

南方广利回报债券型证券投资基金

2014] 第一季度报告

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:2014年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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、完整性负责。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年4月18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。

说明:本报告中财务数据未经审计。

本报告告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方广利回报债券
交易代码	202105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月31日
报告期末基金份额总额	590,718,634.62份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的稳定增值及有控制风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将主要通过以价值投资和资产配置为原则，即综合运用量价分析和基本面分析对证券市场的短期系统性风险以及可识别的未来的长期大类资产的市场价格风险进行收益预测，从而确定资产配置比例，同时根据宏观经济形势、资金面情况、市场利率变化、政策导向等适时调整资产之间的配置比例，进而调整资产配置比例，择机进行定期调整，以达到风险分散及提高收益的目的。
业绩比较基准	本基金为债券型基金，其长期平均风险预期收益率低于股票基金，高于货币市场基金。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险预期收益率低于股票基金，属于中低风险品种。
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
下属分级基金的基金简称	南方广利回报债券A/B
下属分级基金的交易代码	202105 202107
下属分级基金的最近交易日期	-
报告期末下属分级基金的份额总额	360,475,174.94份 230,243,659.68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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)	
南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	
1.本期已实现收益	3,899,279.98	2,756,504.34
2.本期利润	5,595,227.39	4,431,435.66
3.期初至报告期期末基金期间利润	0.0158	0.0178
4.期末基金资产净值	385,033,767.73	242,787,652.69
5.期末基金份额净值	1.068	1.054

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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.21.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

南方广利回报债券A/B

南方广利回报债券C

业绩比较基准

南方广利回报债券A/B

南方广利回报债券C

南方广利回报