

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
送上市日期:2016年3月30日

\$ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人、董事会、监事会对本基金的披露法律义务不在于虚假陈述、误导性陈述或重大遗漏，并将其内容的完整性、准确性完全承认为个别及连带的责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

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2016年3月25日核对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，保证复核的内容不存在虚假记载、误导性陈述。

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。

本报告期内本基金于2015年1月1日起至2015年3月30日止。

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，应阅读年度报告全文。

2.2 基金简介

基金名称 南方宝元债券型基金

基金代码 202101

基金运作方式 短期开放式

基金合同每份效用日 2002年9月10日

基金合同的终止 日常型

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

报告期末基金的净值总额 1,118,791,156,000

基金份额净值 1.0000

基金业协会评估等级 大型基金

基金管理人对本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场合下，可简称为“南方宝元”。

2.2 基金产品说明

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，在保持较低组合风险和充分流动性的情况下，确保基金安全及力求资产长期稳定增值。

4.3 报告期间管理人对本基金持有人数或基金资产净值预估情形的说明

5.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况说明

本基金报告期内，本基金托管人在对南方宝元债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及《基金托管业务规则》，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人的职责。

5.2 托管人报告期间内基金投资运作情况、利得和亏损情况的说明

本基金报告期内，南方宝元债券型证券投资基金的管理人公司在南方宝元债券型证券投资基金管理暂行办法、基金资产估值计算、基金申购赎回价格计算、基金费用计提方面上不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在所有重要的方面均按照行业的规范操作并遵循基金合同的规定。本报告期内，南方宝元债券型证券投资基金对基金持有人进行了1%的利润分配，分配金额18,754,570.85元。

5.3 托管人本年度报告中基金投资运作情况、利得和亏损情况的说明

本基金报告期内，南方宝元债券型证券投资基金的管理人公司依法编制并披露了南方宝元债券型证券投资基金基金年度报告，基金资产净值、净值表现、净值评级、净值波动情况、基金投资运作情况、基金收益分配情况、基金资产净值增长率等信息。

5.4 审计报告

6.1 计算报告基本情况

本基金于2015年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签

字出具了普华永道中天审字(2016)第21250号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正

文查看审计报告全文。

7.7 年度财务报表

7.1 资产负债表

7.2 利润表

7.3 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

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

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

3.2.3 过去五年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

3.2.4 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月16日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为全国第三家获准经营基金业务的基金管理公司。目前，南方基金管理公司已发展成为中国规模最大的基金管理公司之一，旗下管理的基金资产规模超过5,000亿元人民币，旗下管理85只开放式基金，多个社保、企业年金以及职业年金投资组合。

4.2 基金经理（基金经理小组）及基金经理助理简介

4.2.1 管理人对本基金基金经理的说明

本基金的首任基金经理，即“任职业日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“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。

4.2.2 本基金的基金经理

4.2.3 基金经理的从业经历

4.2.4 基金经理的薪酬情况

4.2.5 基金经理的其他情况

4.3 管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、绩效评估、合规监督等环节，制定了《公平交易制度》，并得到了有效的执行。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券等一级市场申购和二级市场交易等投资管理行为，以及研究分析、投资决策、交易执行