

南方中证 50 债券指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新) 摘要

基金管理人: 南方基金管理有限公司

基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

本招募说明书 (更新) 摘要内容截止日: 2015 年 5 月 17 日

重要提示

本基金经中国证监会 2011 年 3 月 16 日证监许可[2011]380 号文核准募集, 基金合同已于 2011 年 5 月 17 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。

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, 充分考虑自身的风险承受能力, 并承担基金投资中出现的各类风险, 包括: 因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险, 个别证券特有的非系统性风险, 由于基金投资者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, 本基金的特定风险等等。投资有风险, 投资者认购 (或申购) 基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金通过被动式指数化投资以实现跟踪中证 50 债券指数, 但由于基金费用、交易成本、指数成份券取价规则和基金估值方法之间的差异等因素, 可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。

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。

本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 5 月 17 日, 有关财务数据和净值表现截止日 2015 年 3 月 31 日 (未经审计)。

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。

一、基金管理人

(一) 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: 深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

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%。

（二）主要人员情况

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。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。现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

张涛先生，董事，中共党员，毕业于河海大学技术经济及管理专业，获博士学位。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、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、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

姜健先生，董事，中共党员，毕业于南京林业大学经济及管理专业，获硕士学位。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。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。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。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。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。历任德勤国际会计师事务所会计专业翻译，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。历任国家经委副处长、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。历任东南大学经济管理学院助教、讲师、副教授、教授，现任南京大学工程管理学院院长、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、国信证券等单位的博士后指导教师，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。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。毕业于财政部科研院所，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，硕士研究生学历，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副会长、广东省律师协会女律师委员会副主任、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深圳市中小企业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。

2、监事会成员

骆新都女士，监事，经济学硕士，经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问；现任南方基金管理有限公司监事会主席。

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。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、计划财务部总经理；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。曾在浙江兰溪马间专厂、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财务部部长，深圳市科实投资发展有限公司监事、深圳市国际招标有限公司董事、中国科技开发院有限公司监事、深圳市深福保（集团）有限公司监事、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。

苏荣坚先生，监事，中共党员，学士学位，高级经济师。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务总监兼财务部总经理。

林红珍女士，监事，投资经济管理专业学士学位，后参加人民大学金融学院研究生进修班。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）、兴业证券风险管理部总经理，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，博士研究生，工程师。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。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。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，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，现任监察稽核部副总监。

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，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。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。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。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。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士。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。

4、基金经理

本基金历任基金经理：2011年5月至2014年7月，刘朝阳；2014年7月至2014年9月，刘朝阳、孟飞；2014年9月至今，孟飞。

孟飞，男，金融学硕士学历，具有基金从业资格。曾担任第一创业证券公司债券交易员、交易经理、高级交易经理。2013年5月加入南方基金，任固定收益部高级研究员，2014年7月至今，任南方启元基金经理；2014年7月至今，任南方50债基金经理；2014年7月至今，任南方中票基金经理；2014年9月至今，任南方安心基金经理；2015年1月至今，任南方润元基金经理。

5、投资决策委员会成员

总裁杨小松先生，总裁助理兼固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司（香港）董事李海鹏先生，交易管理部总监王珂女士，固定收益部总监韩亚庆先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：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

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：蒋松云

（二）主要人员情况

截至 2014 年 12 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 207 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2014 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 407 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 45 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评截至 2014 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 380 只。。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013 年七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2014 年中国工商银行资产托管部第八次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，

新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（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《基金法》、《运作办法》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、应收资金到账、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和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。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本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、基金合同和本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存在重大违规行为，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、阻挠对方根据本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。

三、相关服务机构

(一)场外销售机构

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）82763905、82763906

传真：（0755）82763900

联系人：张锐珊

2、场外代销机构：

代销银行：

■

■

■

■

代销券商和其他代销机构：

■

■

■

■

■

■



（二）场内销售机构

场内销售机构是指具有基金代销业务资格、并经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关证券交易所会员单位，具体名单以交易所网站刊载内容为准。

（三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
电话：010-59378856
传真：010-59378907
联系人：崔巍

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称：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

（五）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：杨绍信
联系人：陈熹
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办会计师：薛竞、陈熹

