

(上接A53版)

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 47, 48, 49, 50, 51, 52, 53, 54, 55, 56, 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73, 74, 75, 76, 77, 78, 79, 80.

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 81, 82, 83, 84, 85, 86, 87, 88, 89, 90, 91, 92, 93, 94, 95, 96, 97, 98, 99, 100, 101, 102, 103, 104, 105, 106, 107, 108, 109, 110, 111, 112.

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 113, 114, 115, 116, 117, 118, 119, 120, 121, 122, 123, 124, 125, 126, 127, 128, 129, 130, 131, 132, 133, 134, 135, 136, 137, 138, 139, 140, 141, 142, 143, 144, 145, 146, 147, 148.

3.2 登记机构 南方基金管理有限公司 住所及办公地址: 深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦13-33层 法定代表人: 张海波 电话: (0755) 82763849 传真: (0755) 82763854 联系人: 古淑卿

3.3 出具法律意见书的律师事务所 广东华瀚律师事务所 注册地址: 深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场大厦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、戴理冬

3.4 审计会计师事务所 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: 上海市湖滨道202号普华永道中心11楼 执行事务合伙人: 李丹 联系电话: (021) 23238888 传真: (021) 23238800 联系人: 陈敏 经办注册会计师: 薛竟、陈嘉

4 基金名称 南方恒元保本混合型证券投资基金 5 基金的类型 保本混合型证券投资基金 6 基金的投资目标 本基金在严格控制风险的前提下, 为投资者提供保本金额的保证, 并在此基础上力争基金资产的稳定增值。

7 基金的投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的各种债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

8 基金的投资策略 本基金采用恒定比例投资组合保险策略(Constant-Propotion Portfolio Insurance, CPPI)来实现保本增值的目标。恒定比例投资组合保险不仅从投资组合资产配置的水平上消除投资组合时基金净值低于本金的可能性, 而且能在一定程度上使本基金分享股票市场整体上涨的好处。

9 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准: 3年期银行定期存款税后收益率。 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, 或者有更更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时, 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。

10 基金的风险收益特征 本基金为保本基金, 属于证券投资基金中的低风险品种。 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, 也不保证最低收益。

11 基金的投资组合报告 截至2017年9月30日(未经审计), 本基金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如下表所示:

Table with 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(%)

12 报告期末按行业分类的股票投资组合 12.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

12.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 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债券投资明细

Table with 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(%)

1.1 投资组合报告 1.1.1 报告期末基金资产组合情况 1.1.2 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 1.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

1.1.4 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 1.1.5 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贵金属投资明细 1.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细 1.1.7 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国债期货投资明细

1.1.8 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资产支持证券投资明细 1.1.9 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 1.1.10 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 1.1.11 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股指期货投资明细 1.1.12 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国债期货投资明细

1.1.13 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资产支持证券投资明细 1.1.14 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 1.1.15 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股指期货投资明细 1.1.16 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国债期货投资明细

1.1.17 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资产支持证券投资明细 1.1.18 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 1.1.19 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股指期货投资明细 1.1.20 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国债期货投资明细

1.1.21 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资产支持证券投资明细 1.1.22 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 1.1.23 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股指期货投资明细 1.1.24 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国债期货投资明细

1.1.25 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资产支持证券投资明细 1.1.26 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 1.1.27 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股指期货投资明细 1.1.28 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国债期货投资明细

1.1.29 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资产支持证券投资明细 1.1.30 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 1.1.31 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股指期货投资明细 1.1.32 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国债期货投资明细

1.1.33 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资产支持证券投资明细 1.1.34 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 1.1.35 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股指期货投资明细 1.1.36 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国债期货投资明细

1.1.37 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资产支持证券投资明细 1.1.38 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 1.1.39 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股指期货投资明细 1.1.40 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国债期货投资明细

1.1.41 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资产支持证券投资明细 1.1.42 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 1.1.43 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股指期货投资明细 1.1.44 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国债期货投资明细

1.1.45 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资产支持证券投资明细 1.1.46 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 1.1.47 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股指期货投资明细 1.1.48 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国债期货投资明细

