

# 南方广利回报债券型证券投资基金

## 2024 年第 4 季度报告

2024 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：2025 年 1 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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 2025 年 1 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|              |  |            |
|--------------|--|------------|
| 基金简称         | 南方广利回报债券   |            |
| 基金主代码        | 202105   |            |
| 前端交易代码       | 202105   |            |
| 后端交易代码       | 202106   |            |
| 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  |            |
| 报告期末基金份额总额   | 1,668,770,834.92 份   |            |
| 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。   |            |
| 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  | 南方广利回报债券 A/B   | 南方广利回报债券 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 | 202105   |            |

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 码               |                    |                  |
| 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 | 1,550,237,673.25 份 | 118,533,161.67 份 |

### § 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

| 主要财务指标          | 报告期（2024 年 10 月 1 日—2024 年 12 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      | 44,557,909.72                         | 3,435,868.75   |
| 2. 本期利润         | 22,518,396.32                         | 837,590.02     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0126                                | 0.0053         |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,305,971,568.86                      | 180,530,640.07 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4875                                | 1.5230         |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

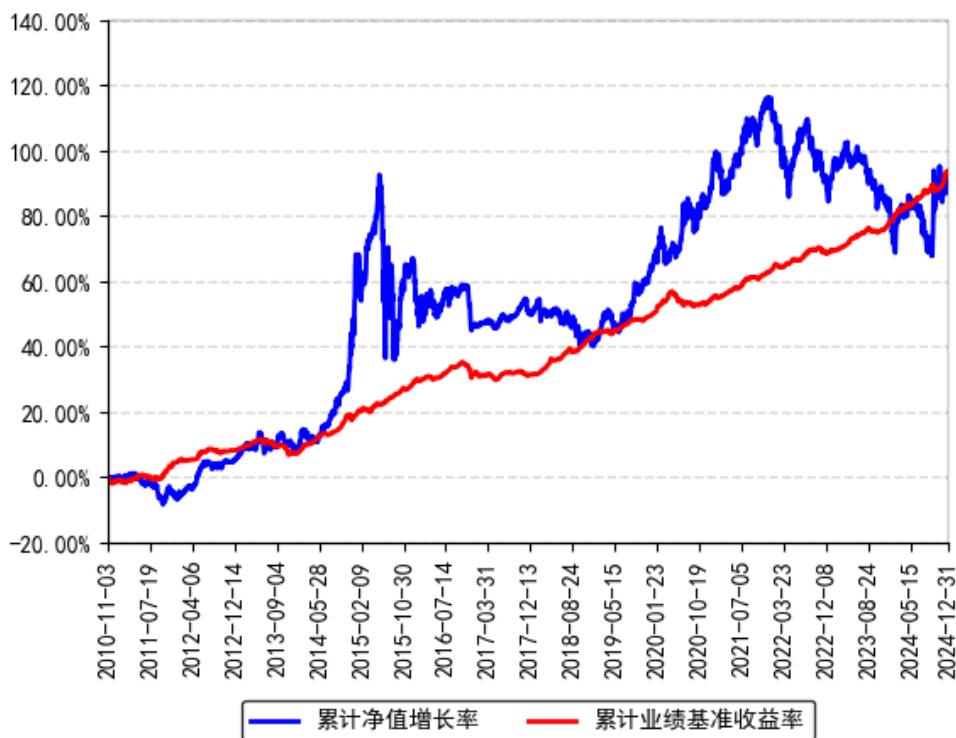
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 0.05%    | 1.17%       | 3.05%      | 0.12%         | -3.00%  | 1.05% |
| 过去六个月      | 2.76%    | 1.09%       | 4.33%      | 0.12%         | -1.57%  | 0.97% |
| 过去一年       | 1.54%    | 0.90%       | 8.83%      | 0.10%         | -7.29%  | 0.80% |
| 过去三年       | -13.01%  | 0.69%       | 18.51%     | 0.08%         | -31.52% | 0.61% |
| 过去五年       | 13.75%   | 0.65%       | 29.02%     | 0.08%         | -15.27% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 88.05%   | 0.73%       | 93.72%     | 0.09%         | -5.67%  | 0.64% |

