南方涪利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

(2018年第1号)

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司

截止日:2018年10月12日

重要提示

本基金经中国证监会2017年11月14日证监许可[2017]2069号文注册募集。本基金的基金合同已于2018年4月12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投资价值和市场前景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,投资人在投资本基金前,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,由于基金投资人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,详见招募说明书“风险揭示”章节。投资有风险,投资人认购(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》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现;基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过基金总份额的50%,基金不向个人投资者销售。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年10月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(未经审计)。

§1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

名称:南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

成立时间:1998年3月6日

法定代表人:张海波

注册资本:3亿元人民币

电话:(0755)82763888

传真:(0755)82763889

联系人:常克川

1998年,南方基金管理有限公司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。2014年公司进行增资扩股,注册资本金达3亿元人民币。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。注册资本金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%。

1.2 主要人员情况

1.2.1 董事会成员

张海波先生,董事长,工商管理硕士,中国籍。曾任职中共江苏省委农工部至助理调研员,江苏省人民政府办公厅调研员,华泰证券总裁助理、投资银行部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务管理总部总经理,华泰证券副总裁兼华泰紫金投资有限责任公司董事长、华泰金融控股(香港)有限公司董事长、华泰证券(上海)资产管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司党委书记、董事长。

王连芬女士,董事,金融专业硕士,中国籍。曾任职赛格集团销售,深圳投资基金管理公司投资一部研究室主任,大鹏证券经纪业务部副总经理、深圳福虹路营业部总经理、南方总部总经理、总裁助理,第一证券总裁助理,华泰联合证券深圳华强北路营业部总经理、渠道服务部总经理、运营中心总经理、零售客户部总经理、执行办主任、总裁助理。现任华泰证券股份有限公司总裁助理兼深圳分公司总经理。

张辉先生,董事,管理学博士,中国籍。曾任职北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司干部,华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理。现任华泰证券股份有限公司董事会秘书、人力资源部总经理兼党委组织部长。

冯青山先生,董事,工学学士,中国籍。曾任职陆军第124师工兵营地爆连副连职排长、代政治指导员、师政治部组织科正连职干事,陆军第42集团军政治部组织处副营职干事,驻香港部队政治部组织处正营职干事,驻澳门部队政治部正营职干事,陆军第163师政治部宣传科副科长(正营职),深圳市纪委教育调研室主任科员、副处级纪检员、办公厅副主任、党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、纪委书记,深圳市投控资本有限公司监事。

李平先生,董事,工商管理硕士,中国籍。曾任职深圳市城建集团办公室文秘、董办文秘,深圳市投资控股有限公司办公室(信访办)高级主管、企业三部高级主管。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长,深圳市城市建设开发(集团)公司董事。

李自成先生,董事,近现代史专业硕士,中国籍。曾任职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、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司党总支副书记、总经理。

王斌先生,董事,临床医学博士,中国籍。曾任职安徽泗县人民医院临床医生,瑞金医院主治医师,兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理。现任兴业证券研究所总经理。

杨小松先生,董事,经济学硕士,中国注册会计师,中国籍。曾任职德勤国际会计师行会计专业翻译,光大银行证券部职员,美国NASDAQ实习职员,证监会处长、副主任,南方基金管理有限公司督察长。现任南方基金管理股份有限公司总裁、党委副书记,南方东英资产管理有限公司董事。

姚景源先生,独立董事,经济学硕士,中国籍。曾任职国家经委副处长,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,中国籍。曾任职东南大学经济管理学院教授,南京大学工程管理学院院长。现任南京大学-牛津大学金融创新研究院院长、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,中国金融学年会常务理事,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,法学硕士,香港证券及投资学会杰出资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察,香港证券及期货专员办事处证券主任,香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生,独立董事,经济学硕士,工商管理硕士,中国注册会计师,中国籍。曾任职北京市财政局干部,深圳蛇口中华会计师事务所经理,京都会计师事务所副主任。现任致同会计师事务所(特殊普通合伙)管理合伙人,中国证监会第三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。

