

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  
送出日期:2013年3月9日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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、完整性、及时性承担个别及连带法律责任。本年度报告已全部在二份以上之二份上独立董事签字同意，并报中国证监会备案。

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2013年3月20日复核了本报表中的财务数据、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报表报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称	南方恒元保本混合
基金代码	202211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年1月12日
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
报告期末基金份额总额	3,303,699,919.39份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,为投资者提供认购保本基金的保本增值的保证,并在本基金上力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略分为两个层次,一层为对风险资产的配置,该层次以绝对比例组合保险策略为依据,即风险资产部分所获得的收益最大不能超过无风险资产部分所产生收益的收益;另一层为对风险资产部分的配置策略,基金管理人将根据情况对这两方面的策略进行调整。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征	本基金为保本基金,属于证券投资基金中的低风险品种
--------	--------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人	基金管理人:南方基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司
-----------------	--

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
----	------------	--------------

信息披露负责	鮑文革	赵会军
--------	-----	-----

联系电话	0755-82763888	010-66105799
------	---------------	--------------

电子邮箱	manager@southfund.com	custody@icbc.com.cn
------	-----------------------	---------------------

客户服务电话	400-888-8899	95588
--------	--------------	-------

传真	0755-82763889	010-66105798
----	---------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.southfund.com
---------------------	--------------------------

基金年度报告置地地点	基金管理人、基金托管人的办公地址
------------	------------------

## § 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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年度	2011年度	2010年度
本期已实现收益	106,550,161.72	98,364,532.41	345,582,166.99
本期利润	105,941,574.01	-164,459,649.17	326,699,645.44
加权平均基金份额本期利润	0.0292	-0.0823	0.1314
本期基金份额净值增长率	2.80%	-7.97%	12.28%

3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
本期可供分配基金份额利润	0.0304	0.0026	0.1666
期末基金份额净值	3,396,909,136.00	3,905,316,911.59	2,542,953,859.69
期末基金份额净值	1.028	1.000	1.025

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);2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

## 3.2.1 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

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.4 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.6 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.8 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.9 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.10 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.11 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.12 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.13 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.14 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.15 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:基金在建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的净值增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日,如保本期到期日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一工作日。

3.2.16 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较