

南方润元纯债债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月18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、准确性和完整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规定，于2015年7月15日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保留在复核后不存在虚假记载、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。

本报告所含财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 南方润元纯债债券

基金代码 202108

交易代码 202108

运作方式 封闭式

基金合同生效日 2012年7月20日

报告期末基金份额总额 421,441,657.27份

基金管理费 0.20%/年

基金托管费 0.05%/年

报告期利息收入 162,606,558.11元

报告期股息红利收入 258,835,099.16元

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下,可简称为“南方润元”。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

基金简称 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

南方润元纯债债券 A/B 南方润元纯债债券 C

1.本期已实现收益 2,169,322.36

2,773,614.12

2.本期利润 4,521,707.69

6,210,734.98

3.期末基金价值比例 0.0244

0.0227

4.期末基金份额净值 182,353,556.84

286,980,789.87

5.期末基金份额净值 1.121

1.109

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额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① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ③ ①-③ ②-④

过去三个月 2.56% 0.09% 2.21% 0.09% 0.35% -0.03%

南方润元纯债债券C

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

过去三个月 2.50% 0.07% 2.21% 0.09% 0.29% -0.02%

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① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ③ ①-③ ②-④

过去三个月 2.56% 0.09% 2.21% 0.09% 0.35% -0.03%

南方润元纯债债券C

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

过去三个月 2.50% 0.07% 2.21% 0.09% 0.29% -0.02%

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期;对其他的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会公告和《南方润元纯债债券型证券投资基金合同》的规定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下力求取得良好的投资回报。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价均无因反向交易较少的当笔成交量的5%的交易次数为4次,其中3次是由指数型基金根据标的指数成份股构成被动调整所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

孟飞 基金经理 2015年1月13日 - 7年

金融学硕士毕业,具有基金从业资格,曾担任第一创业证券有限公司债券分析师、交易经理,国泰君安证券经理,2013年1月加入南方基金管理有限公司,任基金经理助理,2014年7月至今,任南方润元纯债债券基金经理,2014年7月至今,任南方润元纯债债券基金经理,2014年9月至今,任南方安心基金经理,2015年1月至今,任南方润元纯债基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期;对其他的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会公告和《南方润元纯债债券型证券投资基金合同》的规定,本着诚信守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下力求取得良好的投资回报。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价均无因反向交易较少的当笔成交量的5%的交易次数为4次,其中3次是由指数型基金根据标的指数成份股构成被动调整所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现

单位:人民币元

基金简称 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

南方润元纯债债券A/B

1.本期已实现收益 31,569,724.36

2.本期利润 43,175,276.25

3.期末平均基金份额净值 330,859,490.73

4.期末基金份额净值 320,453.11

5.期末资产净值 320,453.11

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.5 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

无。

4.6 报告期内基金组合类情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 521,200,105.07 96.54

其中:股票 521,200,105.07 96.54

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

货币市场基金 - -

3 贵金属投资 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 买入返售金融资产 - -

6 银行存款和结算备付金合计 18,547,229.84 3.44

7 其他资产 124,684.00 0.02

8 合计 539,872,519.81 100.00

注:上表中的股票投资组合可遇替代款估值增值,而B类的合计项中不含可遇替代款估值增值。

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 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 2,681,024.00 0.50

B 矿业 21,873,827.85 4.07

C 制造业 27,806,765.08 51.14

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 37,093,898.88 6.90

E 建筑业 20,787,549.33 3.87

F 批发、零售业 55,813,699.98 10.38

G 交通运输、仓储和邮政业 48,796,933.73 9.08

H 住宿和餐饮业 966,993.80 0.18

I 信息传输、软件和信息技术服务业 17,163,328.66 3.19

J 金融业 - -

K 地产房 15,903,975.95 2.96

L 租赁和商务服务业 3,649,635.04 0.68

M 科学研究和技术服务业 1,559,102.00 0.29

N 水利、环境和公共设施管理业 1,786,636.12 0.33

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 6,209,760.19 1.16

S 保险业 11,209,736.65 2.09

注:上表中的股票投资组合可遇替代款估值增值,而B类的合计项中不含可遇替代款估值增值。

5.2 报告期内行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 矿业 21,873,827.85 4.07

C 制造业 27,806,765.08 51.14

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 37,093,898.88 6.90

E 建筑业 20,787,549.33 3.87

F 批发、零售业 55,813,699.98 10.38

G 交通运输、仓储和邮政业 48,796,933.73 9.08

H 住宿和餐饮业 966,993.80 0.18

I 信息传输、软件和信息技术服务业 17,163,328.66 3.19

J 金融业 - -

K 地产房 15,903,975.95 2.96

L 租赁和商务服务业 3,649,635.04 0.68

M 科学研究和技术服务业 1,559,102.00 0.29

N 水利、环境和公共设施管理业 1,786,636.12 0.33

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