

南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF） 二次清算报告

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

报告编制日：2021 年 1 月 15 日

报告送出日：2021 年 2 月 4 日

一、基金情况

(一) 基本信息

1、基本信息

基金简称	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF)	
场内简称	南方永利	
基金主代码	160130	
交易代码	160130	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 4 月 25 日	
投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上, 力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础, 结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析, 在非开放期期间原则上组合久期与初始非开放期适当匹配的基础上, 实施积极的债券投资组合管理, 以获取较高的债券组合投资收益。	
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率+1.2%。	
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	
上市日期	2013 年 6 月 6 日	
下属分级基金的基金简称	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	南方永利	
下属分级基金的交易代码	160130	160132

2、基金运作情况

南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2013]124 号《关于核准南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准, 由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,531,624,309.74 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 206 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2013 年 4 月 25 日

正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,535,978,820.58 份，其中认购资金利息折合 4,354,510.84 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]183 号审核同意，本基金 17,785,193.00 份基金份额于 2013 年 6 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。经深交所深证上[2020]867 号审核同意，本基金自 2020 年 9 月 24 日起终止上市。

（二）、清算原因

根据《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2020 年 9 月 17 日发布的《关于南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》和于 2020 年 11 月 4 日发布的《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)清算报告》，本基金的最后运作日为 2020 年 9 月 23 日，第一次清算期间为自 2020 年 9 月 24 日(基金最后运作日次日)至 2020 年 11 月 4 日止期间。截至 2020 年 11 月 4 日止，本基金交易性金融资产余额 920,620.96 元，为尚处于锁定期而流通受限股票投资。该股票于 2021 年 1 月 12 日前完成变现，因此本基金进行第二次清算。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和北京金诚同达（深圳）律师事务所于 2020 年 9 月 24 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，北京金诚同达（深圳）律师事务所对清算报告出具法律意见。

（三）二次清算起始日及清算期间

本基金二次清算起始日为 2020 年 11 月 5 日（第一次清算期结束次日），二次清算期为 2020 年 11 月 5 日至 2021 年 1 月 15 日（基金第二次清算结束日）。

二、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起, 所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量, 负债以预计需要清偿的金额计量, 其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。自 2020 年 9 月 24 日 (基金最后运作日次日) 起, 本基金进入清算程序, 因此本基金财务报表以清算基础编制。

三、财务报告

资产负债表

会计主体: 南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2021 年 1 月 15 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2021 年 1 月 15 日 (基金第二次清算结束日)
资产:	
银行存款	803,415.08
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中: 股票投资	-
债券投资	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	30.99
资产总计	803,446.07
负债:	
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	30,000.00
负债合计	30,000.00
所有者权益:	
实收基金	670,025.97

未分配利润	103,420.10
所有者权益合计	773,446.07
负债和所有者权益总计	803,446.07

四、清算情况

自 2020 年 11 月 5 日（第一次清算期结束次日）至 2021 年 1 月 15 日（基金第二次清算结束日）止为本基金二次清算报告期，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

- 1、 本基金持仓的流通受限股票中石科技（300684）于 2021 年 1 月 11 日正式流通，持仓数量为 34,978.00 股，于 2021 年 1 月 12 日前全部变现，清算金额为 773,778.46 元。
- 2、 本次清算结束日账面应收利息 30.99 元，预计于 2021 年 3 月 20 日划回托管户。
- 3、 本基金二次清算期因投资变现产生的应付佣金 705.96 元，上述款项已于 2021 年 1 月 14 日支付。
- 4、 其他负债 30,000.00 元系一次清盘时因应收未收款项而从基金管理人借入的资金，该款项预计于本次清算资金分配完成后，归还基金管理人。

（四）清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	清算报告期间 2020 年 11 月 5 日至 2021 年 1 月 15 日
一、收入	-138,267.51
1、利息收入	7,731.83
其中：存款利息收入	7,731.83
债券利息收入	
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	
其他利息收入	
2、投资收益（损失以“-”填列）	-225,399.40
其中：股票投资收益	-225,399.40
基金投资收益	
债券投资收益	
股利收益	

3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	79,400.06
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	
5、其他收入（损失以“-”填列）	
二、费用	1,619.12
1、管理人报酬	
2、托管费	
3、受托费	
4、销售服务费	
5、投资顾问费	
6、交易费用	1,549.12
7、利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
8、税金及附加	
9、其他费用（注）	70.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	-139,886.63
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-139,886.63

注：其他费用为银行汇划费和银行间账户维护费。

（五）二次清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、首次清算结束日（2020年11月4日）基金净资产	40,367,479.99
加：清算报告期间净收益	-139,886.63
减：一次清算金额	39,454,147.29
二、二次清算结束日（2021年1月15日）基金净资产	773,446.07

资产处置及负债清偿后，截止本基金二次清算报告期结束日2021年1月15日（报告编制日），本基金剩余财产为773,446.07元。自本次清算期结束日次日2021年1月16日至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

（六）基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

（1）南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）2020 年 9 月 24 日（基金最后运作日次日）至 2021 年 1 月 15 日（基金第二次清算结束日）止期间的财务报表及审计报告；

（2）《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

基金财产清算小组

2021 年 1 月 15 日