四、基金名称

南方中证 50 债券指数证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标指数的有效跟踪。

七、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 50 债券指数的成份券及其备选成份券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，中证 50 债券指数成份券及其备选成份券的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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。

八、基金的投资策略

8.1 投资策略

本基金为被动式指数基金，采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动

性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行取整和替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。

当预期成份券发生调整时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因市场流动性不足时，或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。

在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则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。

（一）资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于中证 50 债券指数成份券和备选成份券。本基金将采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行取整和替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。

（二）债券投资策略

本基金通过最优复制法进行被动式指数化投资，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，如“久期盯住”、“比例盯住”等优化策略对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

1、债券投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照中证 50 债券指数各成份券构成，并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入。当遇到成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例等其他市场因素及预期标的指数的成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

当基金规模过小时，根据债券市场成交惯例，基金可能只能购买部分成份券；当基金规模过大时，受到市场流动性和法规限制等影响，基金将从备选成份券中挑选替代债券或替代组合满足跟踪需求。

2、债券投资组合的调整

（1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的中证 50 债券指数对其成份券的调整而进行相应调整。

（2）不定期调整

1) 当成份券发行量变动，本基金将根据指数的新构成进行相应调整；

2) 本基金处理日常申购赎回时，资金量可能无法按照标的指数构成交易相应成份券。本基金将综合考虑交易规模、交易惯例和成份券（或备选成份券）的流动性等因素，对债券投资组合进行动态调整；

3) 若成份券遇到退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

4) 本基金将以一定仓位参与一二级市场套利交易、回购套利交易、个券套利交易和放大交易，以期减小基金运作的有关费用对指数跟踪的影响。

（3）替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求，基金管理人可构建替代组合。构建替代组合的方法如下：

1) 按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则，选择标的指数成份券和备选成份券作为备选库；

2) 采用备选库中各债券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；

3) 考察备选券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，并使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

(4) 债券投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，我们将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整，如“久期盯住”、“比例盯住”等。

1) 久期盯住

“久期盯住”策略是指投资组合久期与标的指数久期一致为目标，即满足：



从而使得在收益率曲线平行移动的情况下，债券投资组合和标的指数走势一致。

2) 比例盯住

“比例盯住”主要是考虑到不同类型债券和不同期限债券收益率波动情况的不一致，表现为隐含税率、信用利差和期限利差的变动。考虑各类型债券权重，力争基金组合各类型债券权重与标的指数分布相匹配，减少类型错配的跟踪误差；考虑各个期限的债券权重，力争基金组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配，减少期限利差变动造成的跟踪误差。

8.2 投资决策依据和决策程序

1、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。

2、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，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

(2) 提出投资建议：依托基金管理人固定收益投资研究团队，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份债公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，结合基金合同、投资制度向基金经理提出投资建议。

(3) 制定投资决策和组合构建：基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以最优复制标的指数成份券权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：交易部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，履行一线监控职责。

(5) 进行风险评估：风险控制委员会定期召开会议，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险控制意见。

(6) 组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份债基本面情况、流动性状况、基金申赎情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

(7) 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。

九、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

十、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证 50 债券指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

中证 50 债券指数从包括上海证券交易所市场、深圳证券交易所市场以及银行间市场挑选 50 只流动性强、规模大、质地好的债券组成样本，是国内首只跨市场成份类债券指数。如果今后法律法规发生变化，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的业绩基准的指数时，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。

十一、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司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 3 月 31 日（未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

■

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

■

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

■

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的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。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1

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。

1.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

1.10.3 其他资产构成

■

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票...

