

(上接B041版)

84	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:北京市西城区金融大街35号国金大厦C9层 法定代表人:马海令 联系人:邓洁 电话:010-58325388-1105 传真:010-58325282 客服电话:4006507771 网站:tz.jr.com
85	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心B座23层 法定代表人:吴越 联系人:陈翠 电话:010-57756019 传真:010-57756019 客服电话:400-786-8868-5 网站:www.czfund.com
86	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:赵春荣 联系人:魏静 电话:010-57418829 传真:010-57569761 客服电话:400-768-5095 网站:www.nujin.net
87	深圳联合货币基金销售有限公司	注册地址:深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深产学研大楼B15层(入驻深圳市前海商务有限公司) 办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心4层 法定代表人:王景照 联系人:曾晶 电话:0755-23601676 传真:0755-88603185 客服电话:4009558111 网站:www.ufcfund.com
88	深圳前海汇联基金销售有限公司	注册地址:深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深产学研大楼B15层(入驻深圳市前海商务有限公司) 办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心4层 法定代表人:丁南 联系人:张莹 电话:0755-32938888-6200 传真:0755-32938888-5 客服电话:0755-36073366 网站:www.flyingfund.com.cn
89	其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。	

(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大厦塔楼31、32、33层

法定代表人:吴万善

电话:(0755)82763849

传真:(0755)82763868

联系人:古和鹏

(三)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GLH室

负责人:李兆良

电话:(0755)823287960

传真:(0755)823287961

经办律师:杨忠、戴瑞冬

(四)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号星展银行大楼6楼

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路200号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:杨绍信

联系人:陈燕

联系电话:021-23238988

传真:021-23238900

经办会计师:薛燕、陈燕

四、基金名称

南方中债中期票据指数型发起式证券投资基金

五、基金的类型

债券型基金

六、基金的投资目标

本基金主要投资于标的指数成份股。为了更好地实现投资目标,本基金还可以投资于国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款,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。其中,本基金投资于标的指数成份股的比例不低于基金资产的90%,其中标的指数成份股投资比例不低于本基金资产的80%。本基金将主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基准,综合考虑债券利息类型、债券主体资质、债券剩余期限和债券流动性等因素构建组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以力争对标的指数的跟踪误差。

在正常市场情况下,力争本基金在扣除各项费用之后的总回报与业绩比较基准之差的绝对值不超过0.2%,跟踪误差不超过0.3%。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和跟踪误差进一步扩大。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的,基金管理人还将综合考虑标的指数成份券的数量、流动性和投资限制、交易费用及成本,以及税务及其他监管限制,决定是否采用其他复制方法。对于复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需在方法变更前依照《信息披露办法》在指定媒体公告,并阐明变更复制方法的原因。

1. 资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的90%,其中标的指数成份券投资比例不低于本基金债券资产的80%。本基金将主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基准,综合考虑债券利息类型,债券主体资质、债券剩余期限和债券流动性等因素构建组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以力争对标的指数的跟踪误差。

2. 债券投资策略

本基金主要通过抽样复制法进行指数化投资,主要根据标的指数各成份券的分布,以期在规定的风险承受度之内,尽量缩小跟踪误差。

4. 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

(1) 债券投资组合的构建

本基金主要采用抽样复制法,在综合考虑个券的发行规模、流动性、行业等因素的基础上,根据债券收益率类型、债主体质和债券剩余期限进行分层抽样,选择部分抽样债券构建投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

本基金将主要采用抽样复制法进行指数化投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

4. 报告期未按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期末未持有股票

3. 报告期未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:本基金报告期末未持有股票

4. 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

(1) 债券投资组合的构建

本基金主要采用抽样复制法,在综合考虑个券的发行规模、流动性、行业等因素的基础上,根据债券收益率类型、债主体质和债券剩余期限进行分层抽样,选择部分抽样债券构建投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

本基金将主要采用抽样复制法进行指数化投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

4. 报告期未按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期末未持有股票

5. 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票

6. 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票

7. 基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股。为了更好地实现投资目标,本基金还可以投资于国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款,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。其中,本基金投资于标的指数成份股比例不低于基金资产的90%,其中标的指数成份股投资比例不低于本基金资产的80%,现金或者到期日在一年以内的货币市场基金不高于5%,现金等金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等,但不参与一级市场的申购、转售或购入股票。

