

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
基金合同生效日期:2012年6月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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法律责任。
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2012年6月29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基金招募说明书及更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中所列财务数据未经审计。

本报告自2012年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name (南方宝元债券), start date (2012.01.20), and manager (南方基金管理有限公司).

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 3 columns: Name, Position, and Contact Info. Lists the fund manager (南方基金管理有限公司) and custodian (中国工商银行股份有限公司).

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the reporting period (2012年1月1日至2012年6月30日).

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the reporting period.

3.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:南方宝元债券基金业绩比较基准=中证全债指数收益率+1.00%

3.4 基金管理人报告

4.1 基金管理人及基金业绩情况
4.2 基金管理人及基金业绩情况
4.3 基金管理人及基金业绩情况

4.4 基金管理人及基金业绩情况

4.5 基金管理人及基金业绩情况

4.6 基金管理人及基金业绩情况

4.7 基金管理人及基金业绩情况

4.8 基金管理人及基金业绩情况

4.9 基金管理人及基金业绩情况

4.10 基金管理人及基金业绩情况

4.11 基金管理人及基金业绩情况

4.12 基金管理人及基金业绩情况

4.13 基金管理人及基金业绩情况

4.14 基金管理人及基金业绩情况

4.15 基金管理人及基金业绩情况

4.16 基金管理人及基金业绩情况

4.17 基金管理人及基金业绩情况

4.18 基金管理人及基金业绩情况

4.19 基金管理人及基金业绩情况

4.20 基金管理人及基金业绩情况

4.21 基金管理人及基金业绩情况

4.22 基金管理人及基金业绩情况

4.23 基金管理人及基金业绩情况

4.24 基金管理人及基金业绩情况

4.25 基金管理人及基金业绩情况

4.26 基金管理人及基金业绩情况

4.27 基金管理人及基金业绩情况

4.28 基金管理人及基金业绩情况

4.29 基金管理人及基金业绩情况

4.30 基金管理人及基金业绩情况

4.31 基金管理人及基金业绩情况

4.32 基金管理人及基金业绩情况

4.33 基金管理人及基金业绩情况

4.34 基金管理人及基金业绩情况

4.35 基金管理人及基金业绩情况

4.36 基金管理人及基金业绩情况

4.37 基金管理人及基金业绩情况

4.38 基金管理人及基金业绩情况

4.39 基金管理人及基金业绩情况

4.40 基金管理人及基金业绩情况

4.41 基金管理人及基金业绩情况

4.42 基金管理人及基金业绩情况

4.43 基金管理人及基金业绩情况

4.44 基金管理人及基金业绩情况

4.45 基金管理人及基金业绩情况

4.46 基金管理人及基金业绩情况

4.47 基金管理人及基金业绩情况

4.48 基金管理人及基金业绩情况

4.49 基金管理人及基金业绩情况

4.50 基金管理人及基金业绩情况

4.51 基金管理人及基金业绩情况

4.52 基金管理人及基金业绩情况

4.53 基金管理人及基金业绩情况

4.54 基金管理人及基金业绩情况

4.55 基金管理人及基金业绩情况

4.56 基金管理人及基金业绩情况

4.57 基金管理人及基金业绩情况

南方宝元债券型基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守信义、净值计算、利润分配等情况的说明

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

6.1 资产负债表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows assets and liabilities for the reporting period.

6.2 利润表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows income and expenses for the reporting period.

6.3 所有者权益变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows changes in equity for the reporting period.

6.4 现金流量表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows cash flows for the reporting period.