十二、基金的业绩

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。

南方中证 50 债券指数(LOF)A

■

南方中证 50 债券指数(LOF)C

■

十三、基金费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、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) 从 C 类基金份额的基金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、律师费和诉讼费；
- (6) 基金上市费及年费；
- (7) 基金份额持有人大会费用；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 基金的指数使用费；
- (10) 基金的银行汇划费用；
- (11) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

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。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 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年费率为 0.35%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.35%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

(4) 指数使用许可费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之一点五（1.5个基点）的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times \text{万分之一点五} / \text{当年天数}$

H为每日应付的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元（5万元），基金设立当年，不足3个月的，按照3个月收费。

上述一、基金费用的种类中第3-10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，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

(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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

(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。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率或基金销售服务费等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率（但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外），须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。

5、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。

(二) 与基金销售有关的费用

1、本基金A类基金份额在申购时收取前端申购费用，C类基金份额不收取申购费用。本基金前端申购费率最高不高于0.8%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

■ 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A类基金份额场外赎回费率不高于0.1%，随申请份额持有时间增加而递减（其中1年为365天）。C类基金份额不收取赎回费（但基金管理人根据基金合同约定开始对持有期限少于30日的本类别基金份额收取赎回费除外）。具体如下表所示：

■ A类基金份额场内赎回费率为0.1%。

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

3、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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、对于持续持有期少于 30 日的 C 类基金份额投资人，基金管理人可收取赎回金额 0.5% 的赎回费。赎回费总额的 25% 应归入基金财产，基金管理人最迟于实施日前 30 日在至少一家指定媒体公告。

5、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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据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“基金管理人”部分，对基金管理人的相关信息进行了更新。
- 2、在“基金托管人”部分，对基金托管人的相关信息进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”部分，对代销机构信息进行了更新。
- 4、在“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。
- 5、在“基金的投资”部分，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容和最新业绩。
- 6、对“基金份额持有人服务”进行了更新。
- 7、对“其他应披露事项”进行了更新。
- 8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2015 年 6 月 25 日

序号

代销机构名称

代销机构信息

1

中国工商银行股份有限公司

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

2

中国建设银行股份有限公司

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

3

中国农业银行股份有限公司

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

4

中国银行股份有限公司
客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

5
交通银行股份有限公司
客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

6
招商银行股份有限公司
客服电话：95555

公司网站：www.cmbchina.com

7
中国邮政储蓄银行股份有限公司
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
客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

9
中信银行股份有限公司
客服电话：95558

网址：<http://bank.ecitic.com/>

10
广发银行股份有限公司
客服电话：400-830-8003

公司网站：www.gdb.com.cn

11

中国民生银行股份有限公司
客服电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

12

中国光大银行股份有限公司
客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

13

平安银行股份有限公司
客服电话：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

14

杭州银行股份有限公司
客服电话：95398

公司网站：www.hzbank.com.cn

15

上海银行股份有限公司
客服电话：95594

公司网站：www.bankofshanghai.com

16

北京银行股份有限公司
客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

17

上海农村商业银行股份有限公司
客服电话：021-962999，4006962999

公司网站: www.srcb.com

18

东莞银行股份有限公司
客服电话: 4001196228

公司网站: www.dongguanbank.cn

19

华夏银行股份有限公司
客服电话: 95577

公司网站: www.hxb.com.cn

20

宁波银行股份有限公司
客服电话: 96528, 上海、北京地区 962528

公司网站: www.nbc.com.cn

序号

汉口银行股份有限公司
客服电话: 96558 (武汉)、40060-96558 (全国)

公司网站: <http://www.hkbchina.com>

22

浙商银行股份有限公司
客服电话: 95527

公司网站: www.czbank.com

23

重庆银行股份有限公司
客服电话: 400-70-96899

网址: www.cqcbank.com

24

东莞农村商业银行股份有限公司
客服电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

25
乌鲁木齐市商业银行股份有限公司
客服电话：0991-96518

网址：www.uccb.com.cn

26
广州银行股份有限公司
客服电话：020-96699

网址：www.gzcb.com.cn

27
河北银行股份有限公司
客服电话：400-612-9999

网址：www.hebbank.com

28
厦门银行股份有限公司
客服电话：400-858-8888

网址：www.xmbankonline.com

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
客服电话：95597

公司网站：<http://www.htsc.com.cn>

2

兴业证券股份有限公司
客服电话：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

3

国信证券股份有限公司
客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

4

中国银河证券股份有限公司
客服电话：4008-888-888

公司网站：www.chinastock.com.cn

5

国泰君安证券股份有限公司
联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

6

齐鲁证券有限公司
客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

7

海通证券股份有限公司
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
客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

