

(上接B194版)

Table of financial institutions including 58 五矿证券有限公司, 59 天风证券股份有限公司, 60 联讯证券股份有限公司, etc. Each entry includes company name, address, and contact info.

Table of financial institutions including 61 东方财富证券股份有限公司, 62 网信证券有限责任公司, 63 天风证券股份有限公司, etc. Each entry includes company name, address, and contact info.

Table of financial institutions including 64 首创证券有限责任公司, 65 联储证券有限责任公司, 66 川财证券有限责任公司, etc. Each entry includes company name, address, and contact info.

Table of financial institutions including 67 深圳前海三益证券投资咨询有限公司, 68 北京恒天明基销售有限公司, 69 北京铁基销售有限公司, etc. Each entry includes company name, address, and contact info.

Table of financial institutions including 69 东方证券股份有限公司, 70 太平洋证券股份有限公司, 71 光大证券股份有限公司, etc. Each entry includes company name, address, and contact info.

(6) 国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,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,通过对债券市场和期货市场行趋势的研究,结合国债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国债期货的收敛性、流动性和非线性特征,运用国债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;利用金融衍生品杠杆作用,以达到降低投资组合整体风险的目的。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债-信用债总指数。中债-信用债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,是全面反映信用债的总指标。该指数涵盖银行间市场和交易所市场,指数成份券种主要包括中期票据、短期融资券、企业债、公司债和信用债券。该指数具有广泛的市场代表性,能够反映较信用债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者指数停止编制,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,调整基金的业绩比较基准,但应取得基金托管人同意后,报中国证监会备案,并及时公告,无须召开基金份额持有人大会。

10 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。

11 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2018年6月30日(未经审计)。

1. 投资组合报告

1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例(%)

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未投资境内股票。

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未有港股通股票投资。

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

注:本基金本报告期末未投资股票。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 4 columns: 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(%)

1.6 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

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(人民币元)

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

1.11.5 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投资股票。

12 基金业绩

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。

南方启元债券A

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(1), 净值增长率(2), 业绩比较基准收益率(3), 业绩比较基准收益率(4), (1)-(3), (2)-(4)

南方启元债券C

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(1), 净值增长率(2), 业绩比较基准收益率(3), 业绩比较基准收益率(4), (1)-(3), (2)-(4)

13.1 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. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费;
4. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费及仲裁费;
5. 基金的销售服务费;
6. 基金的证券交易费用;
7. 基金的银行汇划费用;

8. 从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

9. 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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E x 0.3% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人同意,基金托管人核一致后,由基金托管人于次月首日起5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 x 0.1% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人同意,基金托管人核一致后,由基金托管人于次月首日起5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、公休日等,支付日期顺延。
3. 从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费
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0.4%。本基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:
H = E x 销售服务费年费率 ÷ 当年天数
H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费
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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给各销售机构,或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日、支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类中第3-7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。
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、费用调整
基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、托管费率、销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施前在指定媒体上公告。
五、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
13.2 与基金销售有关的费用
本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类;从本类别基金资产中计提销售服务费,不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费用的基金份额,称为C类。
(1) 对于申购本基金A类份额的特定投资群体,申购费率最高不高于0.08%,且随申购金额的增加而递减,如下表所示:
(表略)
特定投资群体指依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金(包括全国社会保障基金、经监管部门批准可以投资资本市场的地方社会养老保险基金、企业年金单一计划以及集合计划)、特定投资群体需在申购前向基金管理人登记备案,并经基金管理人确认。如将来出现监管部门批准可以投资资本市场的其他社会养老保险基金、企业年金或其他养老产品类型,基金管理人可在招募说明书更新时或临时公告将其纳入特定投资群体范围,并按规定向中国证监会备案。
(2) 除上述特定投资群体外,申购本基金A类份额的所有投资人,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:
(表略)
(3) 对于申购本基金C类份额的投资人,申购费率为零。
投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。
申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
2. 本基金赎回费率最高不超过1.5%,随申购份额持有时间增加而递减。具体如下表所示:
(表略)
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。除持续持有期少于7天的投资者收取的赎回费全额计入基金财产外,不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。
3. 本基金的申购费率、赎回费率及收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。
4. 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》约定的前提下,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说明。
14 对招募说明书更新部分的通知
本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实际的投资管理活动,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:
1. 在“重要提示”部分,对“重要提示”进行了更新。
2. 在“绪言”部分,对“绪言”进行了更新。
3. 在“释义”部分,对“释义”进行了更新。
4. 在“基金管理人”部分,对“主要人员情况”进行了更新。
5. 在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。
6. 在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新,对“审计基金财产的会计师事务所”进行了更新。
7. 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,对“申购费用和赎回费用”进行了更新,对“申购份额与赎回金额的计算”进行了更新,对“拒绝或暂停申购的情形及处理方式”进行了更新,对“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式”进行了更新,对“巨额赎回的情形及处理方式”进行了更新。
8. 在“基金的投资”部分,对“投资管理”进行了更新,对“基金投资组合报告”进行了更新,对“基金业绩”部分,对“基金业绩披露”进行了更新。
9. 在“基金资产的估值”部分,对“基金估值披露”进行了更新。
10. 在“风险揭示”部分,对“风险揭示”进行了更新。
11. 在“基金合同的内容摘要”部分,对“基金合同的内容摘要”进行了更新。
12. 在“基金合同的终止和终止”部分,对“基金合同的内容摘要”进行了更新。
13. 在“基金托管协议的内容摘要”部分,对“基金托管协议的内容摘要”进行了更新。
14. 在“基金份额持有人服务”部分,对“基金份额持有人服务”进行了更新。
15. 在“其他应披露事项”部分,对“其他应披露事项”进行了更新。
16. 对部分其他表述进行了更新。
南方基金管理股份有限公司
2018年8月30日