

南方广利回报债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

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

送出日期：2018 年 03 月 29 日

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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2018 年 3 月 26 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招募说明书及其更新。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方广利	
基金主代码	202105	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 3 日	
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	
报告期末基金份额总额	460,396,773.90 份	
基金合同存续期	不定期	
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	202105	202107
下属分级基金的前端交易代码	202105	-
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	303,616,819.78 份	156,779,954.12 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”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性及有效控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人将以经济周期和宏观政策分析为前提,综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在债券、股票、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	中证全债指数
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基金、混合基金,高于货币市场基金。

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		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	报告期(2017年01月01日 -2017年12月31日)		报告期(2016年01月01日 -2016年12月31日)		报告期(2015年01月01日 -2015年12月31日)	
	南方广利债 券 A/B	南方广利债 券 C	南方广利债 券 A/B	南方广利债 券 C	南方广利债 券 A/B	南方广利债 券 C
本期 已实 现收 益	10,963,856. 35	2,998,140.3 4	- 188,732,091 .36	- 100,627,274 .23	192,490,598 .33	97,756,867. 46
本期 利润	19,096,225. 74	6,597,299.9 1	- 134,458,886	- 93,191,448.	- 36,400,877.	- 63,760,531.

			.32	41	55	73
加权平均基金份额本期利润	0.0411	0.0316	-0.1608	-0.2109	-0.0362	-0.0866
本期基金份额净值增长率	2.99%	2.56%	-10.98%	-11.27%	4.35%	4.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)	报告期(2016年12月31日)	报告期(2016年12月31日)		报告期(2015年12月31日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0152	-0.0378	-0.0435	-0.0604	0.2291	0.2115
期末基金资产净值	398,022,237.45	201,332,273.84	720,446,755.05	354,631,295.72	1,434,648,680.97	1,092,246,513.50
期末基金份额净值	1.311	1.284	1.273	1.252	1.430	1.411

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已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，计入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 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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.46%	0.31%	-0.69%	0.05%	0.23%	0.26%
过去六个月	0.69%	0.24%	-0.14%	0.05%	0.83%	0.19%
过去一年	2.99%	0.21%	-0.34%	0.06%	3.33%	0.15%
过去三年	-4.34%	1.18%	10.54%	0.08%	-14.88%	1.10%
过去五年	41.62%	0.99%	21.18%	0.09%	20.44%	0.90%
自基金合同	50.69%	0.84%	31.43%	0.10%	19.26%	0.74%

南方广利债券 C

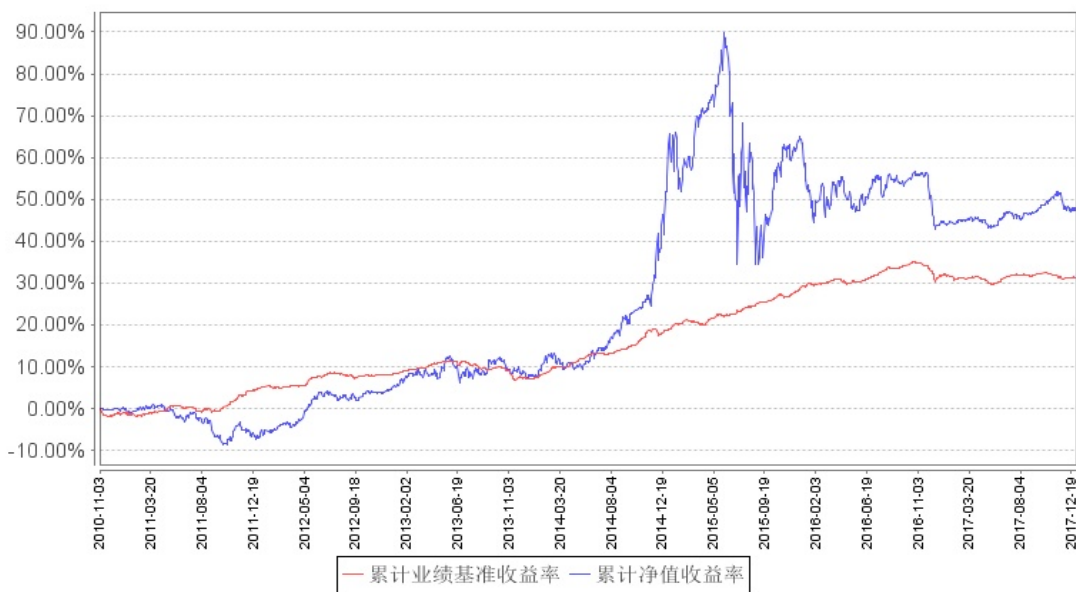
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.62%	0.29%	-0.69%	0.05%	0.07%	0.24%
过去六个月	0.47%	0.24%	-0.14%	0.05%	0.61%	0.19%
过去一年	2.56%	0.21%	-0.34%	0.06%	2.90%	0.15%
过去三年	-4.78%	1.18%	10.54%	0.08%	-15.32%	1.10%
过去五年	40.17%	0.99%	21.18%	0.09%	18.99%	0.90%
自基金合同	47.88%	0.84%	31.43%	0.10%	16.45%	0.74%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

