

南方宝元债券型基金2012年第2季度报告

[2012] 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年7月18日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2012年7月13日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，保证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。

本报告期财务资料未经审计。本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

\$ 2 基金产品概况

基金简称 南方宝元债券

交易代码 202101

基金运作方式 契约型封闭式

基金合同生效日 2002年9月20日

报告期末基金份额总额 1,153,116,290.71份

投资目标 本基金为开放式债券型基金，以债券投资为主，股票投资为辅，在保持投资组合的风险和充分流动性的前提下，通过资产配置和风险管理，追求资本增值。

风险收益特征 本基金属于中低风险品种，其风险收益水平低于股票型基金。

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

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“南方宝元”。

\$ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日 - 2012年6月30日)

1.本期已实现收益 13,396,985.46

2.本期利润 69,699,961.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0599

4.期末基金份额净值 1,378,126,148.70

5.期末基金份额净值 1.1951

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2.上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 5.24% 0.35% 1.49% 0.24% 3.75% 0.11%

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

基金净值累计增长率与同期业绩比较基准收益率变动图

基金净值累计增长率与同期业绩比较基准收益率变动图