

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监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和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字证明,并由报告人签名。

南方基金管理有限公司根据《基金合同》规定,于2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、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、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及其更新。

本报告期自2014年1月25日(基金合同生效日)起至12月31日止。

本年度报告摘要自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

基金简称	南方启元债券
基金主代码	1000561
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月25日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期基金总份额	445,891,190.18份
基金资产净值	不适用

下属分级基金的基金简称:南方启元债券A 南方启元债券C

下属分级基金的基金代码:000561 000562

报告期下属分级基金的份额总额:366,992,468.32份 78,808,721.86份

注:本基金在正常交易系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方启元”。

§ 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,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金以绝对收益和相对收益为投资目标,在经济周期、宏观政策方向及收益曲线拆分,进行债券投资策略。投资时机的选择和久期、配置调整、实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。

业绩比较基准 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

§ 2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 南方基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 王文平

信息披露负责人

联系电话 0755-82763888 010-65594896

电子邮箱 manager@southernfund.com fix@bankofchina.com

客户服务电话 400-889-8899 95566

传真 0755-82763889 010-65594942

§ 2.4 信息披露方式

信息披露方式的管理人互联网网址 http://www.southernfund.com

基金年度报告备置地点 基金管理人及基金托管人住所

§ 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 2014年7月25日(基金合同生效日)~2014年12月31日

南方启元债券A 南方启元债券C

本期已实现收益 7,852,425.15 2,736,066.08

本期利润 4,906,652.59 2,211,403.14

加权平均基金份额本期利润 0.0083 0.0100

本期基金份额净值增长率为 0.60% 0.40%

3.1.2 期末数据和指标 2014年末

期末可供分配基金份额利润 0.0064 0.0042

期末基金资产净值 369,348,344.21 79,255,372.83

期末基金份额净值 1.006 1.004

注:1.本期已实现收益指本基金本期收入、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,本期利润为本报告期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期初可供分配利润,采用期末可供分配利润与未分配利润之和减去本期利润后已实现部分的孰低数(为期末利润,不是当期发生数)。

3.所列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。

4.本基金合同生效日为2014年7月25日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

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

南方启元债券A

阶段 份额净值增长率为(%) 份额净值增长率为(%) 基准收益率 基准收益率

过去三个月 -0.10% 0.13% 0.82% 0.15% -0.92% -0.02%

自基金合同生效日起至今 0.60% 0.10% 2.15% 0.12% -1.55% -0.02%

南方启元债券C

阶段 份额净值增长率为(%) 份额净值增长率为(%) 基准收益率 基准收益率

过去三个月 -0.20% 0.13% 0.82% 0.15% -1.02% -0.02%

自基金合同生效日起至今 0.40% 0.10% 2.15% 0.12% -1.75% -0.02%

3.2.2 自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

注:基金合同生效日至本报告期末未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截止本报告期末建仓期未结束。

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:基金合同生效日至本报告期末未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截止本报告期末建仓期未结束。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:过去三年本基金未有利润分配事项。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人基本情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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,成为我国“新基金时代”的创始标志。

1998年4月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司注册资本为1亿元人民币,股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳证券交易所(20%);巨田国际信托有限公司(15%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司北京、上海、合肥、成都、深圳等设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内公司获准成立的第一家境外机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近3,000亿元,旗下管理57只开放式基金,多个全国社保、企业年金和客户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金基金经理(或基金经理小组成员)的日期 证券从业年限

王文平 基金管理人 2014年7月25日 6年

注:1.对基金的首次基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首次基金经理,“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。

2.基金管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

3.过去三年基金的利润分配情况

注:过去三年本基金未有利润分配事项。

§ 5 管理人报告

4.1 基金管理人对本基金运作情况的说明

4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

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,成为我国“新基金时代”的创始标志。

1998年4月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司注册资本为1亿元人民币,股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳证券交易所(20%);巨田国际信托有限公司(15%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司北京、上海、合肥、成都、深圳等设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内公司获准成立的第一家境外机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近3,000亿元,旗下管理57只开放式基金,多个全国社保、企业年金和客户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金基金经理(或基金经理小组成员)的日期 证券从业年限

王文平 基金管理人 2014年7月25日 6年

注:1.对基金的首次基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首次基金经理,“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。

2.基金管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

3.过去三年基金的利润分配情况

注:过去三年本基金未有利润分配事项。

§ 6 管理人对本基金年度报告及其摘要的说明

6.1 本报告期自2014年1月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

6.2 本报告期基金投资运作符合基金合同的约定。

6.3 本报告期基金投资运作无重大关联交易。

6.4 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.5 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.6 本报告期基金投资运作无关联交易。

6.7 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.8 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.9 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.10 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.11 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.12 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.13 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.14 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.15 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.16 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.17 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.18 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.19 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.20 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.21 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.22 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.23 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.24 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.25 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.26 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.27 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.28 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.29 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.30 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.31 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.32 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.33 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.34 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.35 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.36 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.37 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.38 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.39 本报告期基金投资运作无利益输送行为。

6.40 本报告期基金投资运作无不公平交易和利益输送行为。

6.41 本报告期基金投资运作无内幕交易和不公平交易行为。

6.42 本报告期基金投资运作无利益输送行为。</p