6.5 关联方关系

6.5.1 关联方关系
6.5.2 关联方交易

6.6 关联方交易

6.6.1 关联方交易
6.6.2 关联方交易

6.7 关联方交易

6.7.1 关联方交易
6.7.2 关联方交易

6.8 关联方交易

6.8.1 关联方交易
6.8.2 关联方交易

6.9 关联方交易

6.9.1 关联方交易
6.9.2 关联方交易

6.10 关联方交易

6.10.1 关联方交易
6.10.2 关联方交易

6.11 关联方交易

6.11.1 关联方交易
6.11.2 关联方交易

6.12 关联方交易

6.12.1 关联方交易
6.12.2 关联方交易

6.13 关联方交易

6.13.1 关联方交易
6.13.2 关联方交易

6.14 关联方交易

6.14.1 关联方交易
6.14.2 关联方交易

6.15 关联方交易

6.15.1 关联方交易
6.15.2 关联方交易

6.16 关联方交易

6.16.1 关联方交易
6.16.2 关联方交易

6.17 关联方交易

6.17.1 关联方交易
6.17.2 关联方交易

6.18 关联方交易

6.18.1 关联方交易
6.18.2 关联方交易

6.19 关联方交易

6.19.1 关联方交易
6.19.2 关联方交易

6.20 关联方交易

6.20.1 关联方交易
6.20.2 关联方交易

6.21 关联方交易

6.21.1 关联方交易
6.21.2 关联方交易

6.22 关联方交易

6.22.1 关联方交易
6.22.2 关联方交易

6.23 关联方交易

6.23.1 关联方交易
6.23.2 关联方交易

6.24 关联方交易

6.24.1 关联方交易
6.24.2 关联方交易

6.25 关联方交易

6.25.1 关联方交易
6.25.2 关联方交易

6.26 关联方交易

6.26.1 关联方交易
6.26.2 关联方交易

6.27 关联方交易

6.27.1 关联方交易
6.27.2 关联方交易

6.28 关联方交易

6.28.1 关联方交易
6.28.2 关联方交易

6.29 关联方交易

6.29.1 关联方交易
6.29.2 关联方交易

6.30 关联方交易

6.30.1 关联方交易
6.30.2 关联方交易

6.31 关联方交易

6.31.1 关联方交易
6.31.2 关联方交易

6.32 关联方交易

6.32.1 关联方交易
6.32.2 关联方交易

6.33 关联方交易

6.33.1 关联方交易
6.33.2 关联方交易

6.34 关联方交易

6.34.1 关联方交易
6.34.2 关联方交易

6.35 关联方交易

6.35.1 关联方交易
6.35.2 关联方交易

6.36 关联方交易

6.36.1 关联方交易
6.36.2 关联方交易

6.37 关联方交易

6.37.1 关联方交易
6.37.2 关联方交易

6.38 关联方交易

6.38.1 关联方交易
6.38.2 关联方交易

6.39 关联方交易

6.39.1 关联方交易
6.39.2 关联方交易

注:买入包括二级市场主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额成交单乘以成交量,赎回,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: No., Stock Code, Stock Name, Period Total Selling Amount, and Proportion of Total Assets. Lists top 20 stocks sold.

注:卖出包括二级市场主动的卖出、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出金额按成交金额成交单乘以成交量,赎回,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: Item and Value. Shows total cost of purchases and total income from sales.

买入股票成本及成交金额: 365,794,533.00
卖出股票收入及成交金额: 385,607,484.61

注:买入股票成本及成交金额、卖出股票收入及成交金额成交单乘以成交量,赎回,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: No., Bond Type, Fair Value, and Proportion of Total Assets.

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 国债券种 - -

2 央行票据 77,549,000.00 5.63

3 金融债种 266,574,400.00 19.34

其中:政策性金融债 204,999,000.00 14.88

4 企业债种 735,210,891.60 53.20

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 92,984,000.00 6.75

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 1,170,318,291.60 84.92

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: No., Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, and Proportion of Total Assets.

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 1100007 11国债07 600,000 62,190,000.00 4.51

2 080216 08国债16 500,000 52,575,000.00 3.81

3 1101088 11央行票据88 500,000 48,455,000.00 3.52

4 126011 08央行债 500,000 47,405,000.00 3.45

5 110411 11政发11 400,000 41,776,000.00 3.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金报告期内持有的于转股期的可转换债券品种

注:本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

7.9.2 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.3 其他各项资产构成

Table with 2 columns: Item and Value. Shows other assets.

序号 名称 金额

1 存出保证金 539,003.33

2 应收证券清算款 - -

3 应收股利 - -

4 应收利息 27,013,410.50

5 应收申购款 8,172,360.51

6 其他 6,724,776.34

8 其他 35,724,776.34

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券品种

注:本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: Item and Value. Shows number of holders and structure.

持有户数(户) 户均持有的基金份额

机构投资者 个人投资者

持有份额 占总份额比例 持有份额 占总份额比例

52,023 22,165.51 110,700,488.86 9.61% 1,042,335,841.85 90.39%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fund manager holdings.

项目 持有基金份额(份) 占总基金份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金 1,132.84 0.00%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额,本基金基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fund asset changes.

基金合同生效日(2002年9月20日) 基金份额总额 4,902,664,980.80

本报告期初基金份额总额 1,214,160,899.31

本报告期间基金总申购份额 6,787,917.76

减:本报告期间基金总赎回份额 129,718,526.36

本报告期末基金份额总额 1,153,116,290.71

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.4 基金投资策略的重大调整

10.5 为基金提供审计的会计师事务所情况

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

Table with 5 columns: No., Broker Name, Transaction Volume, Commission, and Proportion of Total Assets.

序号 券商名称 交易单元数量 成交金额 占当期股票成交总额的比例 佣金 占当期佣金总额的比例 备注

1 华安证券有限公司 1 200,628,350.43 27.53% 171,978.17 2.87%

2 广发证券股份有限公司 2 131,242,019.88 17.75% 106,662.56 1.72%

3 中信建投证券股份有限公司 2 119,654,823.35 16.18% 98,687.85 1.60%

4 信达证券股份有限公司 1 71,656,624.11 9.69% 60,909.41 0.87%