

南方润元纯债债券型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

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
送出日期:2015年3月26日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月20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。投资者有风险,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,应阅读年度报告正文。
本报告自2014年01月01日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:南方润元纯债债券
基金代码:021018
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2012年7月27日
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

2.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%
投资策略:本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资范围:本基金投资于国内依法发行和上市交易的债券,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转债等。
投资策略:本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.3 基金管理人及基金托管人
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
基金管理人地址:深圳市福田区福田街道福安社区深业中城大厦A座18楼
基金托管人地址:广东省广州市天河区珠江新城华夏路10号

2.4 信息披露方式
基金年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人的办公地点
基金年度报告备置网址:www.nffund.com

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元
3.2 基金净值表现
3.3 基金利润分配情况

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 1. 本期基金份额净值增长率, 2. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度, 3. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度.

3.4 基金管理人及基金托管人
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

3.5 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.6 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.7 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.8 基金管理人及基金托管人
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

3.9 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.10 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.11 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.12 基金管理人及基金托管人
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

3.13 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.14 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.15 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.16 基金管理人及基金托管人
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

3.17 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.18 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.19 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.20 基金管理人及基金托管人
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

3.21 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.22 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.23 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.24 基金管理人及基金托管人
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

3.25 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.26 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.27 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.28 基金管理人及基金托管人
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

3.29 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.30 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.31 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.32 基金管理人及基金托管人
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

3.33 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.34 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

3.35 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

3.36 基金管理人及基金托管人
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

3.37 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日
199,260,061.81份,份额净值1.076元;C类基金份额的份额总额为109,670,142.71份,份额净值1.067元。
2.2 利润表
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, 四、净利润.

2.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、所有者权益(基金净值)合计, 二、所有者权益(基金净值)变动.

2.4 利润分配情况
单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、可供分配利润, 二、应付利润.

2.5 基金管理人及基金托管人
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

2.6 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.7 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.8 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.9 基金管理人及基金托管人
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

2.10 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.11 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.12 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.13 基金管理人及基金托管人
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

2.14 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.15 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.16 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.17 基金管理人及基金托管人
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

2.18 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.19 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.20 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.21 基金管理人及基金托管人
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

2.22 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.23 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.24 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.25 基金管理人及基金托管人
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

2.26 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.27 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.28 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.29 基金管理人及基金托管人
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

2.30 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.31 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.32 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.33 基金管理人及基金托管人
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

2.34 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.35 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.36 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.37 基金管理人及基金托管人
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

2.38 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

2.39 投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

2.40 业绩比较基准
本基金业绩比较基准:1年期定期存款利率(税后)+1.00%

金额单位:人民币元
2014年1月1日至2014年12月31日

Table with 4 columns: 关联方名称, 证券代码, 证券名称, 发行方式. Rows include 兴业证券, 兴业转债, 华泰联合证券.

7.4.7 其他关联交易事项的说明
注:无。
7.4.5 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券于期末持有的流通受限证券
注:无。
7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
注:无。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额46,029,490.95元,是以如下债券作为抵押:

Table with 5 columns: 债券代码, 债券名称, 回购到期日, 期末应收价款, 期末余额. Rows include 128241, 118016, 04140202, 1505015, 华银转债.

7.4.5.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额10,000,000.00元,于2015年1月5日到期。该交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易余额的余额。

8.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额. Rows include 1 权益投资, 2 其中:股票, 3 固定收益投资.

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
8.3 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
注:本基金本报告期末未持有股票。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
注:无。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值. Rows include 1 国债投资, 2 央行票据, 3 中期票据.

8.6 期末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
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值. Rows include 1 122212, 2 122317, 3 112128.

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
8.8 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
8.10 报告期末本基金投资组合的行业配置情况
注:本基金本报告期末未持有股票。
8.11 投资组合报告附注
8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。
8.11.2 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。
8.11.3 期末其他投资明细
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存债利息, 2 应收申购款, 3 应收股利.

9.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额. Rows include 南方润元纯债债券A/B, 南方润元纯债债券C.

注:分级基金管理人/个人投资者持有基金份额占基金份额总额的计算中,对于分级基金,比例的分子采用各自级别的份额,分母为各自的母基金份额;对于非分级基金,比例的分子采用各自的基金份额,分母为基金资产净值。
9.2 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 份额, 占比. Rows include 基金资产净值, 本期新增基金份额, 本期赎回基金份额.

11.1 基金份额持有人大会决议
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
11.3 基金托管人基金托管部门专门基金托管部门的负责人及基金经理的变动
11.4 基金投资策略的改变
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票及债券交易情况
11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 券商名称, 债券交易, 占当期债券交易的比例, 成交金额, 占当期债券交易的比例.

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司对于租用证券公司交易单元的选择标准有如下:
A:选择标准
a.公司经营状况良好,财务状况和经营业绩良好;
b.公司具有较雄厚的研究力量,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
c.公司内部管理规范,能满足基金托管人的要求;
d.建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。
B:选择流程
公司研究部定期对券商服务质量从以下方面进行量化评价,并根据评价的结果选择交易单元;
a.服务的主观性,主要针对对证券公司客服调研的态度、协助安排上市公司调研,以及有关专题提供研究报告的情况;
b.研究报告的及时性,主要是指证券公司所提供的研究报告是否详实,投资建议是否准确;
c.资讯提供的及时性,主要是指证券公司提供资讯的及时性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利,提供的资讯是否充足全面。

注:本基金合同生效当年按实际存续期间计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
单位:人民币元

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额总额308,930,204.20份,其中A/B类基金份额的总额...

注:本基金本报告期末未持有股票。
8.3 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
注:本基金本报告期末未持有股票。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
注:无。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元