

南方固元 6 个月持有期债券型证券投资基金 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：兴业银行股份有限公司

报告出具日：2023 年 03 月 01 日

报告送出日：2023 年 03 月 27 日

一、基金情况

(一)、基本信息

1、基本信息

基金名称	南方固元 6 个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	南方固元 6 个月持有债券	
基金主代码	014613	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 30 日	
最后运作日基金份额总额	6,101,815.15 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	本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求将信用风险降到最低，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。具体投资策略包括：1、信用债投资策略；2、收益率曲线策略；3、放大策略；4、资产支持证券投资策略；5、国债期货投资策略；6、可转换债券和可交换债券投资策略；7、信用衍生品投资策略等。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方固元 6 个月持有债券 A	南方固元 6 个月持有债券 C
下属分级基金的交易代码	014613	014614
最后运作日下属分级基金的份额总额	2,296,826.30	3,804,988.85

2、基金运作情况

南方固元6个月持有期债券型证券投资基金(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[2021]3749号《关于准予南方固元6个月持有期债券型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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方固元6个月持有期债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集201,912,351.37元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(22)第00310号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《基金合同》于2022年6月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,964,633.09份,其中认购资金利息折合52,281.72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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方固元6个月持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围包括债券(包括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、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金投资可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证可转换债券指数收益率 \times 10%+中债综合指数收益率 \times 90%。

根据《基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于2023年2月22日发布的《关于南方固元6个月持有期债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金自2023年2月23日起进入基金财产清算程序。

(二)、清算原因

根据《基金合同》“第五部分基金备案”中的约定：“《基金合同》生效后，连续30个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于1亿元情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。”本基金的基金合同生效日为2022年6月30日，截至2023年2月21日，本基金基金资产净值已连续30个工作日低于1亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的自动终止情形。本基金管理人于2023年2月22日发布《关于南方固元6个月持有期债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（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，并由德勤华永会计师事务所（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对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2023年2月22日，清算期为2023年02月23日至2023年03月01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：南方固元6个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2023年02月22日

单位：人民币元

资产	本基金最后运作日为2023年02月22日
银行存款	21,609,065.78
结算备付金	770,638.68
存出保证金	33,427.66
交易性金融资产	11,593,337.28

其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	11,593,337.28
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
应收清算款	13,696,387.33
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	47,702,856.73
负债和净资产	本基金最后运作日为 2023 年 02 月 22 日
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	41,461,784.33
应付管理人报酬	6,023.93
应付托管费	1,505.97
应付销售服务费	750.16

应付投资顾问费	-
应交税费	1,225.57
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	44,554.45
负债合计	41,515,844.41
实收基金	6,101,815.15
其他综合收益	-
未分配利润	85,197.17
净资产合计	6,187,012.32
负债和净资产总计	47,702,856.73

注：本基金最后运作日 2023 年 2 月 22 日，南方固元 6 个月持有债券 A 份额净值人民币 1.0146 元，基金份额总额 2,296,826.30 份；南方固元 6 个月持有债券 C 份额净值人民币 1.0136 元，基金份额总额 3,804,988.85 份；总份额合计 6,101,815.15 份。

四、清算情况

自 2023 年 02 月 23 日至 2023 年 03 月 01 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《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。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

（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 770,638.68 元，存出保证金为 33,427.66 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证券清算款为 13,696,387.33 元，该款项于 2023 年 02 月 23 日划入托管户。

3、本基金最后运作日持有的交易性金融资产-债券投资为 11,593,337.28 元,该资产已于 2023 年 02 月 28 日前全部卖出,清算金额为 11,630,849.72 元,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 6,023.93 元,应付托管费为 1,505.97 元,应付销售服务费为 750.16 元,该款项已于 2023 年 02 月 28 日支付。

2、本基金最后运作日应付税费为 1,225.57 元,该款项已于 2023 年 02 月 28 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 14,554.45 元,该款项已于 2023 年 3 月 17 日前支付。

4、本基金最后运作日应付赎回款为 41,461,784.33 元,该款项已于 2023 年 02 月 28 日前划付。

5、本基金最后运作日账面预提 2022 年基金年度审计费为 30,000.00 元。基金清算工作预计在 2023 年 03 月 31 前完成,因此无需本基金聘请的德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)出具 2022 年年度审计报告,年度审计调整为清算审计,年度审计费已于清算期间从账面冲回,从保护基金份额持有人利益的角度出发,清算审计费由基金管理人承担。

(四) 清算期间的清算损益情况说明

单位:人民币元

项目	清算报告期间: 2023 年 02 月 23 日至 2023 年 03 月 01 日
一、营业总收入	37,873.03
1.利息收入	360.69
其中:存款利息收入	360.69
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)	37,512.34
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-

债券投资收益	37,512.34
衍生工具收益	-
股利收益	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	-28,845.20
1.管理人报酬	-
2.托管费	-
3.销售服务费	-
4.投资顾问费	-
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.信用减值损失	-
7.税金及附加	-
8.其他费用	-28,845.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	66,718.23
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	66,718.23
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	66,718.23

（五）剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 02 月 22 日基金净	6,187,012.32

资产	
加：清算报告期间净收益	66,718.23
减：赎回金额（含费用）	4,318,012.06
二、2023 年 03 月 01 日基金净资产	1,935,718.49

截止本基金清算期结束日（2023 年 03 月 01 日），本基金剩余财产为 1,935,718.49 元，其中包含了备付金 766,578.15 元、保证金 33,438.16 元。自本次清算期结束日次日（2023 年 03 月 02 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）南方固元 6 个月持有期债券型证券投资基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 02 月 22 日（最后运作日）止期间的财务报表及清算审计报告；

（2）《南方固元 6 个月持有期债券型证券投资基金清算报告》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。

南方固元 6 个月持有期债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2023 年 03 月 01 日

