

信息披露 Disclosure

南方宝元债券型基金

【2015】年度报告摘要

交金额(成交净价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 卖出资金金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000643	中航电子	152,241,897.18	10.49
2	601166	兴业银行	124,462,028.97	8.67
3	600894	广日股份	67,491,748.19	4.62
4	600036	招商局	66,002,948.91	4.52
5	600273	中远发展	53,174,116.87	3.70
6	600000	浦发银行	53,174,272.12	3.66
7	002009	招商科技	51,753,660.90	3.56
8	000565	德明电子	50,101,746.86	3.46
9	601088	中信传媒	49,136,374.49	3.39
10	600030	中信证券	45,547,977.14	3.14
11	600780	通宝能源	45,476,358.09	3.13
12	000061	平安银行	44,627,172.16	3.09
13	000058	广晟铜业	41,612,286.55	2.87
14	600627	南玻集团	36,507,283.11	2.43
15	000030	浦发银行	35,165,582.22	2.42
16	000050	宝钢钨业	34,074,420.27	2.36
17	000068	华工科技	33,547,767.20	2.31
18	600060	广发证券	32,585,587.06	2.27
19	000568	莱茵体育	32,787,022.91	2.26
20	600466	蓝光实业	32,549,794.76	2.24
21	600068	宝钢钨业	32,206,716.86	2.22
22	601088	中信传媒	344,294,099.10	2.19
23	002701	盛运金矿	29,482,176.28	2.13
24	600050	浦发银行	29,469,413.09	2.06
25	000063	云铝股份	29,468,324.65	2.03
26	600318	光大银行	29,363,314.04	2.02
27	000815	“ST美利”	29,230,721.77	2.01
28	000039	中航集团	29,090,027.65	2.00
29	300136	信维通信	29,081,381.16	2.00

注:卖出包括二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交净价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元	买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
	4,363,763,696.85	4,344,732,399.01

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交净价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按投资组合品种的公允价值列示的基金投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	194,560,386.60	9.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	344,294,099.10	15.08
4	央行票据/金融债券	344,294,099.10	15.08
4	企业债券	670,319,822.60	31.12
5	央行票据/金融债券	-	-
6	中期票据	171,497,000.00	7.89
7	可转债(含可转债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	合计	1,280,651,308.30	59.65

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1101060	11国债06	1,734,030	171,780,086.60	7.98
2	1300225	13国债爱建	1,000,000	100,200,000.00	6.07
3	010001	上交所国债1301	709,910	70,896,000.00	3.30
4	1100007	11国债07	600,000	66,438,000.00	3.08
5	080201	08国债01	600,000	52,096,000.00	2.46

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。
8.9 报告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。
8.10 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。
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未投资股指期货。
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
8.12.1 投资组合报告附注
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、处罚的情况。
8.12.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。
8.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	844,867.85
2	应收证券清算款	69,230,846.64
3	应收股利	-
4	应收利息	26,736,027.46
5	应收申购款	87,436,623.65
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	175,249,464.50

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
8.12.5 期末前十名股票中存在流受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在受限情况。

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	名称	金额
1	存出保证金	844,867.85
2	应收证券清算款	69,230,846.64
3	应收股利	-
4	应收利息	26,736,027.46
5	应收申购款	87,436,623.65
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	175,249,464.50

序号	名称	金额
1	存出保证金	844,867.85
2	应收证券清算款	69,230,846.64
3	应收股利	-
4	应收利息	26,736,027.46
5	应收申购款	87,436,623.65
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	175,249,464.50

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本	430,753.13	0.0385%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金基金份额总量的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金经理和专户投资负责人	0
持有本基金基金份额	0
本基金基金投资持有本开放式基金	10-40

5.10 开放式基金金额变动

单位:份	基金合同生效日期:2002年09月20日	基金资产总额	基金资产净值
本报告期初基金资产总额		4,902,694,980.80	4,902,694,980.80
本报告期初基金资产净值		4,902,694,980.80	4,902,694,980.80
本报告期间基金资产总额变动		1,675,494,984.01	1,675,494,984.01
减:本报告期间基金资产净值变动		1,512,101,899.60	1,512,101,899.60
本报告期间基金资产净值变动		-	-
本报告期间期末基金资产净值		1,116,791,158.66	1,116,791,158.66

11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 基金份额持有人、基金托管人的专门基金托管人/的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人、基金销售机构等十次召开工作会议,并由中国证监会、基金管理人于2015年6月20日召开工作会议,聘任汪文、李海峰为公司副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

报告期内,无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的重大变化

11.5 为基金资产审计的会计师事务所情况

报告期内会计师事务所为南方宝元证券投资基金提供审计服务,本年度支付给普华永道中天会计师事务所的审计费用为人民币20,000元。该会计师事务所提供审计服务的连续年限为14年。