周蕊女士,独立董事,法学硕士,中国籍。曾任职北京市万商天勤(深圳)律师事务所律师,北京市中伦(深圳)律师事务所律师,北京市信利(深圳)律师事务所律师、合伙人。现任金杜律师事务所合伙人,全联并购公会广东分会会长,广东省律师协会女律师工作委员会副主任,深圳市中小企业改制专家服务团专家,深圳市女企业家协会理事。

1.2.2 监事会成员

吴晓东先生,监事会主席,法律博士,中国籍。曾任职中国证监会副处长、处长,华泰证券合规总监,华泰联合证券副总裁、党委书记、董事长。现任南方基金管理股份有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司董事长。

舒本娥女士,监事,大学本科学历,中国籍。曾任职熊猫电子集团公司财务处处长,华泰证券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总监,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,华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士,监事,大学本科学历,高级会计师,中国籍。曾任职浙江兰溪马涧米厂主管会计,浙江兰溪纺织机械厂主管会计,深圳市建筑机械动力公司会计,深圳市建设集团计划财务部助理会计师,深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理,深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长、考核分配部部长。现任深圳市投资控股有限公司财务部部长、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。

王克力先生,监事,船舶工程专业学士,中国籍。曾任职厦门造船厂技术员,厦门汽车工业公司总经理助理,厦门国际信托有限公司国际广场筹建处副主任,厦信置业发展公司总经理、投资部副经理、自有资产管理部副经理职务。现任厦门国际信托有限公司投资发展部总经理。

林红珍女士,监事,工商管理硕士,中国籍。曾任职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,兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、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)、风险管理部总经理。现任兴业证券财务部、资金运营管理部总经理,兴证期货管理有限公司董事,兴业创新资本管理有限公司监事。

张德伦先生,职工监事,企业管理硕士学历,中国籍。曾任职北京邮电大学副教授,华为技术有限公司处长,汉唐证券人力资源管理总部总经理,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。现任南方基金管理股份有限公司党委组织部部长、人力资源部总经理、执行董事,南方资本管理有限公司董事。

苏民先生,职工监事,计算机硕士研究生,中国籍。曾任职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。现任南方基金管理股份有限公司风险管理部总经理、执行董事。

林斯彬先生,职工监事,民商法专业硕士,中国籍。曾任职金杜律师事务所证券业务部实习律师,上海浦东发展银行深圳分行资产保全部职员,银华基金监察稽核部法务主管,民生加银基金监察稽核部职员。现任南方基金管理股份有限公司监察稽核部董事。

1.2.3 公司高级管理人员

张海波先生,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,工商管理硕士,经济师,中国籍。曾任职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,南方资本管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

朱运东先生,副总裁,经济学学士,高级经济师,中国籍。曾任职财政部地方预算司及办公厅秘书,中国经济开发信托投资公司综合管理部总经理,南方资本管理有限公司北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

常克川先生,副总裁,EMBA工商管理硕士,中国籍。曾任职中国农业银行副处级秘书,南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理,华泰联合证券董事会秘书、合规总监等职务,南方资本管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生,副总裁,工商管理硕士,中国籍。曾任职美国AXA Financial 公司投资部高级分析师,南方基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、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董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官(固定收益)。

史博先生,副总裁,经济学硕士,特许金融分析师(CFA),中国籍。曾任职博时基金管理有限公司研究员、市场部总助,中国人寿资产管理有限公司股票部高级投资经理,泰达宏利基金管理有限公司投资副总监、研究总监、首席策略分析师、基金经理,南方基金管理有限公司基金经理、研究部总监、总裁助理兼首席投资官(权益)。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官(权益)。

鲍文革先生,督察长,经济学硕士,中国籍。曾任职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,南方基金管理有限公司运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理。现任南方基金管理股份有限公司督察长,南方资本管理有限公司董事。