南方广利债券A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

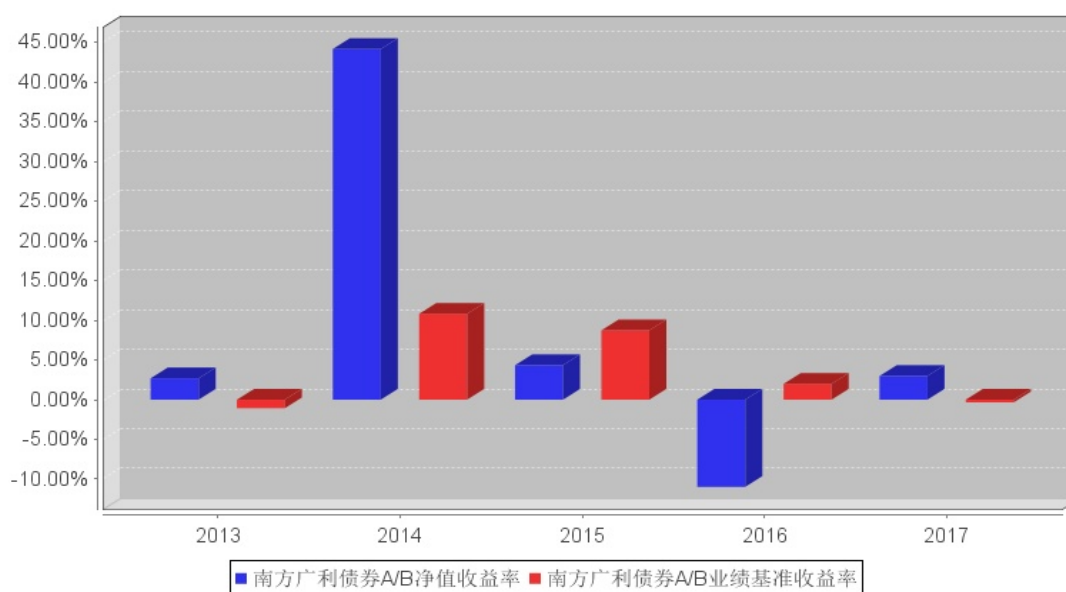


南方广利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

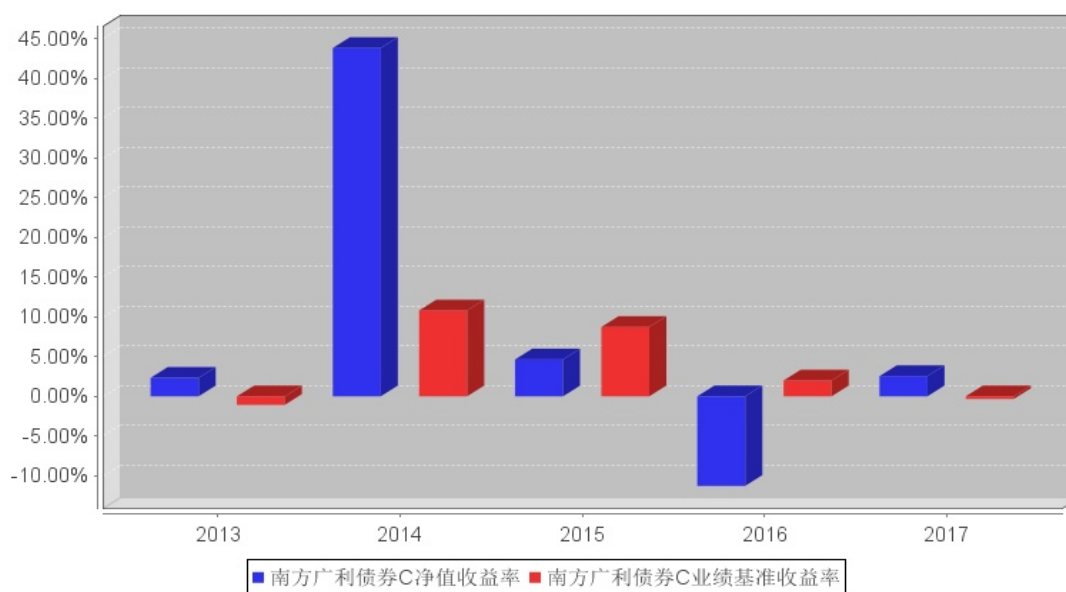


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方广利债券A/B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方广利债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：元

南方广利债券 A/B

年度	每 10 份基金 份额分红 数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分 配合计	备注
2017 年	-	-	-	-	
2016 年	-	-	-	-	
2015 年	0.8000	74,094,635 .49	18,090,069 .71	92,184,705 .20	

合计	0.8000	74,094,635 .49	18,090,069 .71	92,184,705 .20	
----	--------	-------------------	-------------------	-------------------	--

南方广利债券 C

年度	每 10 份基金 份额分红 数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分 配合计	备注
2017 年	-	-	-	-	
2016 年	-	-	-	-	
2015 年	0.8000	49,507,937 .53	11,495,376 .21	61,003,313 .74	
合计	0.8000	49,507,937 .53	11,495,376 .21	61,003,313 .74	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理）期 限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职日 期	离任日 期		
刘文良	本基金 基金经 理	2016 年 6 月	-	5	北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015 年 2 月至

		24 日			2015 年 8 月，任南方永利基金经理助理；2015 年 12 月至 2017 年 2 月，任南方弘利基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 5 月，任南方安心基金经理；2015 年 8 月至今，任南方永利基金经理；2016 年 6 月至今，任南方广利基金经理；2016 年 7 月至今，任南方甄智混合基金经理；2016 年 11 月至今，任南方荣发、南方卓元基金经理；2017 年 5 月至今，任南方和利、南方和元、南方纯元基金经理；2017 年 6 月至今，任南方高元基金经理；2017 年 8 月至今，任南方祥元基金经理；2017 年 9 月至今，任南方兴利基金经理。
--	--	------	--	--	---

注:1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方广利回报债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待

旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年在经济增长韧性强、货币政策中性偏紧、金融监管政策趋严的背景下，债券市场经历了3轮明显的调整，全年来看，1年国债、1年国开债收益率分别上行114BP、150BP，10年国债、10年国开债收益率分别上行87BP、114BP，信用利差走扩，全年中债总财富指数下跌1.19%。2017年权益市场震荡上行，结构分化显著，全年沪深300指数上涨21.78%，中证500指数下跌0.20%，创业板指数下跌10.67%；可转债市场6-8月表现较好，9-12月同时受到正股调整和供给放量杀估值的影响出现回调，全年中证转债指数微跌0.16%，个券同样呈现二八行情，多只个券涨幅超过8%。南方广利基金2017年纯债方面以持有信用债为主，根据行业和个券性价比的变化调整信用债持仓结构，保持了中性偏低的信用久期，主要获取信用债票息收益，阶段性参与长端利率债波段控制了仓位和久期，并根据市场运行节奏适时止盈或止损；权益方面，全年保持了中性偏高的股票仓位，积极把握结构性行情，重点配置增长确定性高、估值合理的成长白马以及基本面向好、估值便宜的蓝筹标的，可转债波段操作，以挖掘可转债个券超额收益为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金A级净值增长率为2.99%，同期业绩比较基准收益率为-0.34%。本报告期基金C级净值增长率为2.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

纯债市场方面，预计2018年一季度经济增长平稳，韧性较强，高基数效应下PPI同比下降，低基数、春节效应等因素驱动下CPI同比上升，基本面层面暂时看不到驱动利率下行的催化剂；2017年12月的中央经济工作会议定调货币政策保持中性，管住货币供给总闸门，预计一季度资金面难见持续宽松，跨春节、跨季时点可能出现阶段性紧张，3个月及以上期限同业存单利率保

持较高水平，防范化解重要风险是决胜全面建成小康社会的三大攻坚战之一，预计金融监管进一步趋严，一季度是监管政策的密集落地期，政策层面对债券市场偏负面。经过 2017 年四季度的大幅调整，债券收益率曲线平坦，短端票息收益丰厚，年初配置性需求释放以及资金阶段性宽松有望推动中短端债券收益率下行，但基本面平稳、监管政策趋严的背景下难见趋势性机会，信用利差偏低的情况下有估值调整的风险，总体来看债市短端具备较好的投资价值，中长端的机会仍需耐心等待，同时需警惕中低评级信用利差走阔的风险。权益市场方面，2017 年 11 月中旬至年底的调整在时间和空间上已经较为充分，转过年关进入春季躁动的阶段，绝对收益投资者的心态从年末的落袋为安转为年初的早配置早收益，叠加资金面紧张的阶段性缓解，市场开年表现可能较好，市场最大的不确定性和上行阻力依然来自金融监管落地节奏的不确定性，市场风格可能较 2017 年更加均衡，地产、金融蓝筹估值便宜、风险收益比较优，PPI 向下、CPI 向上的组合中看好消费升级和通胀相关标的，供给侧改革补短板背景下看好具备核心竞争力的新经济龙头；可转债市场 2017 年四季度在供给放量背景下估值压缩，整体估值压缩至 2017 年内阶段性低点，历史上看也进入相对便宜的区间，虽然债性保护不够充分，但向上弹性大大恢复，在一季度权益市场表现较好、一级供给阶段性放缓的情况下估值中枢有望维持在当前水平，基本面优质、估值便宜的个券有望带来较好的结构性机会。2018 年一季度，南方广利基金纯债方面将以获取中短端票息收益为主，并根据基本面和信用利差的变化适时调整信用债行业和个券的配置比例；权益方面捕捉市场结构性机会，关注市场风格和热点主题的变化，灵活调整股票和可转债仓位，重点挖掘股票板块、题材和可转债个券层面的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：由于本基金 A 类/B 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方广利回报债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方广利回报债券证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方广利回报债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方广利回报债券证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方广利回报债券证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

本基金 2017 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第 22760 号“标准无保留意见的审计报告”, 投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 南方广利回报债券型证券投资基金

