(上接B77版)

75	深圳众禄金融控股股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人:薛峰 联系人:童彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-33227951 客服电话:4006-788-887 网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
76	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室;上海市虹口区欧阳路196号(法兰桥创意园)26号楼2楼 法定代表人:杨文斌 联系人:张茹 电话:021-20613999 传真:021-68596916 客服电话:400-700-9665 网址:www.ehowbuy.com
77	杭州数米基金销售有限公司	注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室 办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼 法定代表人:陈柏青 联系人:韩爱彬 电话:0571-81137494 客服电话:4000-766-123 网址:http://www.fund123.cn/
78	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 法定代表人:张跃伟 联系人:单丙烨 电话:021-20691832 传真:021-20691861 客服电话:400-820-2899 网址:www.erichfund.com
79	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座7楼 法定代表人:其实 联系人:潘世友 电话:021-54509998 传真:021-64385308 客服电话:400-1818188 网址:www.1234567.com.cn
80	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层 法定代表人:闫振杰 联系人:马林 电话:010-59601366 传真:010-62020355 客服电话:4008188000 网址:www.myfund.com
81	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室 办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼 法定代表人:凌顺平 联系人:吴杰 电话:0571-88911818-8653 传真:0571-86800423 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com
82	中期资产管理有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号 办公地址:北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层 法定代表人:蒲新 联系人:侯美捷 电话:010-65807865 传真:010-65807864 客服电话:010-65807609 网址:http://www.cifcofund.com
83	万银财富(北京)基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内 办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内 法定代表人:李招弟 联系人:张莉 电话:010-59497363 传真:010-59393074 客服电话:400-059-8888 网址:www.wy-fund.com
84	和讯信息科技有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809 法定代表人:沈伟彬 联系人:王巨明 电话:010-52855713 传真:010-85894285 客服电话:4006099200 网址:www.yixinfund.com
85	宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室 办公地址:杭州市拱墅区登云路43号金诚集团(锦昌大厦)13楼 法人:徐黎云 联系人:来舒岚 电话:0571-88337888 传真:0571-88337666 客服电话:400-068-0058 网址:www.jincheng-fund.com
86	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 办公地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 法定代表人:于海锋 联系人:邓鹏 电话:13981713068 传真:028-82000996-805 客服电话:400-8588588 网址:http://www.pyfund.cn
87	泛华普益基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 法定代表人:赵学军 联系人:景琪 电话:021-20289890 传真:021-20280110 客服电话:400-021-8850 网址:www.harvestwm.cn
88	嘉实财富管理有限公司	注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 法定代表人:杨鹏 联系人:张涛 电话:010-83363099 传真:010-83363072 客服电话:400-166-1188 网址:https/8.jrj.com.cn
89	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人:陈越 联系人:马鹏程 电话:010-56810780 传真:010-57756199 客服电话:400-786-8868-5 网址:www.chtfund.com
90	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 法定代表人:赵荣春 联系人:高静 电话:010-59158281 传真:010-57569671 客服电话:400-893-6885 网址:www.qianjing.com
91	北京钱景财富投资管理有限公司	注册地址:深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房(人驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405 法定代表人:牛建强 联系人:黄品圣 电话:0755-23601676 传真:0755-88603185 客服电话:4008955811 网址:www.ncfund.com
92	深圳宜投基金销售有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人:万勇 联系人:贾瑞霞 电话:0755-86722853 传真:0755-86725180 客服电话:0755-86722851 网址:http://www.ilyingfund.com.cn
93	深圳前海汇联基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层,2层,9层,11层,12层 办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层 法定代表人:王兵 联系人:赵森 电话:010-59539864 传真:010-59539985 客服电话:95162,400-8888-160 网址:www.cifco.net
94	中国国际期货有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:郭坚 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
95	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 法定代表人:梁蓉 联系人:张旭 电话:010-66154828 传真:010-88067526 客服电话:400-6262-818 网址:www.5ifm.com
96	海银基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元 办公地址:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼 法定代表人:刘惠 联系人:刘艳妮 电话:021-80133827 传真:021-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.fundhaiyin.com
97	上海联泰资产管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼 法定代表人:燕斌 联系人:汤靖 电话:021-51507071 传真:021-62900063 客服电话:4000-466-788 网址:http://www.66money.com
98	北京增财基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 法定代表人:罗细安 联系人:史丽丽 电话:010-67000988-6028 传真:010-67000988-6000 客服电话:010-67000988 网址:www.zcye.com.cn
99	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区淞川路5475号1033室 办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人:沈微伟 联系人:赵添然 电话:021-50583533 传真:021-50583633 客服电话:4000676266 网址:www.leadfund.com.cn
100	上海汇付金融服务有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 办公地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 法定代表人:冯修敏 联系人:周丹 电话:021-33323999 传真:021-33323993 客服电话:400-820-2819 网址:https://fty.chinapnr.com
101	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 法定代表人:陈洪生 联系人:李智磊 电话:0592-3122716 传真:0592-3122701 客服电话:0592-3122679 网址:www.xds.com.cn
102	中信建投期货有限公司	注册地址:重庆 办公地址:渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C 法定代表人:彭文德 联系人:万忠 电话:021-68762007 传真:021-68763048 客服电话:400-8877-780 网址:www.cfc108.com
103	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:郭坚 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
104	中经北证(北京)资产管理有限公司	注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室,14层 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室,14层 法定代表人:张皓 联系人:黄岚 电话:0755-23953913 传真:0755-83217421 客服电话:400-990-8826 网址:http://www.ctiecf.com
105	中信期货有限公司	注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 法定代表人:董酒 联系人:张婷婷 电话:18510450202 客服电话:400-068-1176 网址:www.jimufund.com
106	北京乐融多源投资咨询有限公司	注册地址:北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 办公地址:北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 法定代表人:张欣行 联系人:付文红 电话:010-62675369 客服电话:010-82244185 网址:http://www.xincai.com
107	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔B1201-1203室 法定代表人:肖雯 联系人:吴振浩 电话:020-89629099 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
108	珠海盈米财富管理有限公司	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告
109		