1.2.4 基金经理

何康先生,西南财经大学金融学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于国海证券固定收益部、大成基金固定收益部、南方基金固定收益部、国海证券金融市场部,历任研究员、投资经理、基金经理、副总经理;2013年11月至2016年8月,任南方丰元、南方聚利基金经理;2014年4月至2016年8月,任南方通利基金经理;2015年2月至2016年8月,任南方双元基金经理。2017年6月加入南方基金;2017年8月至今,任南方双元、南方聚利基金经理;2017年9月至今,任南方稳利基金经理;2017年12月至今,任南方通利基金经理;2018年4月至今,任南方涪利基金经理;2018年5月至今,任南方荣尊基金经理;2018年9月至今,任南方赢元基金经理。

1.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官(固定收益)李海鹏先生,现金投资部总经理夏晨曦先生,交易管理部总经理王珂女士,固定收益投资部总经理李璇女士,固定收益专户投资部总经理乔羽夫先生,固定收益研究部总经理陶铄先生,权益专户投资部总经理刘树坤先生。

1.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

§2 基金托管人

(一) 基金托管人概况

1. 基本情况

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)

住所:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:洪崎

成立时间:1996年2月7日

基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号

组织形式:其他股份有限公司(上市)

注册资本:28,365,585,227元人民币

存续期间:持续经营

电话:010-58560666

联系人:罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康的发展势头。

2000年12月19日,中国民生银行A股股票(600016)在上海证券交易所挂牌上市。 2003年3月18日,中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券,成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。 2009年11月26日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来,按照“团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守法;讲究质量,提高效益,健康发展”的经营发展方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新,实现了低风险、快增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2013年度,民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资金托管银行”及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届“21世纪亚洲金融年会”上,民生银行荣获“2013?亚洲最佳投资金融服务银行”大奖。

在“2013第五届卓越竞争力金融机构评选”中,民生银行荣获“2013卓越竞争力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书(2013)》中,民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在2013年第十届中国最佳企业公民评选中,民生银行荣获“2013年度中国最佳企业公民大奖”。

2013年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。

2014年获评中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目奖”。

2014年荣获《亚洲企业管治》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014亚洲企业管治典范奖”。

2014年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。

2014年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”,获得《21世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖,获评《经济观察》报“年度卓越私人银行”等。

2015年度,民生银行在《金融理财》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行奖”。

2015年度,民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015年度,民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书(2015)》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。

2015年度,民生银行在《经济观察报》主办的2014-2015年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

2016年度,民生银行荣获2016胡润中国新金融50强和2016中国最具创新模式新金融企业奖。

2、主要人员情况

张庆先生,中国民生银行资产托管部总经理,博士研究生,具有基金托管人高级管理人员任职资格,从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作,具有25年金融从业经历,不仅有丰富的一线实战经验,还有扎实的总部管理经历。历任中国民生银行西安分行副行长,中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工70人,平均年龄37岁,100%员工拥有大学本科以上学历,65%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向,秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念,依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台,为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至2018年9月30日,中国民生银行已托管178只证券投资基金。中国民生银行于2007年推出“托付民生·安享财富”托管业务品牌,塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象,赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评,深化了与客户的战略合作。自2010年至今,中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖,荣获《21世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1. 内部风险控制目标

强化内部管理,保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行,保证自觉合规依法经营,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系,保障业务正常运行,维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

2. 内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司审计部、资产托管部内设风险监督中心及资产托管部各业务中心共同组成。总行审计部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的风险监督中心,负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划,组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心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)全面性原则:风险控制必须覆盖资产托管部的所有中心和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一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。

(2)独立性原则:资产托管部设立独立的风险监督中心,该中心保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则:各中心在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4. 内部风险控制制度和措施

(1)制度建设: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。

(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估:风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

