

信息披露 Disclosure

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			3,393,300.00	8.95
2	央行票据			—	—
3	金融债券			—	—
4	企业债券			—	—
5	企业短期融资券			—	—
6	中期票据			40,322,000.00	90.36
7	可转换(可交换)债			—	—
8	资产支持证券			—	—
9	其他			—	—
10	合计			44,315,300.00	99.31

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

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	110206	11年国开MTN1	100,000	10,261,000.00	23.20
2	101353010	13年国开MTN202	100,000	10,211,000.00	22.88
3	101464067	14建财债MTN001	100,000	10,154,000.00	22.75
4	104166605	16世纪债MTN001	100,000	9,606,000.00	21.53
5	1016562	16国债24	40,000	3,993,300.00	8.95

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十名金融债券投资明细

注:本基金本报告期末未有持有金融债券。

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

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过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。

1.11.2 本基金投资的前十名权证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

序号	名称	金额(人民币元)
1	有价证券	1,272.40
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收利息	481,262.73
5	应收申购款	208,728.21
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	691,263.34

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存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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请仔细阅读本基金的招募说明书。

南方中债中债指数跟踪债券发起式

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
2013.5.3-2013.12.31	0.44%	0.05%	-3.70%	0.08%	4.14%	-0.03%
2014.1.1-2014.12.31	8.41%	0.09%	5.11%	0.08%	3.30%	0.01%
2015.1.1-2015.12.31	7.18%	0.06%	4.62%	0.07%	2.56%	0.01%
2016.1.1-2016.12.31	-1.12%	0.09%	-2.01%	0.09%	0.89%	0.00%
2017.1.1-2017.9.30	0.44%	0.07%	-0.51%	0.06%	0.95%	0.01%
自基金成立起至今	15.91%	0.08%	3.30%	0.08%	12.61%	0.00%

南方中债中债指数跟踪债券发起式

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
2013.5.3-2013.12.31	0.23%	0.05%	-3.70%	0.08%	3.93%	-0.03%
2014.1.1-2014.12.31	8.12%	0.09%	5.11%	0.08%	3.01%	0.01%
2015.1.1-2015.12.31	6.95%	0.06%	4.62%	0.07%	2.33%	0.01%
2016.1.1-2016.12.31	-1.36%	0.09%	-2.01%	0.09%	0.65%	0.00%
2017.1.1-2017.9.30	0.31%	0.07%	-0.51%	0.06%	0.82%	0.00%
自基金成立起至今	14.67%	0.08%	3.30%	0.08%	11.37%	0.00%

§ 13 基金的业绩比较

1.3.1 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、从C类基金的销售收入中计提的销售服务费;

4、基金管理人向标的基金投资者支付的对价指数的使用费;

5、因基金的证券交易或结算而产生的费用;

6、基金合同生效后的信息披露费用;

7、基金持有人大会的费用;

8、基金资产的资金汇划费用;

10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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0.30%。本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,经基金管理人代付给各个基金份额持有人。

4、本条第一款第3至第10项费用由基金管理人及基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

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、基金管理人和基金托管人的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须于新的费率实施日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种税收,依照国家法律法规的规定和相应税收政策执行。

1.2.2 与基金费用有关的事项

1、本基金A类基金份额在申购/赎回时收取前端申购费,C类基金份额不收取申购费,但从本类基金份额资产中计提销售服务费。本基金前端申购费率最高不超过0.5%,且随申购金额的递增而递减,如下表所示:

申购金额(M)	A类申购费率
M < 100万	0.5%
100万 ≤ M < 500万	0.3%
M ≥ 500万	每笔1000元

申购费用(含基金管理人承担,不列入基金资产),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A类基金份额赎回费率不高于0.1%,随申购持有时间增加而递减(其中1年为365天),如下表所示:

持有期限(N)	赎回费率
---------	------