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

报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交金额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	备注
国信证券	1	1,669,081,426.46	19.27%	1,471,182.06	18.91%	-
银河证券	2	1,564,246,300.65	18.17%	1,404,700.64	18.05%	-
万联证券	1	1,485,797,167.17	17.28%	1,368,318.69	17.46%	-
信达证券	1	718,828,027.29	8.35%	659,562.09	8.48%	-
广发证券	2	686,300,313.38	7.98%	622,103.68	7.69%	-
上海证券	1	674,595,727.44	7.94%	600,229.55	7.52%	-
华安证券	1	478,808,322.49	5.56%	435,871.70	5.60%	-
中信建投	2	409,036,412.39	4.75%	370,522.15	4.74%	-
招商证券	2	109,028,628.09	1.27%	96,479.47	1.24%	-
华泰证券	3	46,436,403.68	0.54%	41,091.22	0.52%	-
招商证券	1	44,122,423.31	0.51%	40,169.78	0.52%	-
申银万国	2	14,172,507.12	0.16%	12,541.69	0.16%	-
西部证券	1	12,108,877.80	0.14%	10,984.50	0.14%	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期增加租用华泰证券交易单元1个。

交易单元的选择标准和程序

专用交易单元的选择标准和程序: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,我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(a) 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较雄厚的研究能力,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) 公司能为基金提供及时、准确、全面的信息,并能及时提供准确的信息服务;

(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. 选择程序

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

(a) 服务的主观性,主要指证券公司调研调研的态度、调研安排上市公司调研,以及就有关专题提供研究报告的质量和;

(b) 研究的质量,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) 研究报告的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利;提供的资讯是否合法合规;

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

券商名称	成交金额	占当期股票成交金额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	备注
国信证券	300,588.79	0.03%	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-
万联证券	347,425,021.44	38.20%	0.0000	32.33%	-
信达证券	246,124,799.34	26.53%	0.0000	37.79%	-
财达证券	266,505,420.00	29.26%	685,000.0000	17.87%	-
广发证券	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-
华安证券	33,794,102.00	3.71%	256,000.0000	6.41%	-
中信建投	-	-	-	-	-
国君证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-
西部证券	28,300,514.84	3.17%	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期增加租用华泰证券交易单元1个。

交易单元的选择标准和程序

专用交易单元的选择标准和程序: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,我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(a) 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较雄厚的研究能力,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) 公司能为基金提供及时、准确、全面的信息,并能及时提供准确的信息服务;

(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. 选择程序

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

(a) 服务的主观性,主要指证券公司调研调研的态度、调研安排上市公司调研,以及就有关专题提供研究报告的质量和;

(b) 研究的质量,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) 研究报告的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利;提供的资讯是否合法合规;

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

券商名称 成交金额 占当期股票成交金额的比例 佣金 占当期佣金总额的比例 备注

国信证券 300,588.79 0.03% - - -

招商证券 - - - - -

万联证券 347,425,021.44 38.20% 0.0000 32.33% -

信达证券 246,124,799.34 26.53% 0.0000 37.79% -

财达证券 266,505,420.00 29.26% 685,000.0000 17.87% -

广发证券 - - - - -

上海证券 - - - - -

华安证券 33,794,102.00 3.71% 256,000.0000 6.41% -

中信建投 - - - - -

国君证券 - - - - -

华泰证券 - - - - -

招商证券 - - - - -

申银万国 - - - - -

西部证券 28,300,514.84 3.17% - - -

齐鲁证券 - - - - -

注:本基金本报告期增加租用华泰证券交易单元1个。

交易单元的选择标准和程序

专用交易单元的选择标准和程序: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,我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(a) 选择标准

(a) 公司经营行为规范,财务状况及经营状况良好;

(b) 公司具有较雄厚的研究能力,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) 公司能为基金提供及时、准确、全面的信息,并能及时提供准确的信息服务;

(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. 选择程序

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

(a) 服务的主观性,主要指证券公司调研调研的态度、调研安排上市公司调研,以及就有关专题提供研究报告的质量和;

(b) 研究的质量,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) 研究报告的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利;提供的资讯是否合法合规;

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

券商名称 成交金额 占当期股票成交金额的比例 佣金 占当期佣金总额的比例 备注

国信证券 300,588.79 0.03% - - -

招商证券 - - - - -

万联证券 347,425,021.44 38.20% 0.0000 32.33% -

信达证券 246,124,799.34 26.53% 0.0000 37.79% -

财达证券 266,505,420.00 29.26% 685,000.0000 17.87% -

广发证券 - - - - -

上海证券 - - - - -

华安证券 33,794,102.00 3.71% 256,000.0000 6.41% -

中信建投 - - - - -

国君证券 - - - - -

华泰证券 - - - - -

招商证券 - - - - -

申银万国 - - - - -

西部证券 28,300,514.84 3.17% - - -