1.1.49 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资产支持证券投资明细 1.1.50 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 1.1.51 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股指期货投资明细 1.1.52 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国债期货投资明细

1.1.53 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资产支持证券投资明细 1.1.54 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 1.1.55 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股指期货投资明细 1.1.56 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国债期货投资明细

1.1.57 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资产支持证券投资明细 1.1.58 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 1.1.59 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股指期货投资明细 1.1.60 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国债期货投资明细

Table with 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(%)

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 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 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五名资产支持证券投资明细 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 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 1.9 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股指期货投资明细 1.10 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国债期货投资明细

1.11 投资组合报告 1.1.1 报告期末基金资产组合情况 1.1.2 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 1.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

1.1.4 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 1.1.5 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股指期货投资明细 1.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

1.1.7 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资产支持证券投资明细 1.1.8 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 1.1.9 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股指期货投资明细 1.1.10 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国债期货投资明细

1.1.11 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资产支持证券投资明细 1.1.12 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 1.1.13 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股指期货投资明细 1.1.14 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国债期货投资明细

1.1.15 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资产支持证券投资明细 1.1.16 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 1.1.17 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股指期货投资明细 1.1.18 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国债期货投资明细

1.1.19 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资产支持证券投资明细 1.1.20 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 1.1.21 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股指期货投资明细 1.1.22 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国债期货投资明细

1.1.23 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资产支持证券投资明细 1.1.24 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 1.1.25 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股指期货投资明细 1.1.26 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国债期货投资明细

1.1.27 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资产支持证券投资明细 1.1.28 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 1.1.29 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股指期货投资明细 1.1.30 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国债期货投资明细

1.1.31 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资产支持证券投资明细 1.1.32 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 1.1.33 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股指期货投资明细 1.1.34 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国债期货投资明细

1.1.35 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资产支持证券投资明细 1.1.36 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 1.1.37 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股指期货投资明细 1.1.38 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国债期货投资明细

1.1.39 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资产支持证券投资明细 1.1.40 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 1.1.41 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股指期货投资明细 1.1.42 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国债期货投资明细

1.1.43 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资产支持证券投资明细 1.1.44 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 1.1.45 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股指期货投资明细 1.1.46 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国债期货投资明细

1.1.47 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资产支持证券投资明细 1.1.48 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 1.1.49 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股指期货投资明细 1.1.50 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国债期货投资明细

1.1.51 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资产支持证券投资明细 1.1.52 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 1.1.53 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股指期货投资明细 1.1.54 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国债期货投资明细

1.1.55 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资产支持证券投资明细 1.1.56 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 1.1.57 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股指期货投资明细 1.1.58 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国债期货投资明细

1.1.59 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资产支持证券投资明细 1.1.60 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 1.1.61 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股指期货投资明细 1.1.62 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国债期货投资明细

1.1.63 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资产支持证券投资明细 1.1.64 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 1.1.65 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股指期货投资明细 1.1.66 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国债期货投资明细

1.1.67 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资产支持证券投资明细 1.1.68 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 1.1.69 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股指期货投资明细 1.1.70 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国债期货投资明细

1.1.71 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资产支持证券投资明细 1.1.72 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 1.1.73 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股指期货投资明细 1.1.74 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国债期货投资明细

1.1.75 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资产支持证券投资明细 1.1.76 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 1.1.77 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股指期货投资明细 1.1.78 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国债期货投资明细

1.1.79 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资产支持证券投资明细 1.1.80 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 1.1.81 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股指期货投资明细 1.1.82 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国债期货投资明细

1.1.83 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资产支持证券投资明细 1.1.84 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 1.1.85 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股指期货投资明细 1.1.86 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国债期货投资明细

1.1.87 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资产支持证券投资明细 1.1.88 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 1.1.89 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股指期货投资明细 1.1.90 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国债期货投资明细

1.1.91 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资产支持证券投资明细 1.1.92 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 1.1.93 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股指期货投资明细 1.1.94 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国债期货投资明细

1.1.95 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资产支持证券投资明细 1.1.96 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 1.1.97 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股指期货投资明细 1.1.98 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国债期货投资明细