9

广发证券股份有限公司
统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

10
长城证券股份有限公司
客服电话:0755-33680000 4006666888

公司网站： www.cgws.com

11
招商证券股份有限公司
客服电话：95565、4008888111

公司网站： www.newone.com.cn

12
中信证券股份有限公司
客服电话：95558

公司网站： www.cs.ecitic.com

13
申万宏源证券有限公司
客服电话：95523 或 4008895523

公司网站: www.swhysc.com

14
光大证券股份有限公司
客服电话：95525，10108998

公司网站： www.ebscn.com

15
中国中投证券有限责任公司
客服电话：400-600-8008、95532

公司网站： www.china-invs.cn

16
申万宏源西部证券有限公司

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

17

湘财证券股份有限公司

客服电话：400-888-1551

公司网站：www.xcsc.com

18

中信证券（浙江）有限责任公司

公司网站：www.bigsun.com.cn

客户服务中心电话：95548

19

安信证券股份有限公司

客服电话：4008001001

公司网站：www.essence.com.cn

20

中信证券（山东）有限责任公司

客服电话：95548

公司网站：www.citicssd.com

21

中银国际证券有限责任公司

联系电话：021-20328309

公司网站：www.bocichina.com

22

信达证券股份有限公司

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

23

民生证券股份有限公司
客服电话：4006198888

公司网站：www.msq.com

24

东方证券股份有限公司
客服电话：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

25

华融证券股份有限公司
客服电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

26

华西证券股份有限公司
客服电话：95584

公司网站：www.hx168.com.cn

27

长江证券股份有限公司
传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

28

东北证券股份有限公司
客服电话：4006000686，0431-85096733

公司网站：www.nesc.cn

29

上海证券有限责任公司
公司网站：www.shzq.com

客服电话：4008918918，021-962518

30

江海证券有限公司

客服电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

31

国联证券股份有限公司

客服电话:95570

公司网站:www.glsc.com.cn

32

东莞证券股份有限公司

传真：0769-22115712

公司网站:www.dgzq.com.cn

33

渤海证券股份有限公司

客服电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

34

平安证券有限责任公司

客服电话:95511-8

公司网站：www.pingan.com

35

国都证券有限责任公司

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

36

东吴证券股份有限公司

客服电话：4008601555

网址：<http://www.dwjq.com.cn/>

37

广州证券股份有限公司
客服电话:020-961303

公司网站: www.gzs.com.cn

38

华林证券有限责任公司
客服电话:400-188-3888

公司网站:www.chinalions.com

39

南京证券股份有限公司
联系电话: 025-83364032

公司网站:www.njqz.com.cn

40

华安证券股份有限公司
客服电话: 96518, 4008096518

公司网站: www.hazq.com

21

浙商证券股份有限公司
客服电话: 0571-967777

网址: www.stocke.com.cn

42

华宝证券有限责任公司
联系人: 刘闻川 电话: 021-68778790 客服电话: 4008209898

公司网站: www.cnhbstock.com

43

山西证券股份有限公司
客服电话: 400-666-1618, 95573

公司网站: www.i618.com.cn

44

第一创业证券股份有限公司

联系电话:0755-23838750

公司网站:www.firstcapital.com

45

华福证券有限责任公司

客服电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)

