

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、董事会、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的法律责任。
基金托管人、交通银行股份有限公司保证本报告已经公告之前,一并以上报、独立董事签字同意,并由其盖章。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期内基金于2016年1月10日(基金合同生效日)至2016年1月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

南方双元债券南方双元债券

基金代码 000097

类别 债券型开放式

基金合同生效日 2016年2月10日

基金管理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

报告期末基金资产净值 412,872,152.51份

基金份额净值 1.00

本报告期末基金资产净值 382,465,157.07份 30,626,836.74份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示的其他信息披露场合下,可简称为“南方双元”。

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金严格控制风险的基础上,力求实现资产的比较基准的回报。

投资策略 本基金将密切关注宏观经济、政策、市场、资金面等多方面的变化,深入分析和判断利率的预期与市场资金面的变化,把握利率变化趋势,通过利率、期限、资产类别等品种的配置,上半部分侧重于利率债,下半部分侧重于信用债,力争在控制风险的前提下,实现收益。

业绩比较基准 本报告期南方双元债券基金净值增长率为6.02%,同期业绩比较基准增长率为7.41%;南方双元债券基金净值增长率为6.02%,同期业绩比较基准增长率为7.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

2016年中国经济面临弱复苏,全年GDP增速跌破7.0%,工业增长减速增慢,下行压力,有一定通缩压力。货币政策将宽松,全年有四次降息,五次降准,存款贷款基准利率均历史新低。

债券方面,在宏观经济、政策、资金面、利率、货币政策、信用债品种和信用评级、上半部分侧重于利率债,下半部分侧重于信用债,力争在控制风险的前提下,实现收益。

4.6 基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本报告期南方双元债券基金净值增长率为6.02%,同期业绩比较基准增长率为7.41%。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

2016年中国经济面临弱复苏,全年有四次降息,五次降准,存款贷款基准利率均历史新低。

债券方面,在宏观经济、政策、资金面、利率、货币政策、信用债品种和信用评级、上半部分侧重于利率债,下半部分侧重于信用债,力争在控制风险的前提下,实现收益。

4.8 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

2016年中国经济面临弱复苏,全年有四次降息,五次降准,存款贷款基准利率均历史新低。

债券方面,在宏观经济、政策、资金面、利率、货币政策、信用债品种和信用评级、上半部分侧重于利率债,下半部分侧重于信用债,力争在控制风险的前提下,实现收益。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人回报情况的说明

无。

5.1 报告期内基金利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

5.2 基金合同生效日

本基金合同生效日为2016年2月10日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

5.3 基金合同终止日

本基金合同终止日为2016年2月10日。

5.4 基金合同的变更情况

本基金合同的变更情况为无。

5.5 基金合同生效日与同期业绩比较基准收益率的比较

南方双元债券南方双元债券

南方双元债券南方双元债券