

南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 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：中国银行股份有限公司

报告出具日：2021 年 06 月 25 日

送出日期：2021 年 07 月 08 日

一、基金情况

(一)、基本信息

1、基本信息

基金名称	南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	南方聚利 1 年定期开放债券 (LOF)	
基金主代码	160131	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 28 日	
最后运作日基金份额总额	20,011,205.23 份	
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, 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	1 年期银行定期存款利率(税后)+1.2%	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方聚利 A	南方聚利 C
下属分级基金的交易代码	160131	160134
最后运作日下属分级基金的份额总额	17,845,334.02	2,165,871.21

2、基金运作情况

南方聚利 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]1200 号《关于核准南方聚利 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 (原南方基金管理有限公司, 已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方聚利 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 294, 413, 958.04 元, 业经普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) 普华永道中天验字 (2013) 第 737 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2013 年 11 月 28 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 294, 507, 714.36 份, 其中认购资金利息折合 93, 756.32 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, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定, 本基金自基金合同生效后, 每年开放一次申购和赎回。封闭期内, 投资者不能申购和赎回基金份额, 但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。开放期内, 投资人可进行基金份额的申购和赎回, 也可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上 [2014]18 号审核同意, 本基金 21, 776, 664. 00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 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。

根据《关于南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 增加收费模式并修改基金合同的公告》, 自 2014 年 12 月 1 日起, 本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用的称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存, 并分别计算基金份额净值。A 类基金份额通过场外和场内两种方式销售, 场内份额在交易所上市交易; C 类基金份额通过场外方式销售, 不在交易所上市交易。未上市交易的份额托管在场外, 其中 A 类基金份额可跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通, C 类基金份额不能进行跨系统转托管至场内。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。在开放期, 本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 在非开放期, 本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为: 一年期银行定期存款收益率 (税后)+1. 2%。

根据《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、南方基金管理股份有限公司于 2021 年 6 月 11 日发布的《关于南方聚利 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》以及于 2021 年 6 月 15 日发布的《关于南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 终止上市的公告》, 本基金自 2021 年 6 月 12 日起进入基金财产清算程序, 并自 2021 年 6 月 18 日起终止上市。

(二)、清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金符合《基金合同》约定的合同终止情形, 南方基金管理股份有限公司作为南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 的基金管理人, 经与基金托管人协商一致后, 根据《基金合同》的约定组织基金财产清算小组对本基金进行清算。本基金管理人于 2021 年 6 月 11 日发布《关于南方聚利债券基金 (LOF) 基金合同终止及基金财产清算的公告》, 本基金以 2021 年 6 月 11 日为最后运作日, 自 2021 年 6 月 12 日 (最后运作日的次日) 起进入清算程序。

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) 和上海市通力律师事务所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, 上海市通力律师事务所清算报告出具法律意见。

(三)、最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为 2021 年 06 月 11 日, 清算期为 2021 年 06 月 12 日至 2021 年 06 月 25 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。由于报告性质所致, 本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

三、财务报告

资产负债表

会计主体: 南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2021 年 06 月 11 日

资产	本期末 2021 年 06 月 11 日
----	----------------------

资产：	
银行存款	9,221,028.82
结算备付金	16,953.69
存出保证金	2,075.17
交易性金融资产	12,601,910.40
其中：股票投资	0.00
债券投资	12,601,910.40
买入返售金融资产	0.00
应收证券清算款	0.00
应收利息	325,472.46
资产总计	22,167,440.54
负债和所有者权益	
负债：	
应收申购款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	1,331,132.52
应付管理人报酬	5,372.83
应付托管费	1,535.11
应付销售服务费	370.08
应付交易费用	-6,986.12
应交税费	4.78
其他负债	54,300.00
负债合计	1,385,729.20
所有者权益：	0.00
实收基金	20,011,205.23
未分配利润	770,506.11
所有者权益合计	20,781,711.34
负债和所有者权益总计	22,167,440.54

注：1. 报告截止日2021年06月11日(基金最后运作日)，基金份额总额20,011,205.23份，其中南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）A类基金份额总额为17,845,334.02份，基金份额净值1.039元；南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）C类基金份额总额为2,165,871.21份，基金份额净值1.031元

四、清算情况

自2021年06月12日至2021年06月25日止为本基金清算报告期，基金财产清算小组按照法律法规及《南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）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：

（一）、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。根据本基金的基金合同，本基金的清算费用由基金管理人承担。其中包括：律师费10,000元，审计费13,000元。

（二）、最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日结算备付金16,953.69元，结算保证金为2,075.17元，该款项将按照结算规则，逐步划回托管户。

2、本基金最后运作日应收活期存款利息为3,273.89元，应收结算备付金利息为2,272.53元，应收结算保证金利息为3.78元；上述款项已于2021年6月21日季度结息日划至基金托管户。

3、本基金最后运作日本基金持有的交易性金融资产-债券投资为12,601,910.40元该资产已于2021年6月18日前全部卖出，清算金额已全部划入基金托管户。

（三）、最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理费为5,372.83元，应付托管费为1,535.11元，应付销售服务费为370.08元，该款项已于2021年6月21日支付。

2、本基金最后运作日应付税费为4.78元，该款项已于2021年6月21日支付。

3、本基金最后运作日应付银行间相关交易费用合计为10,850元，该款项已于已于2021年6月22日前支付，银行间销户工作已经处理完毕。

4、本基金最后运作日应付券商佣金为-8,536.12元，该款项预计在未来收回。

5、本基金最后运作日应付信息披露费为 15,000 元，该款项已于 2021 年 6 月 21 日支付。

6、本基金最后运作日应付上市费为 30,000 元，该款项已于 2021 年 6 月 21 日支付。

（四）、停止运作后的清算损益情况说明

项目	清算报告期间：2021年06月12日至2021年06月25日
一、收入	2,891.68
1.利息收入	6,867.87
其中：存款利息收入	2,346.85
债券利息收入	4,521.02
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产收入	0.00
证券出借利息收入	0.00
其他利息收入	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）	-15,858.21
其中：股票投资收益	0.00
基金投资收益	0.00
债券投资收益	-15,858.21
衍生工具收益	0.00
股利收益	0.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,882.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5.其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
二、费用	272.73
1.管理人报酬	0.00
2.托管费	0.00
3.受托费	0.00
4.销售服务费	0.00
5.投资顾问费	0.00
6.交易费用	177.60
7.利息支出	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00
8.税金及附加	0.13
9.其他费用	95.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	2,618.95
减：所得税费用	0.00
四、净利润（净亏损以“-”填列）	2,618.95

（五）、剩余资产分配情况说明

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 06 月 11 日基金净资产	20,781,711.34
加：清算报告期间净收益	2,618.95
减：赎回金额（含费用）	0.00
二、2021 年 06 月 25 日基金净资产	20,784,330.29

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日 2021 年 06 月 25 日，本基金剩余财产为 20,784,330.29 元。自本次清算期结束日次日 2021 年 06 月 26 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

（一）、备查文件目录

（1）南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）2021年01月01日至2021年06月11日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

（2）关于南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）清算的法律意见书。

（二）、存放地点

基金管理人的办公场所。

（三）、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。

金财产清算小组

2021 年 06 月 25 日