

南方希元可转债债券型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

（2019 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：中国农业银行股份有限公司

截止日：2019 年 03 月 14 日

重要提示

本基金经中国证监会 2017 年 11 月 29 日证监许可[2017]2175 号文注册募集。本基金的基金合同已于 2018 年 3 月 14 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风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：与投资债券及可转换债券、国债期货、资产支持证券等特定投资标的相关的特定风险；证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；基金投资过程中产生的管理风险、运作风险和不可抗力风险；法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。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，由投资者自行承担。

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 2019 年 3 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 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：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

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，南方股权投资基金管理有限公司董事长。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监事。

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。

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执行董事。

徐刚，职工监事，硕士学历，中国籍。1995年7月专科毕业于山东理工大学机电专业，2010年6月研究生毕业于兰州大学工商管理专业。1995年11月参加工作，就职于深圳期货投资公司，任职职员、项目经理，2003年6月加入公司，先后任职上海分公司职员、机构业务部职员、养老金业务部主管、上海分公司高级经理、副总经理，目前任职上海分公司董事。

董星华，职工监事，硕士学历，中国籍。1991年7月专本科毕业于华中理工大学机械工程专业，2002年6月研究生毕业于中国人民大学政治经济学专业。其1991年11月参加工作，先后就职于中国人保武汉分公司、中国人寿再保险公司、中国再保险公司、深圳证券通信公司，任职科员、主任科员、经理，2011年2月加入公司，先后任职综合管理部经理、办公室高级经理，现任办公室高级副总裁。

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，南方基金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

刘文良先生，北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015 年 2 月至 2015 年 8 月，任南方永利基金经理助理；2015 年 12 月至 2017 年 2 月，任南方弘利基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 5 月，任南方安心基金经理；2016 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方荣发基金经理；2016 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方卓元基金经理；2017 年 5 月至 2018 年 7 月，任南方和利、南方和元、南方纯元基金经理；2017 年 6 月至 2018 年 7 月，任南方高元基金经理；2017 年 8 月至 2019 年 1 月，任南方祥元基金经理；2017 年 9 月至 2019 年 1 月，任南方兴利基金经理；2015 年 8 月至今，任南方永利基金经理；2016 年 6 月至今，任南方

广利基金经理；2016年7月至今，任南方甄智混合基金经理；2018年3月至今，任南方希元转债基金经理。

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钰先生，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）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异

化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2018 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 422 只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

（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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

§ 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:深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

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

代销银行：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国农业银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：周慕冰 客服电话：95599 网址：www.abchina.com
2	中国工商银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人：易会满 联系人：谢宇晨 客服电话：95588 网址：www.icbc.com.cn
3	中国银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 客服电话：95566 网址：www.boc.cn
4	交通银行股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 办公地址：上海市银城中路 188 号 法定代表人：彭 纯 联系人：王菁 联系电话：021-58781234 客服电话：95559 网址：www.bankcomm.com
5	招商银行股份有限公司	注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 法定代表人：李建红 联系人：季平伟 客服电话：95555 网址：www.cmbchina.com
6	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号 办公地址：上海市中山东一路 12 号 法定代表人：高国富 联系人：吴斌 联系电话：021-61618888 客服电话：95528 网址：www.spdb.com.cn
7	中信银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号 办公地址：北京东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦 法定代表人：李庆萍

		联系人：丰靖 电话：010-89937330 客服电话：95558 网址：http://bank.ecitic.com/
8	平安银行股份有限公司	地址：深圳市深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 联系人：施艺帆 联系电话：021-50979384 客服电话：95511-3 网址：bank.pingan.com
9	上海银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：金煜 联系人：汤征程 联系电话：021-68475521 客服电话：95594 网址：www.bosc.cn
10	北京银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号 法定代表人：张东宁 联系人：周黎 传真：010-66225309 客服电话：95526 网址：www.bankofbeijing.com.cn
11	北京农村商业银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 办公地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 法定代表人：王金山 联系人：鲁娟 电话：010-89198762 客服电话：96198；400-88-96198；400-66-96198 网址：www.bjrcb.com
12	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号 法定代表人：冀光恒 联系人：陈玲 联系电话：021-38576830 客服电话：021-962999、4006962999 网址：www.srcb.com
13	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

