

南方恒元保本混合型证券投资基金 2009 年年度报告摘要

2009年12月31日

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

送出日期：2010年3月31日

\$1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告书已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2010年3月25日复核了本基金中的财务指标、净值表现、利率分配情况、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、误导性陈述及其更新。

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。

基金托管人承诺以诚实信用、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。

本报告书所载摘要自本年度报告正文生效后，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

\$2 基金简介

1) 基金基本情况	南方恒元保本混合型证券投资基金
基金简称	南方恒元保本混合
基金代码	202211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月12日
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
报告期末基金份额总额	2,726,894,841.64份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示其他信息披露方式下，可简称为“南方恒元”。

2.2 其他产品说明

本基金严格限制风险的前提下，为投资人提供购买基金金额中保本保值部分，并以此为基础力争实现较高的增值。

本基金的投资策略分为保本策略和风险策略，分别为对风险资产和无风险资产的配置比例。

保本策略所承受的最大损失不能超过无风险资产部分所承受的收益；风险策略则充分配置债券、基金等资产。

本基金的业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

风险收益特征：本基金是保本基金，属于低风险投资基金中的低风险品种。

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	中国工商银行股份有限公司
姓名	鞠文革	蒋松云
信息披露负责人联系电话	0755-82763888	010-66105799
电子邮箱	manager@southfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798

2.4 日常披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址：<http://www.sffund.com>

基金份额持有人服务地点：基金管理人、基金托管人的办公地址

§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**

单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标		2009年	2008年11月12日 基金合同生效日 端	2008年12月31日
本期实现收益	131,247,065.94		4,563,558.26	
本期利润	375,236,221.97		41,020,529.30	
加权平均基金份额本期利润率	0.1410		0.0180	
本期基金份额净值增长率	13.47%		1.80%	

3.1.2 期末数据和指标

2009年：0.0311 经济增长

2008年：0.0020 经济增长

3.1.3 期末基金份额净值

3,093,772,128.23

2,475,239,544.24

3.1.4 期末基金资产净值

1,1350

1.0180

注：1.本期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，本期利息收入为本期已实现收益加上上期收益扣减费用后的余额；2.本期利润指基金利润，即基金本期利息收入、投资收益、其他收入扣除相关费用后的余额，经调整后的期末基金份额净值；3.期末未分配利润=期末基金净值-期末基金份额净值；4.经济增加值=当期基金利润-当期利息收入。

4.2008年的最新编制期间为2008年11月12日 基金合同生效日 至 2008年12月31日止期间。

3.2.1 基金净值表现

3.2.1.1 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

阶段	份额净值增长 增长率	份额净值增 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	11.93%	0.81%	0.01%	11.12%
过去六个月	6.76%	1.13%	1.64%	0.01%
过去一年	13.47%	0.84%	3.31%	0.01%
自基金合同生 效日起至今	15.51%	0.78%	3.85%	0.01%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的变化比较

注：1.基金合同生效以来基金累计净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.4 基金合同生效以来基金各年度净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1.基金合同生效以来基金各年度净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.5 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.6 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.7 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.8 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.9 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.10 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.11 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.12 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.13 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.14 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.15 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.16 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.17 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.18 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.19 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.20 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1关于基金资产估值的特别说明”。

3.2.21 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：1.基金合同生效以来基金每年净值增长率=1.1350，基金净值增长率为2,726,893,841.64份，经调整后的期末基金份额净值为1.1350；2.本报告期内的实际情况与基金合同关于基金资产估值的约定不符，详见“4.4.1