3.2登记机构
名称:南方基金管理有限公司
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31,32,33层整层
法定代表人:吴万善
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:广东华商律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座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、戴瑞冬
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:陈燕
经办注册会计师:薛竞、陈燕

§4基金名称

南方中债中期票据指数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

本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。

§7基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券。为了更好地实现投资目标,本基金还可以投资于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等,以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的90%,其中标的指数成份券投资比例不低于本基金债券资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定,本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等,也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。
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。

§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,主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基础,综合考虑债券利息类型、债券主体资质、债券剩余期限和债券流动性等因素构建组合,并根据本基金日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券交易特性及交易惯例等情况,进行优化操作,以力争对标的指数的有效跟踪。
在正常市场情况下,力争本基金在扣除各项费用之前的总回报与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取有措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
为了实现更好的跟踪标的指数的目的,基金管理人还将综合考虑标的指数成份券的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本,以及税务及其他监管限制,决定是否采用其他复制方法的策略。对于复制方法的变更,无需召开基金份额持有人大会,但本基金管理人需在方法变更前依照《信息披露办法》在指定媒体公告,并阐明变更复制方法的原因。
1.资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的90%,其中标的指数成份券投资比例不低于本基金债券资产的80%。本基金将主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基础,综合考虑债券利息类型、债券主体资质、债券剩余期限和债券流动性等因素构建组合,并根据本基金日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券交易特性及交易惯例等情况,进行优化操作,以力争对标的指数的有效跟踪。
2.债券投资策略
本基金主要通过抽样复制法进行被动式指数化投资,主要根据标的指数各成份券构成,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。
(1)债券投资组合的构建
本基金主要采用抽样复制的方法,在综合考虑个券的发行规模、流动性、行业等因素的基础上,根据债券利率类型、发债主体资质和债券剩余期限进行分层抽样,选择部分抽样债券构建投资组合,并根据银行间债券交易特性及交易惯例等情况进行优化,确定投资组合中各债券的配置比例。
1)债券预分层
由于债券的利息类型、剩余期限和主体资质是债券价格的重大决定性因素,因此本基金在抽样复制时,首先按照债券利率类型进行分层;再根据债券的剩余期限进行分层;然后再按照债券的主体资质进行分层。
2)分层抽样
在每个债券同质层,主要根据久期匹配的原则抽取成份券,并且根据债券发行主体行业、债券发行规模、市场流动性进行优化处理。
3)确定最终抽样组合
根据各债券分层的市值占比最终决定抽取样本的权重,并根据银行间债券交易特性及交易惯例等情况进行优化调整,最终确定抽样组合。
(2)债券投资组合的调整
本基金为抽样复制的指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、新债发行、申购赎回变动情况等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金总值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。
1)定期季度调整
本基金所构建的指数化投资组合将每个季度根据上述方法进行优化处理,调整债券投资组合及个券配置比例。
2)不定期调整
a)根据指数编制规则,当成份券组成发生变动,本基金将根据指数的新构成,运用抽样复制方法进行相应调整;
b)根据标的指数新债纳入规则,本基金将综合考虑组合调整需求,参与债券一级市场投标;
c)本基金处理日常申购赎回时,本基金将综合考虑交易规模、交易惯例和成份券的流动性等因素,对债券投资组合进行动态调整。
3.其他
本基金将关注国内金融衍生产品的推出情况,如法律法规或监管机构允许基金投资债券市场的期权、期货等衍生工具,本基金将制定与本基金投资目标相适应的投资策略,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。
8.2投资决策依据和决策程序
1.决策依据
(1)国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提。
(2)宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础。
(3)投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障。
2.决策程序
(1)决定主要投资原则:投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资原则,并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