		办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦 法定代表人：王耀球 联系人：林培珊 电话：0769-22866254 传真：0769-22866282 客服电话：0769-961122 网址：www.drcbank.com
14	乌鲁木齐银行股份有限公司	注册地址：乌鲁木齐市新华北路8号 办公地址：乌鲁木齐市新华北路8号 法定代表人：杨黎 联系人：余戈 电话：0991-4525212 传真：0991-8824667 客服电话：0991-96518 网址：www.uccb.com.cn
15	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河东区海河东路218号 办公地址：天津市河东区海河东路218号 法定代表人：李伏安 联系人：王宏 电话：022-58316666 传真：022-58316569 客服电话：95541 网址：www.cbhb.com.cn
16	珠海华润银行股份有限公司	注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东1346号 办公地址：广东省珠海市吉大九洲大道东1346号 法定代表人：刘晓勇 联系人：李阳 电话：96588(广东省外加拨 0756) 传真：0 客服电话：96588(广东省外加拨 0756)，4008800338 网址：www.crbank.com.cn
17	江苏江南农村商业银行股份有限公司	注册地址：常州市天宁区延宁中路668号 办公地址：常州市天宁区延宁中路668号 法定代表人：陆向阳 联系人：包静 电话：0519-80585939 传真：0519-89995066 客服电话：96005 网址：www.jnbank.cc
18	苏州银行股份有限公司	注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路

		728 号 办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号 法定代表人：王兰凤 联系人：葛晓亮 电话：0512-69868519 传真：0512-69868373 客服电话：96067 网址：www.suzhoubank.com
19	桂林银行股份有限公司	注册地址：桂林市中山南路 76 号 办公地址：桂林市中山南路 76 号 法定代表人：王能 联系人：刘兴运 电话：0773-3879905 传真：0773-3851691 客服电话：400-86-96299 网址：www.guilinbank.com.cn
20	中原银行股份有限公司	注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务 外环路 23 号中科金座大厦 办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务 外环路 23 号中科金座大厦 法定代表人：窦荣兴 联系人：张星强 电话：0371-85517713 客服电话：95186 网址：www.zybank.com.cn

代销券商及其他代销机构：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路 228 号 法定代表人：周易 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
2	兴业证券股份有限公司	注册地址：福州市湖东路 268 号 办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号 法定代表人：杨华辉 联系人：乔琳雪 联系电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：www.xyzq.com.cn
3	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2- 6 层 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际

		企业大厦 C 座 法定代表人：陈共炎 联系人：辛国政 联系电话：010-83574507 客服电话：4008-888-888 或 95551 网址：www.chinastock.com.cn
4	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号 法定代表人：杨德红 联系人：芮敏祺 电话：021-38676666 客服电话：4008888666 网址：www.gtja.com
5	中泰证券股份有限公司	注册地址：济南市市中区经七路 86 号 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 法定代表人：李玮 联系人：许曼华 电话：021-20315290 传真：021-20315137 客服电话：95538 网址：www.zts.com.cn
6	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：周杰 电话：021-23219000 传真：021-23219100 联系人：李笑鸣 客服电话：95553 网址：www.htsec.com
7	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号 法定代表人：王常青 联系人：刘畅 联系电话：010-65608231 客服电话：4008888108 网址：www.csc108.com
8	广发证券股份有限公司	注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 法定代表人：孙树明 联系人：黄岚 客服电话：95575 或致电各地营业网点

		网址：广发证券网 http://www.gf.com.cn
9	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 办公地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦 14、16、17 层 法定代表人：丁益 联系人：金夏 联系电话：0755-83516289 客服电话：0755-33680000 4006666888 网址：www.cgws.com
10	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人：张佑君 联系人：王一通 电话：010-60838888 传真：010-60833739 客服电话：95558 网址：www.cs.ecitic.com
11	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层 法定代表人：李梅 联系人：李玉婷 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com
12	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号 办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人：周健男 联系人：龚俊涛 联系电话：021-22169999 客服电话：95525 网址：www.ebscn.com
13	中国中投证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元 办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层 法定代表人：高涛 联系人：万玉琳 联系电话：0755-82026907