网址: 公司网址: www.hfzq.com.cn

46

中山证券有限责任公司

客服电话: 4001022011

公司网站: <http://www.zszq.com>

47

国海证券股份有限公司

客服电话: 95563

网址: <http://www.ghzq.com.cn>

48

中原证券股份有限公司

客服电话: 0371-967218、4008139666

公司网站: www.ccnew.com

49

西南证券股份有限公司

客服电话: 4008-096-096

网址: www.swsc.com.cn

50

财达证券有限责任公司

客服电话: 4006128888

公司网站: www.S10000.com

51

德邦证券股份有限公司
客服电话: 4008888128

网址: www.tebon.com.cn

52

中航证券有限公司
客服电话: 400-8866-567

网址: <http://www.avicsec.com/>

53

国元证券股份有限公司
客服电话: 全国统一热线 95578, 4008888777, 安徽省内热线 96888

公司网站: www.gyzq.com.cn

54

国盛证券有限责任公司
联系电话: 0791-86281305

公司网站: www.gsstock.com

55

中国国际金融有限公司
客服电话: 400-910-1166

公司网站: www.cicc.com.cn

56

大同证券经纪有限责任公司
客服电话: 4007121212

网址: <http://www.dtsbc.com.cn>

57

方正证券股份有限公司
客服电话: 95571

公司网站: www.foundersc.com

58

财通证券股份有限公司

客服电话：95336,40086-96336

公司网站：www.ctsec.com

59

东海证券股份有限公司

客服电话：95531；400-888-8588

公司网站：www.longone.com.cn

60

西部证券股份有限公司

客服电话：95582

网址：<http://www.westsecu.com/>

61

新时代证券有限责任公司

客服电话：4006989898

公司网站：www.xsdzq.cn

62

瑞银证券有限责任公司

客服电话：400-887-8827

公司网站：www.ubssecurities.com

63

金元证券股份有限公司

客服电话：4008-888-228

公司网站：www.jyzq.cn

64

万联证券有限责任公司

客服电话:400-8888-133

公司网站: www.wlzq.com.cn

65

国金证券股份有限公司

客服电话: 4006600109

网址: www.jyzq.cn

66

财富证券有限责任公司

客服电话: 0731-84403333 400-88-35316 (全国)

公司网站:www.cfzq.com

67

恒泰证券股份有限公司

联系电话: 0471-3953168

网址: www.cnht.com.cn

68

华龙证券股份有限公司

客服电话: 4006-89-8888, 0931-96668

网址: www.hlzqgs.com

69

华鑫证券有限责任公司

客服电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918

网址: www.cfsc.com.cn

70

日信证券有限责任公司

联系电话: 010-83991716

公司网站: www.rxzq.com.cn

71

英大证券有限责任公司
客服电话：4000-188-688

公司网站：www.ydsc.com.cn

72
大通证券股份有限公司
客服电话：4008-169-169

网址：www.daton.com.cn

73
天相投资顾问有限公司
公司网址：<http://www.txsec.com>

公司基金网网址：www.jjm.com.cn

74
联讯证券股份有限公司
客服电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

75
东兴证券股份有限公司
客服电话：4008888993

网址：www.dxzq.net

76
开源证券股份有限公司
客服电话：400-860-8866

网址：<http://www.kysec.cn>

77
中邮证券有限责任公司
客服电话：4008888005

网址：www.cnpsec.com

78
中国民族证券有限责任公司

客服电话：4008895618

网址：www.e5618.com

79

太平洋证券股份有限公司

客服电话：400-665-0999

网址：www.tpyzq.com

80

宏信证券有限责任公司

客服电话：4008366366

网址：www.hxzq.cn

61

深圳众禄基金销售有限公司

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

82

上海好买基金销售有限公司

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

83

杭州数米基金销售有限公司

客服电话：4000-766-123

网址：http://www.fund123.cn/

84

上海长量基金销售投资顾问有限公司

客服电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

85

上海天天基金销售有限公司
客服电话：400-1818188

网址：www.1234567.com.cn

86

北京展恒基金销售有限公司
客服电话：4008886661

网址：www.myfund.com

87

浙江同花顺基金销售有限公司
客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

88

万银财富（北京）基金销售有限公司
客服电话：400-081-6655

网址：www.wy-fund.com

89

和讯信息科技有限公司
客服电话：4009200022

网址：licaike.hexun.com

90

浙江金观诚财富管理有限公司
客服电话：400-068-0058

网址：www.jincheng-fund.com

91

泛华普益基金销售有限公司
客服电话：400-8588588

网址：<http://www.pyfund.cn>

92

嘉实财富管理有限公司
客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

93
北京恒天明泽基金销售有限公司
客服电话：400-786-8868-5

网址：www.chtfund.com

94
深圳宜投基金销售有限公司
客服电话：4008955811

网址：www.ucffund.com

95
北京创金启富投资管理有限公司
客服电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

96
海银基金销售有限公司
客服电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

97
上海联泰资产管理有限公司
客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66money.com>