报告截止日: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	3,071,490.20	9,594,907.48
结算备付金		13,051,712.55	52,507,274.91
存出保证金		249,038.86	232,492.08
交易性金融资产	7.4.7.2	730,805,784.92	1,170,509,248.49
其中: 股票投资		101,315,223.98	108,366,234.07
基金投资		-	-
债券投资		629,490,560.94	1,062,143,014.42
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	10,120,135.18	-
应收证券清算款		5,163,411.53	19,109,735.85
应收利息	7.4.7.5	12,677,227.54	18,367,492.79
应收股利		-	-
应收申购款		46,671.64	149,463.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	1,000.00	-
资产总计		775,186,472.42	1,270,470,615.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		167,069,604.89	181,000,000.00
应付证券清算款		5,759,108.35	11,386,370.70
应付赎回款		1,449,852.52	1,023,674.12
应付管理人报酬		340,972.73	709,187.74
应付托管费		104,914.69	218,211.62
应付销售服务费		72,014.78	144,430.32
应付交易费用	7.4.7.7	622,967.21	624,652.78
应交税费		-	-
应付利息		28,412.09	3,670.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	384,113.87	282,366.77
负债合计		175,831,961.13	195,392,564.31
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	460,396,773.90	849,008,025.36
未分配利润	7.4.7.10	138,957,737.39	226,070,025.41
所有者权益合计		599,354,511.29	1,075,078,050.77
负债和所有者权益总计		775,186,472.42	1,270,470,615.08

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 460,396,773.90 份，其中南方广利回报债券型证券投资基金 A/B 类基金份额的份额总额为 303,616,819.78 份，份额净值 1.311 元；南方广利回报债券型证券投资基金 C 类基金份额的份额总额为 156,779,954.12 份，份额净值 1.284 元。

7.2 利润表

会计主体：南方广利回报债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		44,802,141.70	-193,097,195.12
1. 利息收入		44,214,577.85	68,726,656.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	375,829.88	1,350,619.69
债券利息收入		43,807,214.90	67,376,036.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		31,533.07	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		-11,185,359.90	-324,977,128.24

” 填列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	489,631.26	-96,894,963.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-12,620,507.95	-229,822,864.72
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	945,516.79	1,740,700.32
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.17	11,731,528.96	61,709,030.86
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.18	41,394.79	1,444,246.15
减：二、费用		19,108,616.05	34,553,139.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,649,153.93	11,195,275.91
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,738,201.25	3,444,700.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,066,857.62	2,359,779.87
4. 交易费用	7.4.7.19	3,165,568.21	3,031,824.11
5. 利息支出		7,060,977.49	14,088,539.78
其中：卖出回购金融资产 支出		7,060,977.49	14,088,539.78
6. 其他费用	7.4.7.20	427,857.55	433,019.69
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		25,693,525.65	-227,650,334.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)		25,693,525.65	-227,650,334.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方广利回报债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权 益（基金净值）	849,008,025.36	226,070,025.41	1,075,078,050.77
二、本期经营活动	-	25,693,525.65	25,693,525.65

产生的基金净值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-388,611,251.46	-112,805,813.67	-501,417,065.13
其中：1. 基金申购款	44,347,592.60	12,805,334.39	57,152,926.99
2. 基金赎回款	-432,958,844.06	-125,611,148.06	-558,569,992.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	460,396,773.90	138,957,737.39	599,354,511.29
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,777,177,964.74	749,717,229.73	2,526,895,194.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-227,650,334.73	-227,650,334.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-928,169,939.38	-295,996,869.59	-1,224,166,808.97
其中：1. 基金申购款	1,434,969,233.20	492,985,938.86	1,927,955,172.06
2. 基金赎回款	-2,363,139,172.58	-788,982,808.45	-3,152,121,981.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	849,008,025.36	226,070,025.41	1,075,078,050.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松	徐超	徐超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收

入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	752,667,754.23	36.31	877,770,851.62	46.15

7.4.4.1.2 权证交易

注:无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	683,995.65	36.19	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	787,630.21	45.49	277,421.46	45.14

注:: 1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,649,153.93	11,195,275.91
其中:支付销售机构的客户维护费	1,276,056.11	1,858,248.14