		传真 0755-82026539 客服电话：400-600-8008、95532 网址：www.china-invs.cn
14	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人：李琦 电话：0991-5801913 传真：0991-5801466 联系人：王怀春 客服电话：400-800-0562 网址：www.hysec.com
15	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn
16	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层 办公地址：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层 法定代表人：姜晓林 联系人：焦刚 联系电话：0531-89606166 客服电话：95548 网址：sd.citics.com
17	信达证券股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 法定代表人：张志刚 联系人：尹旭航 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：95321 网址：www.cindasc.com
18	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

		法定代表人：杨炯洋 联系人：谢国梅 联系电话：010-52723273 客服电话：95584 网址：www.hx168.com.cn
19	长江证券股份有限公司	注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦 法定代表人：李新华 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 客服电话：95579 或 4008-888-999 网址：www.95579.com
20	东北证券股份有限公司	注册地址：长春市生态大街6666号 办公地址：长春市生态大街6666号 法定代表人：李福春 联系人：安岩岩 联系电话：0431-85096517 客服电话：95360 网址：www.nesc.cn
21	国联证券股份有限公司	注册地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 办公地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 法定代表人：姚志勇 联系人：祁昊 联系电话：0510-82831662 客服电话：95570 网址：www.glsc.com.cn
22	东莞证券股份有限公司	注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 联系人：李荣 联系电话：0769-22115712 传真：0769-22115712 客服电话：95328 网址：www.dgzq.com.cn
23	渤海证券股份有限公司	注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址：天津市南开区滨水西道8号 法定代表人：王春峰 联系人：蔡霆 电话：022-28451991

		传真：022-28451892 客服电话：400-651-5988 网址：www.ewww.com.cn
24	平安证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号 荣超大厦 16-20 层 办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号 荣超大厦 16-20 层 法定代表人：何之江 联系人：王阳 联系电话：021-38637436 客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com
25	国都证券股份有限公司	注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号 国华投资大厦 9 层 10 层 办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号 国华投资大厦 9 层 10 层 联系人：黄静 电话：010-84183333 传真：010-84183311-3389 客服电话：400-818-8118 网址：www.guodu.com
26	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号 办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号 法定代表人：范力 联系人：陆晓 电话：0512-62938521 传真：0512-65588021 客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn
27	广州证券股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州 国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州 国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 法定代表人：胡伏云 联系人：梁微 联系电话：95396 客服电话：95396 网址：www.gzs.com.cn
28	华安证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅 湖路 198 号 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅 湖路 198 号财智中心 B1 座 法定代表人：章宏韬 联系人：范超

		联系电话：0551-65161821 客服电话：95318 网址：www.hazq.com
29	中原证券股份有限公司	注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 法定代表人：菅明军 联系人：程月艳 李盼盼 电话：0371-69099882 传真：0371-65585899 客服电话：95377 网址：www.ccnew.com
30	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼 办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼 法定代表人:徐丽峰 联系人:占文驰 联系电话:0791-86283372 客服电话：4008222111 网址:www.gsyzq.com
31	大同证券有限责任公司	注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人：董祥 联系人：薛津 电话：0351-4130322 传真：0351-4192803 客服电话：4007121212 网址：http://www.dtsbc.com.cn
32	新时代证券股份有限公司	注册地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法定代表人：叶顺德 联系人：田芳芳 联系电话：010-83561146 客服电话：95399 网址：www.xsdzq.cn
33	万联证券股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层 办公地址：广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 栋 12 层 法定代表人：张建军