(2)提出投资建议:依托基金管理人固定收益投资研究团队,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、成份券公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,结合基金合同、投资制度向基金经理提出投资建议。
(3)制定投资决策和组合构建:基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。根据标的指数,结合研究报告,基金经理以抽样复制法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,降低买入成本、控制投资风险。
(4)交易执行:交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖,同时判断执行该投资指令是否将发生违法、违规行为,是否会发生特殊交易,是否将要超过比例限制等,履行一线监控职责。
(5)进行风险评估:风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估,并出具风险监控报告。
(6)组合维护:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份券基本面情况、流动性状况、基金申赎情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整。
(7)评估和调整决策程序:基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

§9基金业绩比较基准

中债-新中期票据总指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
本基金的标的指数为中债-新中期票据总指数。
如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权、或标的指数出其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致标的指数不宜继续作为本基金的业绩基准的指数时,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并按中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项)或由此引起的业绩比较基准或基金名称的变更,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

§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。本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相联的风险收益特征。

§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2015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	固定收益投资	92,505,000.00	98.10
	其中:债券	92,505,000.00	98.10
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	138,030.74	0.15
7	其他资产	1,650,601.74	1.75
8	合计	94,293,632.48	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期未持有股票
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
注:本基金本报告期未未持有股票
1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,031,000.00	14.17
	其中:政策性金融债	10,031,000.00	14.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	82,474,000.00	116.54
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	92,505,000.00	130.71

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	1182085	11华润MTN1	100,000	10,748,000.00	15.19
2	101460018	14陕延油MTN001	100,000	10,500,000.00	14.84
3	101459019	14浙国贸MTN001	100,000	10,383,000.00	14.67
4	101453015	14联通MTN002	100,000	10,238,000.00	14.47
5	101452027	14电网MTN002	100,000	10,212,000.00	14.43

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
注:本基金本报告期末未持有贵金属投资
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持有权证
1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资国债期货
1.10 投资组合报告附注
1.10.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。
1.10.2
本基金本报告期末未持有股票。
1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,438,104.20
5	应收申购款	212,497.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,650,601.74

1.10.4 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持有处于转股期的可转换债券
1.10.5 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持有股票

§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。

南方中债中期票据指数债券发起式A

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%
2015.1.1-2015.9.30	4.63%	0.08%	3.01%	0.07%	1.62%	0.01%
自基金成立起至今	13.93%	0.08%	4.27%	0.08%	9.66%	0.00%

南方中债中期票据指数债券发起式C

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%
2015.1.1-2015.9.30	4.47%	0.08%	3.01%	0.07%	1.46%	0.01%
自基金成立起至今	13.21%	0.08%	4.27%	0.08%	8.94%	0.00%

