南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金二次清算报告

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告编制日：2021 年 09 月 29 日

报告送出日：2021 年 10 月 28 日

一、基金情况

（一）、基本信息

1、基本信息

基金简称	南方荣发定期开放混合发起
基金主代码	003332
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 8 日
基金二次清算结束日（2021 年 09 月 29 日）基金份额总额	933,931.03 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。2、股票投资策略本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向，努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值水平，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。3、债券投资策略在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。本基金投资于中

	小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。4、权证投资策略本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。5、资产支持证券投资策略资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。6、开放期投资策略本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%＋中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

2、基金运作情况

南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2016]1267 号《关于准予南方荣发定期开

放混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，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《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》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 509,999,790.52 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(2016)第 1449 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 509,999,790.52 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金自基金合同生效后，每三个月开放一次申购和赎回。每个开放期为基金合同生效日所在月份在后续每 3 个日历月之后下一月的前 5 个工作日。在此期间，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额。

根据《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2021 年 6 月 4 日发布的《关于南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》和于 2021 年 7 月 1 日发布的《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金清算报告》，本基金的最后运作日为 2021 年 6 月 4 日，第一次清算期间为自 2021 年 6 月 5 日(基金最后运作日次日)至 2021 年 6 月 23 日止期间。

本基金于 2021 年 6 月 24 日起进入第二次清算期间，至 2021 年 9 月 29 日止第二次清算结束。

（二）、清算原因

根据《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、基金管理人于 2021 年 6 月 4 日发布的《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》和于 2021 年 7 月 1 日发布的《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金清算报告》，本基金的基金最后运作日为 2021 年 06 月 04 日，第一次清算期间为自 2021 年 06 月 05 日至 2021 年 06 月 23 日止期间。截至 2021 年 06 月 23 日止，本基金交易性金融资产市值为 1,174,733.43 元，为处于锁定期内而无法卖出的股票投资，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）律师事务所已于 2021 年 6 月 4 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2021年06月24日，二次清算期为2021年06月24日至2021年09月29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2021年06月05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

单位：人民币元

资产负债表

会计主体：南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年09月29日

资产	本期末2021年09月29日
资产：	
银行存款	1,014,773.07
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	2,677.02
应收利息	160.94
资产总计	1,017,611.03
负债和所有者权益	
负债：	
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
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	731.33
应交税费	-
其他负债	-
负债合计	731.33
所有者权益：	
实收基金	933,931.03
未分配利润	82,948.67
所有者权益合计	1,016,879.70
负债和所有者权益总计	1,017,611.03

注：报告截止日 2021 年 09 月 29 日（基金第二次清算结束日），基金份额总额 933,931.03 份，基金份额净值为 1.089 元。

四、清算情况

自 2021 年 06 月 24 日至 2021 年 09 月 29 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：

截至基金第二次清算结束日（2021 年 09 月 29 日），各项资产负债清算情况如下 ：

1、本基金第一次清算结束日持有交易性金融资产 1,174,733.43 元，已于 2021 年 9 月 30 日前卖出，收回金额合计人民币 801,664.30 元。

2、本基金第二次清算结束日账面应收利息 160.94 元，预计于 2021 年 12 月 21 日划回托管户。

3、本基金第二次清算期因投资变现产生的应付佣金 731.33 元，上述款项已于 2021 年 10 月 13 日支付。

4、本基金第一次清算结束日结算备付金为 6,851 元，保证金为 207,217 元，该金额按照结算规则于 2021 年 9 月 2 日前逐步划回托管户。

5、本基金第一次清算结束日应收上海、深圳备付金利息合计为 0.62 元，应收上海、深圳保证金利息为 18.66 元，应收银行存款利息为 74.8 元，该金额于 2021 年 9 月 22 日划回托管户。

（一）、清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	清算报告期间：2021 年 06 月 24 日至 2021 年 09 月 29 日
一、收入	-370,410.73
1.利息收入	1,676.58
其中：存款利息收入	1,676.58
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	-
证券出借利息收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	582,504.39
其中：股票投资收益	582,396.32
基金投资收益	-
债券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	108.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-954,591.70
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
二、费用	1,605.08
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	1,605.08

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	-
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	-372,015.81
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-372,015.81

（二）、剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、首次清算结束日 2021 年 06 月 23 日基金净资产	3,243,563.35
加：清算报告期间净收益	-372,015.81
减：赎回金额（含费用）	1,854,667.84
二、2021 年 09 月 29 日基金净资产	1,016,879.70

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 09 月 29 日，本基金剩余财产为 1,016,879.70 元。自本次清算期结束日次日 2021 年 09 月 30 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。

（三）、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）南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年 06 月 5 日至 2021 年 09 月 29 日止期间的财务报表及审计报告；

（2）《南方荣发定期开放混合型发起式证券投资基金二次清算报告》的法律意见。

（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。

南方荣发定期开放混合型发起式证券

投资基金财产清算小组

2021 年 09 月 29 日