		联系人:甘蕾 联系电话: 020-38286026 客服电话:400-8888-133 网址: www.wlzq.cn
34	恒泰证券股份有限公司	注册地址: 呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层 办公地址: 呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层 法定代表人: 庞介民 联系人: 熊丽 客服电话: 4001966188 网址: www.cnht.com.cn
35	中天证券股份有限公司	注册地址: 沈阳市和平区光荣街 23 甲 办公地址: 沈阳市和平区南五马路 121 号万丽城晶座 4 楼中天证券经纪事业部 法定代表人: 马功勋 联系人: 李泓灏 联系电话: 024-23280806 客服电话: 024-95346 网址: http://www.iztzq.com
36	大通证券股份有限公司	注册地址: 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层 办公地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层 法定代表人: 赵玺 联系人: 谢立军 电话: 0411-39991807 传真: 0411-39991833 客服电话: 4008-169-169 网址: www.daton.com.cn
37	东兴证券股份有限公司	注册地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层 办公地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层 法定代表人: 魏庆华 联系人: 夏锐 和志鹏 电话: 010-66559079/010-66559371 传真: 010-66555133 客服电话: 95309 网址: www.dxzq.net
38	联储证券有限责任公司	注册地址: 深圳市福田区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路

		333 号金砖大厦 8 楼 法定代表人：吕春卫 联系人：丁倩云 电话：010-86499427 传真：010-86499401 客服电话：400-620-6868 网址：www.lczq.com
39	川财证券有限责任公司	注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼 办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼 法定代表人：孟建军 联系人：匡婷 电话：028-86583053 传真：028-86583002 客服电话：95105118 网址：www.ccqz.com
40	中信期货有限公司	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：刘宏莹 电话：010-60833754 传真：0755-83217421 客服电话：400-990-8826 网址：http://www.citicsf.com
41	阳光人寿保险股份有限公司	注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层 办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层 法定代表人：李科 联系人：王磊 电话：010-59053660 传真：010-59053700 客服电话：95510 网址：http://fund.sinosig.com
42	深圳众禄基金销售股份有限公司	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 8 号

		HALO 广场 4 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、www.jjmmw.com
43	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
44	蚂蚁（杭州）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：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬 客服电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn
45	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：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座大楼（东方财富大厦） 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：021-54509977 传真：021-64385308 客服电话：95021 / 4001818188 网址：www.1234567.com.cn
46	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：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 同花顺大楼 4 层 法定代表人：凌顺平 联系人：吴强 电话：0571-88911818-8653

		传真：0571-86800423 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com
47	上海陆金所基金销售有限公司	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：胡学勤 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com
48	珠海盈米基金销售有限公司	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12楼1201-1203室 法定代表人：肖雯 联系人：邱湘湘 电话：020-89629099 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn
49	北京唐鼎耀华基金销售有限公司	注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室 法定代表人：张冠宇 联系人：王丽敏 电话：010-85932810 客服电话：400-819-9868 网址：https://www.tdyhfund.com
50	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人：钱燕飞 联系人：王锋 电话：025-66996699-887226 传真：025-66996699 客服电话：95177 网址：www.snjijin.com
51	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层

		法定代表人：江卉 联系人：徐伯宇 电话：010-89188356 传真：010-89189566 客服电话：95118 网址：jr.jd.com
52	和耕传承基金销售有限公司	注册地址：郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间 办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6F 法定代表人：李淑慧 联系人：胡静华 电话：0371-85518396 传真：0371-85518397 客服电话：4000-555-671 网址：http://www.hgccpb.com/
53	大连网金基金销售有限公司	注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 法定代表人：卜勇 客服电话：4000-899-100 网址：http://www.yibaijin.com/
54	腾安基金销售（深圳）有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼 法定代表人：刘明军 联系人：谭广锋 电话：0755-86013388 转 80618 传真：/ 客服电话：95017 网址：www.tenganxinxi.com
55	北京百度百盈基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101 办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦 法定代表人：张旭阳 客服电话：95055 网址：https://8.baidu.com/ 邮编：100085
56	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	

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：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

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

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

南方希元可转债债券型证券投资基金

§ 5 基金的类型

债券型证券投资基金

§ 6 基金的投资目标

本基金为债券型证券投资基金，债券投资部分以可转换债券为主要投资标的，在保持适当流动性、合理控制风险的基础上，合理配置债券等固定收益类金融工具和权益类资产，充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，力争实现基金资产的长期增值。

