

南方广利回报债券型证券投资基金 2019年第一季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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2019年4月17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。

本报章在中财数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金名称	南方广利
基金代码	202106
交易方式	定期开放式
基金合同生效日	2010年11月1日
报告期末基金份额总额	323,644,304.60份
投资目标	本基金在追求资产收益性及有效控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值。
基金经理	南方广利基金经理：刘文良 南方广利债券A/B基金经理：南广利债券C基金经理：陈海峰 南方广利债券A/C基金经理：陈海峰 南方广利债券C基金经理：陈海峰
基金的过往业绩	自基金成立以来至2019年3月31日，本基金A类份额净值增长率为1.20%，报告期内，基金份额净值增长率分别为1.20%；本基金C类份额净值增长率为2.75%，报告期内，基金份额净值增长率分别为2.75%；同期业绩比较基准收益率变动幅度为-0.60%。
投资策略	本基金通过深入研究宏观经济和微观经济政策的变化，运用定量定性的分析方法，对证券市场当期的宏观经济形势以及可预期的未来趋势进行综合分析，结合对本基金的收益、风险特征的分析，综合考虑本基金的收益、风险特征和流动性，制定出具体的定期赎回、申购、赎回等资产之间的比例分配、调整和调整比例，以达到避险保值及提高收益的目的。
业绩基准	本基金的业绩基准：超短期利率+0.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，风险系数适中，适合于风险承受能力较低的投资者。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	南方广利债券A/B 南方广利债券C
下属分级基金的交易代码	202106 202107
下属分级基金的前端交易代码	202106
下属分级基金的后端交易代码	202106
报告期末下属分级基金的份额总额	211,369,363.99份 112,489,942.66份

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“南方广利”。

§ 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(2019年1月1日至2019年3月31日)					
南方广利债券A/B 南方广利债券C		7,303,406,392.00 9,422,703.11			
本期利息收入		10,161,000.02 9,422,703.11			
利息费用		0.03 0.03			
利息收入净额		229,723,233.65 143,047,234.01			
本期未分配利润		1,394 1,277			
3.2 本期末基金总份额		6.07% 0.26%			
3.3 本期末份额净值		1.42% 1.42%			
3.4 本期末份额净值增长率为		1.20% 2.75%			
3.5 本期末份额净值变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较		-0.60% -0.26%			

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。
2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。
3. 基金净值表现

3.2 本期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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去二个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现

3.2 本基金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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现

3.2 本基金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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现

3.2 本基金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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现

3.2 本基金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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现

3.2 本基金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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现

3.2 本基金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
南方广利债券A/B
南方广利债券C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.07%	0.26%	1.42%	1.42%	6.07%	0.26%
过去一个月	1.394	1.277	1.42%	1.42%	1.394	1.277

注:1. 上述基金主要财务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将低于所示数字。

2. 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, 其他收入不包含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额。

3. 基金净值表现