南方广利回报债券 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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      | -0.06%   | 1.17%       | 3.05%      | 0.12%         | -3.11%  | 1.05% |
| 过去六个月      | 2.55%    | 1.09%       | 4.33%      | 0.12%         | -1.78%  | 0.97% |
| 过去一年       | 1.13%    | 0.90%       | 8.83%      | 0.10%         | -7.70%  | 0.80% |
| 过去三年       | -14.05%  | 0.69%       | 18.43%     | 0.08%         | -32.48% | 0.61% |
| 过去五年       | 11.44%   | 0.65%       | 28.93%     | 0.08%         | -17.49% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 79.43%   | 0.73%       | 93.58%     | 0.09%         | -14.15% | 0.64% |

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

南方广利回报债券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



南方广利回报债券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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 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24日  | -    | 12年    | 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26日至2015年8月20日，任南方永利基金经理助理；2015年12月11日至2017年2月24日，任南方弘利基金经理；2015年12月30日至2017年5月5日，任南方安心基金经理；2016年11月8日至2018年2月2日，任南方荣发基金经理；2016年11月11日至2018年2月9日，任南方卓元基金经理；2017年5月5日至2018年7月27日，任南方和利基金经理；2017年5月19日至2018年7月27日，任南 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 方和元基金经理；2017 年 5 月 23 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方纯元基金经理 2017 年 6 月 16 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方高元基金经理；2017 年 8 月 3 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方祥元基金经理 2017 年 9 月 12 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方兴利基金经理 2016 年 7 月 6 日至 2019 年 7 月 5 日，任南方甄智混合基金经理 2015 年 8 月 20 日至 2020 年 9 月 23 日，任南方永利基金经理 2019 年 7 月 5 日至 2021 年 3 月 25 日，任南方甄智混合基金经理；2021 年 4 月 9 日至 2021 年 6 月 4 日，任南方荣欢、南方荣发基金经理 2019 年 7 月 19 日至 2022 年 2 月 24 日，任南方旭元基金经理 2021 年 5 月 7 日至 2022 年 7 月 22 日，任南方晖元 6 个月持有期债券基金经理 2022 年 7 月 22 日至 2023 年 11 月 27 日，任南方荣尊基金经理；2020 年 5 月 28 日至 2023 年 12 月 1 日，任南方招利一年债券基金经理；2016 年 6 月 24 日至今，任南方广利基金经理 2018 年 3 月 14 日至今，任南方希元转债基金经理；2019 年 3 月 29 日至今，任南方多元基金经理；2020 年 2 月 14 日至今，任南方宁利一年债券基金经理；2020 年 3 月 6 日至今，任南方昌元转债基金经理 2022 年 9 月 16 日至今，任南方耀元债券基金经理；2024 年 6 月 28 日至今，任南方多利、南方达元债券基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 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、中国证监会和本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利益。本报告期内，本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 公平交易专项说明

### 4.3.1 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。

### 4.3.2 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 49 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年四季度，随着一系列增量政策组合拳落地见效，国内经济增长企稳回升，一线城市房地产成交活跃度明显抬升，受益消费品以旧换新政策的行业景气度向好，但生产偏强、预期偏弱的背景下价格信号回升不明显；海外方面，美联储延续降息周期但未来指引偏鹰，美国大选共和党获胜，新总统政策不确定较大，给市场带来较大扰动。债市方面，在降准降息的预期和赚钱效应带来的资金正反馈推动下，债券收益率大幅下行，利率债表现好于同期限信用债；权益方面，市场成交活跃、指数宽幅震荡，10-11 月科技成长表现亮眼，年末红利板块表现突出；转债方面，低价转债估值系统性修复，平衡型和偏股型转债估值回升相对克制，新券体现出较强的涨跌不对称性。组合操作方面，债券部分主要获取信用债持有收益，保持了较好的持仓流动性，股票和转债部分重点在科技、内需等方向挖掘投资机会，转债积极关注新券上市、老券下修完成等阶段的配置机会，大盘转债在临近强制赎回的区域择机止盈。