§ 7 基金的投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债、可交换债券等））、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）、同业存单、货币市场工具、权证、国债期货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。

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。

基金的投资组合比例为：本基金债券投资占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

§ 8 基金的投资策略

8.1 投资策略

1、资产配置策略

本基金管理人将以经济周期和宏观政策分析为前提，综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在债券、股票、现金等资产之间的配置比例、调

整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。

2、债券投资策略

（1）可转换债券投资策略

本基金投资于可转债，主要目标是发挥可转债“进可攻、退可守”的特性，一方面可转债具有债券的价值底线，能够降低基金净值的下行风险；另一方面，正股上涨会显著提升可转债的投资价值，为组合带来超额收益。

1) 择时策略

首先判断权益类市场的整体投资机会，其次采用南方基金可转债量化投资系统（包括隐含波动率/历史波动率、平价溢价率、底价溢价率、到期收益率等指标）确定可转债的估值水平，再结合可转债潜在供需关系、资金面状况等因素，判断可转债市场总体的风险和机会。当可转债市场投资机会较好时，适时提高可转债仓位，同时采取进攻性配置，提高偏股型转债的配置比例，增强组合的向上弹性；当可转债市场风险收益比较差时，适时降低可转债仓位，同时采取防御性配置，提高偏债型可转债的配置比例，降低组合的下行风险。

2) 择券策略

本基金将首先对可转债对应的标的股票进行深入研究，通过定性分析（所处行业趋势、公司行业地位和竞争优势、治理结构、成长性等）和定量分析（P/E、P/B、DCF、NAV、PEG 等）相结合的方式，选择基本面优质且估值合理的正股，再结合可转债的估值指标（包括隐含波动率/历史波动率、平价溢价率、Delta 系数、底价溢价率、到期收益率等指标），选择风险收益比较优的可转债进行重点投资。对于偏股型可转债，重点关注标的股票的成长性、估值水平以及可转债隐含波动率、平价溢价率、Delta 系数等估值指标；对于偏债型可转债，重点关注发行人的信用水平、底价溢价率、到期收益率与同期限同评级信用债的利差等指标。

3) 条款价值发现策略

可转换债券通常设置一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款和赎回条款等，这些条款在特定的环境下对可转换债券价值有较大影响。本基金将在深入研究各项条款对可转债价值影响历史规律的基础上，结合发行人的经营状况以及市场变化趋势，挖掘各项条款对应的可转债或标的股票的投资机会。

4) 交易策略

根据权益类市场所处阶段确定整体交易策略，牛市中注重趋势，持有期可以相对较长，熊市中注重安全边际，更加谨慎地选择入场时机，震荡市中注重波段操作，适时止盈。根据可转债发行规模和日均成交额确定个券交易策略，流动性好的大盘转债可以采用右侧交易策略，流动性较差的中小盘转债更适合左侧交易策略。

5) 行权策略

可转债具备按照约定的价格转换为标的股票的权利，本基金将综合分析正股的基本面和估值水平、可转债的转股溢价率水平、可转债和标的股票的流动性、可转债转股对标的股票稀释和抛售压力等因素，确定是否行使将可转债转换为标的股票的权利，以及转股的时机和转股后标的股票的持有时间。

（2）普通债券投资策略

1) 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。

2) 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。

3) 信用债投资策略

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，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。

3、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。

4、股票投资策略

本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向，努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，

在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值水平，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

6、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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。

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做出投资决策，是本基金维护投资人利益的重要保障。

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：固定收益部研究员以外部研究报告以及其他信息来源作为参考，对利率市场、信用市场进行研究，提出债券市场运行趋势的分析观点，在重点关注的投资产品范围内根据自己的研究选出有投资价值的各类债券向基金经理做出投资建议。研究员根据基金经理提出的要求对各类投资品种进行研究并提出投资建议。

（3）制定投资决策：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。

（4）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。

（5）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

本基金的业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率*60%+中债综合指数收益率*30%+沪深 300 指数收益率*10%。

