

南方宝元债券型基金

[2015] 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:2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，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。

本报告财务资料未经审计。本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:南方宝元债券型证券投资基金

基金简称:南方宝元债券

基金代码:200201

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2000年10月20日

报告期末基金份额总额:1,007,096,025.00份

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下，通过积极的资产配置策略以及对宏观经济、政策、利率、信用、流动性、市场情绪等的深入分析，精选具有较高投资价值的债券品种，力争在有效控制风险的前提下，为投资者创造稳定收益。

投资策略:本基金在严格控制风险的前提下，通过积极的资产配置策略以及对宏观经济、政策、利率、信用、流动性、市场情绪等的深入分析，精选具有较高投资价值的债券品种，力争在有效控制风险的前提下，为投资者创造稳定收益。

本报告期基金净值增长率:7.13%；同期业绩比较基准收益率:2.29%；基金净值增长率相对业绩比较基准收益率的差值:4.84%。

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等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

单位:人民币元

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

1.本期各项收入:71,326,804.68元

2.本期利润:-131,230,997.32元

3.加权平均基金份额本期利润:-0.1420

4.期末基金份额净值:1,047,104.8654元

1.6936

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)扣除应付赎回费后的余额，低于零时以零计算。2.上述业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -6.71% -1.39% -6.00% 0.02% -0.81% 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

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较

较