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

4. 基金的投资目标

本基金追求取得在扣除各项费用之后与标的指数相似的总回报。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股。为了更好地实现投资目标,本基金还可以

八、投资策略

本基金为被动式指数基金,主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基准,综合考虑债券利息类型、债主体质、债券剩余期限和债券流动性等因素构建组合,并根据基金日常申购赎回情况,市场流动性以及银行间债券交易特性及交易惯例等情况,进行优化操作,以力争对标的指数的跟踪误差。

在正常市场情况下,力争本基金在扣除各项费用之后的总回报与业绩比较基准之差的绝对值不超过0.2%,跟踪误差不超过0.3%。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和跟踪误差进一步扩大。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的,基金管理人还将综合考虑标的指数成份券的数量、流动性和投资限制、交易费用及成本,以及税务及其他监管限制,决定是否采用其他复制方法。对于复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需在方法变更前依照《信息披露办法》在指定媒体公告,并阐明变更复制方法的原因。

1. 资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的90%,其中标的指数成份券投资比例不低于本基金债券资产的80%。本基金将主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基准,综合考虑债券利息类型,债券主体资质和债券剩余期限进行分层抽样,选择部分抽样债券构建投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以力争对标的指数的跟踪误差。

2. 债券投资策略

本基金主要通过抽样复制法进行指数化投资,主要根据标的指数各成份券的分布,以期在规定的风险承受度之内,尽量缩小跟踪误差。

4. 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

(1) 债券投资组合的构建

本基金主要采用抽样复制法,在综合考虑个券的发行规模、流动性、行业等因素的基础上,根据债券收益率类型、债主体质和债券剩余期限进行分层抽样,选择部分抽样债券构建投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

本基金将主要采用抽样复制法进行指数化投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

4. 报告期未按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期末未持有股票

3. 报告期未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:本基金报告期末未持有股票

4. 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

(1) 债券投资组合的构建

本基金主要采用抽样复制法,在综合考虑个券的发行规模、流动性、行业等因素的基础上,根据债券收益率类型、债主体质和债券剩余期限进行分层抽样,选择部分抽样债券构建投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

本基金将主要采用抽样复制法进行指数化投资组合,并根据基金日常申购赎回情况,进行优化操作,以实现更好的跟踪标的指数的目的。

4. 报告期未按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期末未持有股票

5. 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票

6. 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票

7. 基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股。为了更好地实现投资目标,本基金还可以

基金管理人根据中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年06月29日复核了本基金中的财务指标、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。

本基金组合报告所载数据截至2014年03月31日(未经审计)。

1. 报告期末基金资产组合情况

2. 报告期末基金资产净值

3. 报告期末基金份额总额

4. 报告期末持有基金资产

5. 报告期末持有的债券投资

6. 报告期末持有的股票投资

7. 报告期末持有的基金投资

8. 报告期末持有的其他投资

9. 报告期末持有的资产总额

10. 报告期末持有的负债总额

11. 报告期末持有的净资产总额

12. 报告期末持有的可供出售金融资产

13. 报告期末持有的持有至到期投资

14. 报告期末持有的长期股权投资

15. 报告期末持有的投资性房地产

16. 报告期末持有的长期应收款

17. 报告期末持有的长期股权投资

18. 报告期末持有的长期应收款

19. 报告期末持有的长期股权投资

20. 报告期末持有的其他长期资产

21. 报告期末持有的其他资产

22. 报告期末持有的资产总额

23. 报告期末持有的负债总额

24. 报告期末持有的净资产总额

25. 报告期末持有的可供出售金融资产

26. 报告期末持有的持有至到期投资

27. 报告期末持有的长期股权投资

28. 报告期末持有的投资性房地产

29. 报告期末持有的长期应收款

30. 报告期末持有的长期股权投资

31. 报告期末持有的其他长期资产

32. 报告期末持有的其他资产

33. 报告期末持有的资产总额

34. 报告期末持有的负债总额

35. 报告期末持有的净资产总额

36. 报告期末持有的可供出售金融资产

37. 报告期末持有的持有至到期投资

38. 报告期末持有的长期股权投资

39. 报告期末持有的投资性房地产

40. 报告期末持有的长期应收款

41. 报告期末持有的长期股权投资

42. 报告期末持有的其他长期资产

43. 报告期末持有的其他资产