

南方多利增强债券型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配等事项，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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期未发生影响投资者决策的重大事项。

§ 2 基金产品概况

基金简称：南方多利增强债券

交易代码：202102

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年9月30日

报告期末基金份额总额：2,334,321,287.61份

本基金属于债券型基金，投资目标是能够在持有稳定收益的基础上，通过积极的市场操作和积极的投资获取较高的资本增值。

投资运作上，南方多利增强基金三季度持仓仍以信用债为主，同时配有一定的利率债和可转债仓位进行波段操作。我们在三季度大幅增加了利率债的久期和仓位，从而在报告期内的利率债投资上获得较好的资本利得。可转债投资上，三季度我们整体风格偏好仍然不高，保持着相对中性的可转债仓位波段操作。

4.4.2 报告期内债券市场的整体表现：三季度信用债收益率中枢为2.01%，同期业绩比较基准增长率为1.31%；南方多利增强C级基金净值增长率为1.93%，同期业绩比较基准增长率为1.31%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产构成情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 9,962,000.00 0.27

2 固定收益投资 9,326,617,266.32 96.20

其中：债券 3,315,617,266.32 94.91

货币支持证券 10,000,000.00 0.29

3 货币投资 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他资产 - -

6 衍生工具及备付金合计 69,983,764.67 2.00

7 其他资产 89,202,337.64 2.52

8 合计 3,403,366,397.52 100.00

5.2 报告期末行业分类的股票投资组合

序号 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 - -

B 矿业 - -

C 制造业 47,159,030.36 1.69

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 25,978,409.00 0.93

E 建筑业 11,466,000.00 0.41

F 批发和零售业 19,703,061.00 0.71

G 交通运输、仓储和邮政业 3,212,756.00 0.12

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 14,654,630.00 0.52

J 金融业 8,525,250.00 0.31

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

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 文化、体育和娱乐业 - -

R 医疗卫生和社会工作 - -

S 综合 - -

5.3 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 000027 中国银行 900,000 10,940,000.00 0.57

2 600097 中国平安 650,000 15,069,261.00 0.64

3 000643 中国建筑 1,200,000 14,760,000.00 0.63

4 600068 中国太保 800,000 11,656,730.00 0.42

5 600098 中国神华 1,600,000 11,496,000.00 0.41

6 601098 中国中车 460,000 9,793,000.00 0.36

7 000625 中国国航 460,000 6,643,476.00 0.24

8 600048 中国人寿 750,000 5,992,500.00 0.21

9 600780 中国石油 700,000 4,690,030.00 0.17

10 600894 中国远洋 260,000 3,942,500.00 0.14

5.4 报告期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 75,626,132.00 2.81

2 央行票据 - -

3 金融债券 896,646,000.00 33.39

其中：政策性金融债 896,646,000.00 33.39

4 企业债券 1,462,302,196.00 54.34

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 729,817,000.00 27.08

7 司转换 98,092,583.32 3.64

8 同业存单 - -

9 其他 52,125,444.00 1.94

10 合计 3,119,617,266.32 123.20

5.5 报告期未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 150208 15国债10 2,500,000 256,526,000.00 0.94

2 150210 15国债10 2,000,000 208,000,000.00 7.73

3 150211 15国债10 1,400,000 140,910,000.00 5.24

4 101062006 15农发01 700,000 73,717,000.00 2.74

5 10000078 16农发01 700,000 73,206,000.00 2.72

5.6 报告期未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

序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110109 徐盛01 50,000 5,000,000.00 0.19

2 110113 徐新03 50,000 5,000,000.00 0.19

5.7 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 110008 电气转债 64,099,370.00 2.01

2 128009 齐峰转债 43,993,203.22 1.43

5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况的说明

§ 6 开放式基金份额变动

报告期未发生申购赎回情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金本报告期未持有固有资金投资。

§ 8 备查文件目录

1、南方多利增强债券型证券投资基金招募说明书

2、南方多利增强债券型证券投资基金托管协议

3、南方多利增强债券型证券投资基金2015年第3季度报告原文。

4、南方多利增强债券型证券投资基金2015年第3季度报告摘要。

5、基金管理人关于开放式基金公平交易制度的专项说明

6、基金管理人关于异常交易行为的专项说明

7、基金管理人关于基金投资偏离度的说明

8、基金管理人关于旗下所有开放式基金的定期报告。

9、基金管理人关于指数型基金接受大额申购、赎回的公告。

10、基金管理人关于指数型基金接受巨额赎回的公告。

11、基金管理人关于实施港股通交易的公告。

12、基金管理人关于实施沪港通交易的公告。

13、基金管理人关于实施深港通交易的公告。

14、基金管理人关于实施沪伦通交易的公告。

15、基金管理人关于实施QDII交易的公告。

16、基金管理人关于实施QFII交易的公告。

17、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

18、基金管理人关于实施沪港通港股通交易的公告。

19、基金管理人关于实施沪伦通港股通交易的公告。

20、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

21、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

22、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

23、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

24、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

25、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

26、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

27、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

28、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

29、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

30、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

31、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

32、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

33、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

34、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

35、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

36、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

37、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

38、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

39、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

40、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

41、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

42、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

43、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

44、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

45、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

46、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

47、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

48、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

49、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

50、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

51、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

52、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

53、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

54、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

55、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

56、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。

57、基金管理人关于实施QDII-QDII交易的公告。