容。
- 13、更新了“第十六部分、基金的信息披露”中相关内容。
- 14、更新了“第十七部分、基金的风险揭示”的相关内容。
- 15、更新了“第十八部分、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中的相关内容。
- 16、更新了“第十九部分、基金合同的内容摘要”中的相关内容。
- 17、更新了“第二十部分、基金托管协议的内容摘要”中的相关内容。
- 18、更新了“第二十二部分、其他应披露事项”的相关内容。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，投资人欲查询本更新招募说明书正文，可登陆南华基金管理有限公司网站 [www.nanhuafunds.com](http://www.nanhuafunds.com)。

南华基金管理有限公司

二零二零年一月二十二日