98
北京增财基金销售有限公司
客服电话：010-67000988

网址：www.zcvc.com.cn

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

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
70,605,000.00
95.39

其中：债券
70,605,000.00
95.39

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
2,115,126.26
2.86

7
其他资产
1,300,938.70
1.76

8
合计
74,021,064.96
100.00

序号
债券品种
公允价值（元）
占基金资产净值比例（%）

1
国家债券
40,054,000.00
67.71

2
央行票据

-
-

3
金融债券
30,551,000.00
51.64

其中：政策性金融债
30,551,000.00
51.64

4
企业债券

-
-

5
企业短期融资券

-
-

6
中期票据

-
-

7
可转债

-
-

8
其他

-
-

9
合计
70,605,000.00
119.35

序号
债券代码
债券名称
数量（张）
公允价值（元）
占基金资产净值比例（%）

1
140206
14 国开 06
200,000
20,162,000.00
34.08

2
140209
14 国开 09
100,000
10,389,000.00
17.56

3
140013
14 付息国债 13
100,000
10,234,000.00
17.30

4
130001
13 付息国债 01
100,000
9,961,000.00
16.84

5
130013
13 付息国债 13
100,000
9,933,000.00
16.79

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
1,274,707.94

5
应收申购款
26,230.76

6
其他应收款
-

7
待摊费用
-

8
其他
-

9

合计
1,300,938.70

阶 段
净值增长率 (1)
率标准差

(2)
基准收益

率 (3)
业绩比较基准收益率标准差 (4)

(1) - (3)

(2) - (4)

2011.05.17-2011.12.31

5.86%

0.11%

3.87%

0.12%

1.99%

-0.01%

2012.01.01-2012.12.31

2.75%

0.08%

2.53%

0.07%

0.22%

0.01%

2013.01.01-2013.12.31

-1.33%

0.09%

-1.12%

0.09%

-0.21%

0.00%

2014.01.01-2014.12.31

7.56%

0.12%

8.85%

0.11%
-1.29%
0.01%

2015.01.01-2015.03.31

0.09%
0.12%
0.74%
0.08%
-0.65%
0.04%

自基金成立起至今

15.55%
0.10%
15.47%
0.10%
0.08%
0.00%

阶 段

净值增长率 (1)

率标准差

(2)

基准收益

率 (3)

业绩比较基准收益率标准差 (4)

(1) - (3)

(2) - (4)

2011.05.17-2011.12.31

5.59%
0.11%
3.87%
0.12%
1.72%
-0.01%

2012.01.01-2012.12.31

2.35%
0.08%

2.53%
0.07%
-0.18%
0.01%

2013.01.01-2013.12.31
-1.69%
0.09%
-1.12%
0.09%
-0.57%
0.00%

2014.01.01-2014.12.31
7.18%
0.13%
8.85%
0.11%
-1.67%
0.02%

2015.01.01-2015.03.31
0.00%
0.12%
0.74%
0.08%
-0.74%
0.04%

自基金成立起至今
13.87%
0.10%
15.47%
0.10%
-1.60%
0.00%

购买金额 (M)
申购费率

M<100 万
0.8%

100 万 \leq M<500 万
0.6%

500 万 \leq M<1000 万
0.4%

M \geq 1000 万
每笔 1,000 元

申请份额持有时间（N）
赎回费率

N<1 年
0.1%

1 年 \leq N<2 年
0.05%

N \geq 2 年
0

A 类基金份额场内赎回费率为 0.1%。

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财

产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

3、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基

金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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、对于持续持有期少于 30 日的 C 类基金份额投资人，基金管理人可收取赎回金额 0.5% 的赎回费。赎回费总额的 25% 应

归入基金财产，基金管理人最迟于实施日前 30 日在至少一家指定媒体公告。

5、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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据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“基金管理人”部分，对基金管理人的相关信息进行了更新。
- 2、在“基金托管人”部分，对基金托管人的相关信息进行了更新。
- 3、在“相关服务机构”部分，对代销机构信息进行了更新。
- 4、在“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。
- 5、在“基金的投资”部分，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容和最新业绩。
- 6、对“基金份额持有人服务”进行了更新。
- 7、对“其他应披露事项”进行了更新。
- 8、对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2015年6月25日