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.65% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,738,201.25	3,444,700.25

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方广利债券 A/B	南方广利债券 C	合计
南方基金	-	436,169.69	436,169.69
中国工商银行	-	276,957.86	276,957.86
华泰证券	-	6,362.85	6,362.85
兴业证券	-	306.55	306.55
合计	-	719,796.95	719,796.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方广利债券 A/B	南方广利债券 C	合计
南方基金	-	1,483,565.02	1,483,565.02
中国工商银行	-	367,305.28	367,305.28
华泰证券	-	7,840.46	7,840.46
兴业证券	-	327.86	327.86
合计	-	1,859,038.62	1,859,038.62

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A/B 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注:无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,071,490.20	68,829.04	9,594,907.48	291,249.07

注:本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123006	东财转债	2017-12-25	2018-01-29	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-
123003	蓝思转债	2017-12-13	2018-01-17	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-
110042	航电转债	2017-12-28	2018-01-15	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
128024	宁行转债	2017-12-08	2018-01-12	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	2017-12-31	100.00	161,600	6,292,907.40	6,131,104.00	

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,069,604.89 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
170410	17 农发 10	2018-01-04	99.47	313,000	31,134,110.00
101782007	17 中铝业 MTN003	2018-01-02	99.31	200,000	19,862,000.00
101453022	14 五矿股 MTN001	2018-01-02	99.64	23,000	2,291,720.00
合计				536,000	53,287,830.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 117,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	101,315,223.98	13.07
	其中：股票	101,315,223.98	13.07
2	固定收益投资	629,490,560.94	81.21
	其中：债券	629,490,560.94	81.21
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,120,135.18	1.31
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	16,123,202.75	2.08
7	其他各项资产	18,137,349.57	2.34
8	合计	775,186,472.42	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,213,888.00	0.54
B	采矿业	-	-
C	制造业	58,099,018.00	9.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,972,619.00	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,968,070.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	2,957,086.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	15,196,808.20	2.54
K	房地产业	12,453,910.78	2.08
L	租赁和商务服务业	3,453,824.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	101,315,223.98	16.90

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	400,963	12,453,910.78	2.08
2	601336	新华保险	174,411	12,243,652.20	2.04
3	000725	京东方 A	1,209,200	7,001,268.00	1.17
4	300308	中际装备	118,400	6,926,400.00	1.16
5	002511	中顺洁柔	419,400	6,827,832.00	1.14
6	002236	大华股份	275,200	6,354,368.00	1.06
7	002185	华天科技	732,400	6,240,048.00	1.04
8	600309	万华化学	161,600	6,131,104.00	1.02
9	000063	中兴通讯	168,000	6,108,480.00	1.02
10	600487	亨通光电	151,100	6,107,462.00	1.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	47,696,747.18	4.44
2	002241	歌尔股份	35,007,626.10	3.26
3	002185	华天科技	31,602,756.81	2.94
4	002236	大华股份	30,387,383.92	2.83
5	600703	三安光电	27,717,548.91	2.58
6	002419	天虹股份	24,307,515.90	2.26
7	000002	万科 A	22,439,069.87	2.09
8	601318	中国平安	21,131,740.32	1.97

9	000786	北新建材	19,451,396.00	1.81
10	002074	国轩高科	19,301,488.92	1.80
11	600887	伊利股份	19,012,989.44	1.77
12	000063	中兴通讯	18,689,558.98	1.74
13	600585	海螺水泥	17,623,975.84	1.64
14	600809	山西汾酒	17,561,818.00	1.63
15	600197	伊力特	17,542,003.48	1.63
16	600999	招商证券	16,874,427.62	1.57
17	601668	中国建筑	16,337,579.00	1.52
18	300115	长盈精密	15,872,882.73	1.48
19	300308	中际旭创	14,496,608.34	1.35
20	600362	江西铜业	13,604,867.50	1.27

