

南方宝元债券型基金

[2014] 第三季度报告

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:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书不存在虚假记载、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规定，于2014年10月22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內容，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。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

南方宝元债券

202101

契约型开放式

2002年9月20日

报告期末基金份额总额

869,773,763.65份

本基金为开放式债券型基金，以货币资金投资为主，股票投资为辅，在保持较低风险和充分流动性的前提下，通过长期持有债券，确保本金安全及实现保值增值。

本基金的收益分配方式为定期开放式。

基金的过往业绩

南方宝元债券自成立以来，每年均获得当年债基收益率排行榜第1名，连续三年蝉联债基冠军。

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“南方宝元”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

		报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期实现收益		40,076,640.78
2.本期利润		74,867,885.58
3.加权平均基金份额本期利润		0.0588
4.期末基金份额净值		1,234,978,293.60
5.期末基金份额总额		869,773,763.65

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申购基金时产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

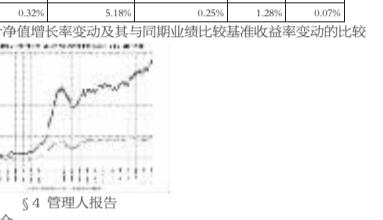
3.2 资金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段 净值增长①% 净值增长率偏离度②% 基金净值增长率③% 基准收益率④% 基准收益率偏离度⑤%

过去三个月 6.40% 0.32% 5.89% 0.20% 1.20% 0.07%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金期限 任职日期 离任日期 说明

蒋丽娟 本基金的基金经理 2009年2月10日 - 10 大北国际化学硕士，美国哥伦比亚大学金融工程学硕士，具有基金从业资格。曾任南方基金管理有限公司基金经理，2005年加入南方基金，2006年1月-2010年1月，任南方基金管理公司基金经理助理，2010年1月-2011年1月，任南方基金管理公司基金经理，2011年1月至今，任南方基金管理公司基金经理，2014年7月至今，任南方基金管理公司基金经理。

宿雷 本基金的基金经理 2010年12月21日 - 13 大北国际化学硕士，具有基金从业资格，曾任长盛基金管理公司行业研究员，2007年加入南方基金管理有限公司，2007年5月至2012年11月，任南方基金管理公司基金经理助理，2012年11月-2013年1月，任南方基金管理公司基金经理，2013年1月至今，任南方基金管理公司基金经理，2012年11月至今，任南方基金管理公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4 报告期内基金的销售费用说明

4.4.1 报告期内基金的销售费用分析

4.4.2 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.3 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.4 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.5 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.6 报告期内基金的销售费用说明

4.4.7 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.8 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.9 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.10 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.11 报告期内基金的销售费用说明

4.4.12 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.13 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.14 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.15 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.16 报告期内基金的销售费用说明

4.4.17 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.18 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.19 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.20 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.21 报告期内基金的销售费用说明

4.4.22 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.23 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.24 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.25 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.26 报告期内基金的销售费用说明

4.4.27 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.28 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.29 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.30 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.31 报告期内基金的销售费用说明

4.4.32 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.33 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.34 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.35 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.36 报告期内基金的销售费用说明

4.4.37 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.38 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.39 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.40 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.41 报告期内基金的销售费用说明

4.4.42 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.43 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.4.44 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.45 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，是由于指数基金根据标的指数成份股构成被动购买所致。

4.4.46 报告期内基金的销售费用说明

4.4.47 从证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.4.48 本报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和南方宝元债券型