

(上接B85版)

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 国联证券股份有限公司, 华泰证券股份有限公司, etc.

Table with columns for company name, address, and contact information. Includes entries for 上海东方证券资产管理有限公司, 中航证券有限公司, etc.

3.2 登记机构
名称:中国证券投资基金业协会
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
电话:010-59378856
传真:010-59378907
联系人:崔巍
3.3 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(86 21) 3135 8666
传真:(86 21) 3135 8600
经办律师:黎明、丁媛
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
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:薛竟、曹阳
4 基金名称
南方中债10年期国债指数证券投资基金
5 基金的类型
债券型证券投资基金
6 基金的投资目标
本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标指数的有效跟踪。
7 基金的投资范围
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性银行金融债、债券回购、银行存款等固定收益类资产、国债期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。
8 基金的投资策略
8.1 投资策略
本基金为被动式指数基金,采用抽样复制和动态优化法,选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标指数的有效跟踪。
8.2 资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于中债10年期国债指数成份券和备选成份券。
9 基金业绩比较基准
中债10年期国债指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

但不保证基金一定盈利。
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。
本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日(未经审计)。
1 报告期末基金资产组合情况
2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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
4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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
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
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
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
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
10.3 本期国债期货投资评价
11 投资组合报告附注
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。
11.2 声明本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表。
11.3 其他资产构成
11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
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。基金的投资业绩并不代表其未来表现,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。
南方中债10年期国债指数A
南方中债10年期国债指数C
13 基金的费用概览
13.1 与基金运作有关的费用
1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 基金托管人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费;
4. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费;
6. 基金份额持有人大会费用;
7. 基金的证券/期货交易费用;
8. 基金的银行汇划费用;
9. 基金银行账户的开户及维护费用;
10. 从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;
11. 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。
13.2 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. 基金托管人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费;
4. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费;
6. 基金份额持有人大会费用;
7. 基金的证券/期货交易费用;
8. 基金的银行汇划费用;
9. 基金银行账户的开户及维护费用;
10. 从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;
11. 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。
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施的投资管理活动,对本基金的原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“基金管理人”部分,对“基金管理人概况”进行了更新;
3. 在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新;
4. 在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新;
5. 在“基金的投资”部分,对“基金投资组合报告”进行了更新;
6. 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;
7. 在“其他应披露事项”部分,对“其他应披露事项”进行了更新;
8. 对部分其他表述进行了更新。
南方基金集团股份有限公司
2019年9月19日

Financial tables including '基金资产组合情况', '股票投资组合', '债券投资组合', '资产支持证券投资', '股指期货持仓', '国债期货持仓', '基金业绩比较基准', and '基金费用概览'. Includes various charts and data points.