(6)应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

5. 资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务,中国民生银行股份有限公司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,中国民生银行股份有限公司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。

(2)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。中国民生银行股份有限公司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中心和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制,横向多中心制的内部组织结构,形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设,已经建立了一整套内部风险控制制度,包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要,制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心,依照有关法律规章,定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中,技术控制风险比制度控制风险更加可靠,可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证,托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

(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

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,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,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

§3 相关服务机构

3.1 销售机构

3.1.1 直销机构

南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人:张海波

电话:0755-82763905、82763906

传真:0755-82763900

联系人:张锐珊

3.1.2 代销机构

代销机构:无。

3.2 登记机构

名称:南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人:张海波

电话:(0755)82763849

传真:(0755)82763868

联系人:古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称:北京市盈科(深圳)律师事务所

注册地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座3层

负责人:姜敏

电话:(0755)36866820

传真:(0755)36866661

经办律师:戴瑞冬、付强

3.4 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号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系人:曹阳

联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:薛竞、曹阳

§4 基金名称

南方涪利定期开放债券型发起式证券投资基金

§5 基金的类型

债券型证券投资基金

§6 基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,力争获得长期稳定的投资收益。

§7 基金的投资范围

本基金主要投资于国内依法发行上市交易的国债、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、同业存单、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金不投资股票、权证等权益资产,也不投资可转换债券。

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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。应开放期流动性需要,为保护持有人利益,本基金开放期开始前5个工作日、开放期以及开放期结束后的5个工作日内,本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内,本基金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,封闭期内不受上述5%的限制。

§8 基金的投资策略

1、信用债投资策略

本基金将重点投资信用类债券,以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源,本基金将在南方基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的高投资收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响,一是市场信用利差曲线的走势;二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等的分析,判断市场信用利差曲线整体及分行业走势,确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资,减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。

2、收益率曲线策略

收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化,相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略;其次,通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较,可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。

3、杠杆放大策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金,并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。

4、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

5、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。

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,基金还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:中债综合指数收益率。

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。中债综合指数是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数,是中债指数应用最广泛指数之一,由中央国债登记结算有限责任公司专门针对债券市场投资性需求开发的指数,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,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时,本基金可以与托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需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,一般而言,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,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9月30日(未经审计)。

1.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	489,725,451.30	97.29
	其中:债券	489,725,451.30	97.29
	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	6,643,187.81	1.32
8	其他资产	7,002,157.16	1.39
9	合计	503,370,796.27	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

金额单位:人民币元

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	19,128,000.00	6.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	211,773,000.00	66.42
	其中:政策性金融债	30,447,000.00	9.55
4	企业债券	110,866,451.30	34.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	99,808,000.00	31.30
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	48,150,000.00	15.10
9	其他	-	-
10	合计	489,725,451.30	153.59

1.5 报告期末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

金额单位:人民币元

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	111881025	18杭州银行CD056	500,000	48,150,000.00	15.10
2	1820025	18稠州商行绿色金融01	300,000	30,534,000.00	9.58
3	180202	18国开02	300,000	30,447,000.00	9.55
4	1820026	18通商银行债01	300,000	30,429,000.00	9.54
5	101468001	14长虹MTN001	300,000	30,267,000.00	9.49

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

无。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

1.10.3 本期国债期货投资评价

无。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除18厦门农商小微债01(证券代码1821032)、18通商银行债01(证券代码1820026)、18杭州银行CD056(证券代码111881025)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、2018年1月25日,中国银行业监督管理委员会厦门银监局发布厦银监罚决字(2017)19号行政处罚决定书,对厦门农村商业银行股份有限公司的违法违规行为进行处罚。

2、2018年8月,宁波通商银行因贷款“三查”严重不审慎被罚30万元。

3、2017年12月,杭州银行(600926)因涉及个人消费贷款资金流入股市、虚增存贷款、办理未发生现金转移的存取现业务等多项违规被处罚款140万元。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

1.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对