展望 2025 年上半年，国内方面，12 月政治局会议和中央经济工作会议定调积极，加强超常规逆周期调节，央行择机降准降息，稳住股市楼市，关注物价合理回升，强调各项工作能早则早、抓紧抓实，我们乐观看待开年经济表现；海外方面，密切关注美国新总统上任之后的政策动向，尤其是其对美联储降息节奏的影响以及其贸易政策对全球经济走势的影响。债市方面，跨年行情收益率大幅下行透支了大部分潜在降息空间，未来可能进入低收益率、高波动的环境，需要进一步提升组合流动性，警惕踩踏式调整的风险，灵活调整债券仓位和久期；权益方面，积极看待开年增量政策落地节奏和效果，12 月以来债强股弱使得国内权益资产的吸引力升至较高水平，市场估值已经反应了较多海外贸易冲突的悲观预期，未来整体调整空间有限，看好市场逐步迎来春季行情；可转债方面，低价转债修复基本完成，未来的市场机会主要集中在偏股型和平衡型品种当中，同时关注一批大盘转债强制赎回之后资金再平衡带来的影响。组合操作方面，债券部分提升持仓流动性，做好应对市场波动的准备；

权益和转债部分积极关注调整之后的投资机会，重点在景气加速上行的科技和景气反转向上的内需板块寻找投资机会，同时关注潜在贸易冲突利空落地之后出海方向的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A/B 份额净值为 1.4875 元，报告期内，份额净值增长率为 0.05%，同期业绩基准增长率为 3.05%；本基金 C 份额净值为 1.5230 元，报告期内，份额净值增长率为-0.06%，同期业绩基准增长率为 3.05%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 495,154,286.68   | 16.44        |
|    | 其中：股票             | 495,154,286.68   | 16.44        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 2,446,546,232.86 | 81.21        |
|    | 其中：债券             | 2,446,546,232.86 | 81.21        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 17,795,949.89    | 0.59         |
| 8  | 其他资产              | 53,172,850.91    | 1.76         |
| 9  | 合计                | 3,012,669,320.34 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -       | -            |



|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | -              | -     |
| C | 制造业              | 390,009,421.96 | 15.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -     |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 19,674,905.00  | 0.79  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 56,519,164.72  | 2.27  |
| J | 金融业              | -              | -     |
| K | 房地产业             | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 16,594,315.00  | 0.67  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 12,356,480.00  | 0.50  |
| 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               | 495,154,286.68 | 19.91 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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  | 600584 | 长电科技 | 1,279,266 | 52,270,808.76 | 2.10         |
| 2  | 300054 | 鼎龙股份 | 1,860,900 | 48,420,618.00 | 1.95         |
| 3  | 002179 | 中航光电 | 863,400   | 33,931,620.00 | 1.36         |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 702,200   | 28,621,672.00 | 1.15         |
| 5  | 300395 | 菲利华  | 727,300   | 27,353,753.00 | 1.10         |
| 6  | 600765 | 中航重机 | 1,244,500 | 25,474,915.00 | 1.02         |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 814,295   | 24,998,856.50 | 1.01         |
| 8  | 688692 | 达梦数据 | 67,992    | 24,779,004.48 | 1.00         |
| 9  | 300408 | 三环集团 | 639,800   | 24,638,698.00 | 0.99         |
| 10 | 000997 | 新大陆  | 1,229,000 | 24,518,550.00 | 0.99         |

### 5.4 报告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（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 406,229,635.63   | 16.34        |
|    | 其中：政策性金融债 | 132,670,950.69   | 5.34         |
| 4  | 企业债券      | 93,608,591.78    | 3.76         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 263,336,181.10   | 10.59        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,683,371,824.35 | 67.70        |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 2,446,546,232.86 | 98.39        |

## 5.5 报告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

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（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 282380005 | 23 太平人寿永续债 01 | 1,500,000 | 157,349,342.47 | 6.33         |
| 2  | 110081    | 闻泰转债          | 994,540   | 113,214,618.92 | 4.55         |
| 3  | 127084    | 柳工转 2         | 639,588   | 106,034,403.23 | 4.26         |
| 4  | 113615    | 金诚转债          | 222,890   | 75,099,555.12  | 3.02         |
| 5  | 200212    | 20 国开 12      | 700,000   | 71,900,336.99  | 2.89         |

## 5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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

无。

## 5.8 报告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

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 356,718.02    |
| 2  | 应收证券清算款 | 52,800,403.88 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | 15,729.01     |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 53,172,850.91 |