注:买入包括二级市场上主动的买入、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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601336	新华保险	42,882,594.88	3.99
2	600703	三安光电	38,838,267.73	3.61
3	002241	歌尔股份	38,331,925.45	3.57
4	002236	大华股份	33,063,621.75	3.08
5	002185	华天科技	28,053,356.48	2.61
6	601318	中国平安	22,167,289.65	2.06
7	002419	天虹股份	21,559,694.80	2.01
8	000786	北新建材	18,828,634.00	1.75
9	600887	伊利股份	18,485,569.18	1.72
10	002074	国轩高科	17,766,546.32	1.65
11	600585	海螺水泥	17,713,845.79	1.65
12	600809	山西汾酒	17,325,651.33	1.61
13	600197	伊力特	17,154,557.80	1.60
14	600999	招商证券	16,793,188.00	1.56
15	300115	长盈精密	15,492,023.00	1.44
16	601668	中国建筑	15,486,424.60	1.44
17	000963	华东医药	14,144,371.40	1.32
18	000063	中兴通讯	13,753,426.30	1.28
19	600116	三峡水利	13,720,751.89	1.28
20	600362	江西铜业	13,202,094.72	1.23

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出

金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,050,777,244.91
卖出股票收入（成交）总额	1,069,659,022.45

注：>买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,788,000.00	6.64
	其中：政策性金融债	39,788,000.00	6.64
4	企业债券	324,375,341.50	54.12
5	企业短期融资券	19,854,000.00	3.31
6	中期票据	207,504,000.00	34.62
7	可转债（可交换债）	37,969,219.44	6.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	629,490,560.94	105.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	170410	17 农发 10	400,000	39,788,000.00	6.64
2	101754034	17 三一 MTN001	300,000	30,165,000.00	5.03
3	101551045	15 五矿股 MTN002	300,000	29,280,000.00	4.89
4	136176	16 绿地 01	300,000	28,890,000.00	4.82
5	101661032	16 南山集 MTN002	300,000	28,713,000.00	4.79

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	249,038.86
2	应收证券清算款	5,163,411.53
3	应收股利	-
4	应收利息	12,677,227.54
5	应收申购款	46,671.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,000.00
9	合计	18,137,349.57

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110034	九州转债	6,019,701.70	1.00
2	128010	顺昌转债	5,868,051.50	0.98

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	6,131,104.00	1.02	重大资产重组

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			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 (%)
南方广利回报债券 A/B	12,821	23,681.21	42,697,976.00	14.06	260,918,843.78	85.94
南方广利回报债券 C	5,314	29,503.19	48,029,580.87	30.64	108,750,373.25	69.36
合计	18,135	25,387.19	90,727,556.87	19.71	369,669,217.03	80.29

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方广利债券 A/B	7,872.14	0.0026
	南方广利债券 C	1,498.98	0.0010
	合计	9,371.12	0.0020

注：：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方广利债券 A/B	南方广利债券 C
基金合同生效日 (2010年11月3日) 基金份额总额	1,615,049,459.34	2,950,578,156.77
本报告期期初基金份额总额	565,816,494.20	283,191,531.16
本报告期基金总申购份额	32,694,442.05	11,653,150.55
减：本报告期基金总赎回份额	294,894,116.47	138,064,727.59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	303,616,819.78	156,779,954.12

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 77,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	752,667,754.23	36.31%	683,995.65	36.19%	
海通证券	1	455,245,903.88	21.96%	418,924.69	22.16%	
国金证券	1	450,988,976.29	21.76%	411,383.64	21.77%	
东北证券	1	413,836,885.78	19.97%	375,751.62	19.88%	

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题

的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	52,425,283.34	6.73%	56,000,000.00	0.15%	-	-
国金证券	169,484,155.59	21.76%	14,285,500,000.00	38.17%	-	-
海通证券	509,185,639.89	65.37%	23,086,000,000.00	61.68%	-	-
华泰证券	47,708,819.55	6.12%	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。