

## 南方润元纯债债券型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2016年1月21日

## § 1 重要提示

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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2016年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等文字内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:南方润元纯债债券

基金主代码:202108

交易代码:202108

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年9月30日

报告期末基金份额总额:0.211,370,320份

投资目标:本基金严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的回报。

投资策略:本基金将密切关注宏观经济、政策面、市场面的变化，充分考虑流动性、基本面、资金面、利率水等方面，精选债券类资产的预期收益率水平，合理配置资产，以达到最佳的投资效果。

1.资产配置策略

本基金将密切关注宏观经济、政策面、市场面的变化，充分考虑流动性、基本面、资金面、利率水等方面，合理配置资产，以达到最佳的投资效果。

2.债券投资策略

首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券的久期。其次根据宏观经济、政策面、市场面的变化，充分考虑流动性、基本面、资金面、利率水等方面，合理配置资产，以达到最佳的投资效果。

3.股票投资策略

本基金将密切关注宏观经济、政策面、市场面的变化，充分考虑流动性、基本面、资金面、利率水等方面，合理配置资产，以达到最佳的投资效果。

4.债券回购策略

本基金将密切关注宏观经济、政策面、市场面的变化，充分考虑流动性、基本面、资金面、利率水等方面，合理配置资产，以达到最佳的投资效果。

5.资产支持证券投资策略

本基金将密切关注宏观经济、政策面、市场面的变化，充分考虑流动性、基本面、资金面、利率水等方面，合理配置资产，以达到最佳的投资效果。

6.报告期内基金持有人数或基金净资产值暨报告说明

无。

## § 5 投资组合报告

## 5.1 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 4,317,197,360.00 98.29

其中:债券 4,317,197,360.00 98.29

货币市场基金 - -

3 货币市场投资 - -

4 货币类金融资产 - -

5 其他金融类资产 - -

其中:买入返售金融资产

户 - -

6 银行存款和结算备付金合计 8,386,587.05 0.19

7 其他资产 66,590,678.48 1.52

合计 4,302,163,630.33 100.00

5.2 报告期末行业分类的股票投资组合

注:本基金未按行业分类进行股票投资。

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

南方润元纯债债券/A/B 南方润元纯债债券C

下属分级基金的交易代码 202108 202110

下属分级基金的最新份额 202108 -

下属分级基金的最近交易日 202108 -

下属分级基金的总份额(份) 373,866,16份

份额(份) 2,143,046,463.40份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合,可简称为“南方润元”。

§ 3 主要财务指标

注:本报告期实现收益扣减基金本期利润收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金额度表现

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方润元纯债债券/A/B

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.20% 0.11% 2.76% 0.07% 0.07% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/A/B

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 0.20% 0.11% 2.76% 0.07% 0.07% 0.04%

3.2.3 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/A/B

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 0.20% 0.11% 2.76% 0.07% 0.07% 0.04%

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 0.20% 0.11% 2.76% 0.07% 0.07% 0.04%

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.6 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.7 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.8 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.9 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.10 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.11 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.12 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.13 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.14 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.15 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.16 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一年 2.96% 0.11% 2.76% 0.07% 0.21% 0.04%

3.2.17 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方润元纯债债券/C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较