中证可转换债券指数的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成，以反映国内市场可转换债券的总体表现。中债综合指数是由中央国债登记结算公司编制的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，样本债券涵盖范围广，具有广泛的市场代表性。沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，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。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以在与基金托管人协商一致的情况下，按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而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 12 月 31 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	4,735,504.50	9.86
	其中：股票	4,735,504.50	9.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,823,493.84	80.83
	其中：债券	38,823,493.84	80.83
	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	2,005,469.78	4.18
8	其他资产	2,467,630.90	5.14
9	合计	48,032,099.02	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	446,780.00	1.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,431,301.50	5.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	520,195.00	1.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	885,728.00	2.03
L	租赁和商务服务业	451,500.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,735,504.50	10.85

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	33,000	646,470.00	1.48
2	300559	佳发教育	15,100	520,195.00	1.19
3	601888	中国国旅	7,500	451,500.00	1.03
4	300760	迈瑞医疗	4,100	447,802.00	1.03
5	600612	老凤祥	9,800	441,000.00	1.01
6	000661	长春高新	2,500	437,500.00	1.00
7	300747	锐科激光	1,700	233,920.00	0.54
8	001979	招商蛇口	13,000	225,550.00	0.52
9	600276	恒瑞医药	4,258	224,609.50	0.51
10	002714	牧原股份	7,800	224,250.00	0.51

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,556,198.00	5.86

	其中：政策性金融债	2,556,198.00	5.86
4	企业债券	99,570.00	0.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	36,167,725.84	82.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,823,493.84	88.99

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	113018	常熟转债	46,810	5,110,247.70	11.71
2	123006	东财转债	42,000	4,871,580.00	11.17
3	128024	宁行转债	33,856	3,588,058.88	8.22
4	110032	三一转债	25,520	3,042,494.40	6.97
5	132009	17 中油 EB	29,090	2,931,981.10	6.72

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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。

1.11.2 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，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

1.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,576.93
2	应收证券清算款	2,307,981.65
3	应收股利	-
4	应收利息	131,949.80
5	应收申购款	11,122.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,467,630.90

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113018	常熟转债	5,110,247.70	11.71
2	123006	东财转债	4,871,580.00	11.17
3	128024	宁行转债	3,588,058.88	8.22
4	110032	三一转债	3,042,494.40	6.97
5	132009	17 中油 EB	2,931,981.10	6.72
6	110038	济川转债	2,176,276.00	4.99
7	113508	新凤转债	1,307,333.80	3.00
8	128019	久立转 2	1,092,691.74	2.50
9	128027	崇达转债	1,090,820.30	2.50
10	110034	九州转债	728,928.00	1.67
11	110040	生益转债	661,003.20	1.52
12	132013	17 宝武 EB	435,021.60	1.00
13	123009	星源转债	433,086.00	0.99

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资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应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 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
2018. 3. 14 — 2018. 12. 3 1	-13. 77%	0. 75%	-5. 21%	0. 44%	-8. 56%	0. 31%
自基金合 同生效至 今	-13. 77%	0. 75%	-5. 21%	0. 44%	-8. 56%	0. 31%

§ 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金相关账户的开户及维护费用；
- 9、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。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

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、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

13.2 与基金销售有关的费用

- 1、本基金的申购费率最高不高于0.8%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示

申购金额（M）	申购费率
M<100 万	0.80%
100 万≤M<200 万	0.50%
200 万≤M<500 万	0.30%
M≥500 万	每笔 1000 元

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

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。

- 2、本基金赎回费率最高不超过1.50%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示（其中1年指365天）：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<7 日	1.50%
7 日≤N<30 日	0.50%
30 日≤N<1 年	0.20%
N≥1 年	0.00%

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。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。对于持有期少于30日的基金份额所

收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日（含 30 日）但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月（含 3 个月）但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月（含 6 个月）的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

3、基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照有关规定在指定媒介上公告，调整后的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。

4、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、登记结算等各项费用。

5、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。

6、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“基金管理人概况”进行了更新，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“登记机构”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，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。

南方基金管理股份有限公司
2019 年 04 月 16 日