§13基金的费用概览

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.从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;
4.基金管理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费;
5.因基金投资券交易或结算而产生的费用;
6.基金合同生效以后的信息披露费用;
7.基金份额持有人大会费用;
8.基金合同生效以后的会计师费和律师费;
9.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。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.5%÷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。经基金管理人与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。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.1%÷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
基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与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托管人。
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×0.30%÷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。经基金管理人与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销售机构。
4.本条第一款第3至第10项费用由基金管理人和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、基金管理费和基金托管费的调整
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,无须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纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。
13.2与基金销售有关的费用
1.本基A类基金份额在申购时收取前端申购费用,C类基金份额不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金前端申购费率最高不高于0.5%,且随申购金额的增减而递减,如下表所示:

购买金额(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

申购费用由基金申购人承担,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A类基金份额赎回费率不高于0.1%,随申请份额持有时间增加而递减(其1年为365天),如下表所示:

持有期限(N)	赎回费率
N<1年	0.1%
1年≤N<2年	0.05%
N≥2年	0

本基金C类基金份额赎回费率不高于0.3%,随申请份额持有时间增加而递减,如下表所示:

持有期限(T)	赎回费率
T<90天	0.3%
T≥90天	0

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于25%。
3.基金管理人可以在法律法规和本基合同规定范围内调整申购费率和赎回费率及收取方式。申购赎回费率或收取方式如发生变更,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
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》约定的情形下,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通知。

§14对招募说明书更新部分的说明

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“主要人员情况”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,对“审计基金财产的会计师事务所”进行了更新。
5.在“基金的投资”部分,对“投资决策依据和决策程序”进行了更新,对“基金投资组合报告”,对“基金业绩”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。

南方基金管理有限公司
2015年12月 5日

关于信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)增加C类份额并修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规及《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定,为更好的满足广大投资人的理财要求,信诚基金管理有限公司(以下简称“本公司”)作为信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)协商一致,决定于2015年12月7日起对旗下信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”或“信诚新旺”)增加收取销售服务费的C类份额,并对本基金的基金合同作相应修改。现将具体事宜公告如下:
一、增加C类份额
自2015年12月7日起,本基金增加C类份额并分别设置对应的基金代码,投资人申购时可以自主选择A类份额(现有份额)或C类份额对应的基金代码进行申购。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。目前已持有本基金份额的投资人,其基金账户中保留的本基金份额余额为A类份额。A类份额和C类份额销售费率如下所示:
(一)本基金A类份额在申购时收取申购费用。本基金C类份额不收取申购费用。A类份额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。
基金份额的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。
(二)信诚新旺A类份额(现有份额),基金代码:165526。
1、本基金A类份额的场外申购费率如下:

单笔申购金额(含申购费)	申购费率
M < 50万	1.50%
50万 ≤ M < 200万	1.20%
200万 ≤ M < 500万	0.80%
M ≥ 500万	1000元/笔

(注:M:申购金额;单位:元)
本基金A类份额的场内申购费率由基金销售机构参照场外申购费率执行。
2、本基金A类份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减,场外赎回的实际执行的费率如下:

持有时间	场外赎回费率
Y<1年	0.125%
1年≤Y<2年	0.063%
Y≥2年	0

(注:Y:持有时间,其中1年为365日,2年为730日)
本基金A类份额的场内赎回费率为固定值0.125%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。
上述赎回费计入基金财产比例为100%。
从场内转托管至场外的基金份额,从场外赎回时,其持有期限从转托管转入确认日开始计算。
(三)信诚新旺C类份额(新增加的份额),基金代码:165527。
新增的C类基金份额仅开通场外份额,不开通场内份额。投资人可以场外申购与赎回C类基金份额。
1、本基金C类份额不收取申购费用。
2、本基金C类份额的赎回费率如下:

持续持有期(Y)	赎回费率
Y<30天	0.50%
Y≥30天	0

对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。
3、基金销售服务费
本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的 0.10%年费率计提。
二、本基金C类份额适用的销售机构
本基金C类份额的销售机构暂仅包括信诚基金管理有限公司直销中心柜台及电子直销平台。
如有其他销售机构新增办理本基金C类份额的申购赎回等业务,请以本公司届时相关公告为准。
三、基金合同的修订内容
为确保信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)