#### 5.11.4 报告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（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|----------------|--------------|
| 1  | 110081 | 闻泰转债    | 113,214,618.92 | 4.55         |
| 2  | 127084 | 柳工转 2   | 106,034,403.23 | 4.26         |
| 3  | 113615 | 金诚转债    | 75,099,555.12  | 3.02         |
| 4  | 113641 | 华友转债    | 68,224,386.22  | 2.74         |
| 5  | 118013 | 道通转债    | 59,261,542.10  | 2.38         |
| 6  | 113675 | 新 23 转债 | 57,575,787.40  | 2.32         |
| 7  | 113666 | 爱玛转债    | 55,940,433.28  | 2.25         |
| 8  | 123169 | 正海转债    | 51,028,419.53  | 2.05         |
| 9  | 113061 | 拓普转债    | 50,672,692.69  | 2.04         |
| 10 | 127101 | 豪鹏转债    | 49,796,021.20  | 2.00         |
| 11 | 127100 | 神码转债    | 49,284,477.49  | 1.98         |
| 12 | 118030 | 睿创转债    | 49,263,434.79  | 1.98         |
| 13 | 123176 | 精测转 2   | 49,255,177.00  | 1.98         |
| 14 | 113637 | 华翔转债    | 42,939,639.37  | 1.73         |
| 15 | 123161 | 强联转债    | 37,385,927.08  | 1.50         |
| 16 | 127073 | 天赐转债    | 37,273,704.59  | 1.50         |
| 17 | 123222 | 博俊转债    | 36,952,004.17  | 1.49         |
| 18 | 110074 | 精达转债    | 36,787,685.45  | 1.48         |
| 19 | 118035 | 国力转债    | 34,482,697.01  | 1.39         |
| 20 | 113669 | 景 23 转债 | 34,368,648.77  | 1.38         |
| 21 | 127092 | 运机转债    | 33,015,333.29  | 1.33         |
| 22 | 127037 | 银轮转债    | 32,686,462.77  | 1.31         |
| 23 | 113056 | 重银转债    | 32,090,509.18  | 1.29         |
| 24 | 127076 | 中宠转 2   | 29,868,326.34  | 1.20         |
| 25 | 123194 | 百洋转债    | 28,954,379.60  | 1.16         |
| 26 | 113632 | 鹤 21 转债 | 25,589,869.10  | 1.03         |
| 27 | 118021 | 新致转债    | 25,355,797.57  | 1.02         |
| 28 | 127091 | 科数转债    | 25,068,624.12  | 1.01         |
| 29 | 118024 | 冠宇转债    | 24,848,367.83  | 1.00         |
| 30 | 111011 | 冠盛转债    | 24,576,577.89  | 0.99         |
| 31 | 127104 | 姚记转债    | 23,904,955.01  | 0.96         |
| 32 | 128109 | 楚江转债    | 23,413,368.16  | 0.94         |
| 33 | 123127 | 耐普转债    | 22,671,394.83  | 0.91         |
| 34 | 123145 | 药石转债    | 16,605,906.92  | 0.67         |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 35 | 123223 | 九典转 02 | 13,482,146.59 | 0.54 |
| 36 | 110082 | 宏发转债   | 12,834,980.45 | 0.52 |
| 37 | 118037 | 上声转债   | 11,428,654.78 | 0.46 |
| 38 | 127043 | 川恒转债   | 7,114,549.73  | 0.29 |
| 39 | 113582 | 火炬转债   | 6,350,511.88  | 0.26 |
| 40 | 113634 | 珀莱转债   | 6,081,734.42  | 0.24 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 南方广利回报债券 A/B     | 南方广利回报债券 C     |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,115,398,432.59 | 214,206,534.79 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 247,674,327.26   | 1,376,412.76   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 812,835,086.60   | 97,049,785.88  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 1,550,237,673.25 | 118,533,161.67 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |              |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|-------|----------------|--------------|------|------|------|------------|------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |

|    |   |                   |                |   |                |                |        |
|----|---|-------------------|----------------|---|----------------|----------------|--------|
|    |   | 超过 20% 的时间区间      |                |   |                |                |        |
| 机构 | 1 | 20241001-20241107 | 608,437,630.40 | - | 316,990,227.37 | 291,447,403.03 | 17.46% |

**产品特有风险**

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

**8.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§ 9 备查文件目录****9.1 备查文件目录**

- 1、《南方广利回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方广利回报债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方广利回报债券型证券投资基金 2024 年 4 季度报告原文。

**9.2 存放地点**

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

**9.3 查阅方式**

网站：<http://www.nffund.com>