

## 南方沪港深价值主题灵活配置混合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：招商银行股份有限公司**

**报告出具日：2021年4月16日**

**报告送出日：2021年5月10日**

## 一、基金简介

### (一) 基本情况

#### 1. 基本信息

基金简称	南方沪港深价值主题灵活配置混合
基金主代码	001979
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月23日
最后运作日基金份额总额	32,669,854.70份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金对各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,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。</p> <p>2、股票投资策略 本基金动态界定“价值主题”相关主题,定性分析和定量分析相结合,评估分析组合股票的投资吸引力,构建与优化投资组合,并关注发掘“港股通”机制下的个股投资机会。</p> <p>3、其他标的投资策略 在寻求债券、权证、股指期货等已知标的投资机会之外,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
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。本基金可投资港股通标的股票,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

## 2.基金运作情况

南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]2302号《关于准予南方沪港深价值主题灵活配置混合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(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《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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545,468,616.49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(2015)第1438号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年12月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为545,661,847.64份,其中认购资金利息折合193,231.15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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通标的股票”)、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、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、权证、股指期货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相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,其中投资于本基金定义的“价值主题”范畴内的证券不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 60%+上证国债指数收益率 $\times$ 40%。

### (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《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于2021年3月4日发布的《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金自2021年3月5日起进入基金财产清算程序。

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）和北京金诚同达（深圳）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，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）最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为 2021 年 3 月 4 日，清算期为 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 16 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：南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 3 月 4 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2021 年 3 月 4 日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	17,989,868.27
结算备付金	205,655.65
存出保证金	275.32
交易性金融资产	14,950,636.54
其中：股票投资	14,950,636.54
应收证券清算款	5,184,435.65
应收利息	10,557.67
应收股利	-
应收申购款	-
资产总计	38,341,429.10
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	192,090.80
应付管理人报酬	7,870.04

应付托管费	1,311.68
应付交易费用	50,152.58
其他负债	152,843.02
负债合计	404,268.12
所有者权益：	
实收基金	32,669,854.70
未分配利润	5,267,306.28
所有者权益合计	37,937,160.98
负债和所有者权益总计	38,341,429.10

注：报告截止日 2021 年 3 月 4 日，基金份额净值 1.161 元，基金份额总额 32,669,854.70 份。

#### 四、清算情况

自 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 4 月 16 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。根据本基金的基金合同，本基金的清算费用由基金承担。其中包括：审计费 5000 元、律师费 18000 元、公证费 10000 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 205,655.65 元, 该款项于 2021 年 3 月 5 日划回至托管户；结算保证金为 275.32 元,该款项将按照中登结算规则，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 7,513.65 元，该款项于 2021 年 3 月 21 日结息划回至托管户；应收结算备付金利息为 2,303.73 元,应收结算保证金利息为 740.29 元，上述款项于 2021 年 3 月 22 日结息划回至托管户。

3、本基金最后运作日，深港通证券清算款为 5,184,435.65 元,该款项于 2021 年 3 月 8 日划入基金托管户。

4、本基金最后运作日,本基金持有的交易性金融资产-股票投资为 14,950,636.54 元,该资产已于 2021 年 4 月 16 日前全部卖出，收回金额合计为 14,977,696.85 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赎回款为 192,090.80 元，应付赎回费为 423.37 元，上述款项已于 2021 年 3 月 8 日前支付。

2、本基金最后运作日应付管理费为 7,870.04 元，应付托管费为 1,311.68 元，上述款项已于 2021 年 4 月 6 日支付。

- 3、本基金最后运作日应付券商佣金为 50,152.58 元，该款项已于 2021 年 4 月 15 日支付。
- 4、本基金最后运作日应付公证费为 10,000.00 元，该款项已于 2021 年 3 月 11 日支付。
- 5、本基金最后运作日应付信息披露费为 88,500.00 元，该款项已于 2021 年 4 月 15 日支付。
- 6、本基金最后运作日应付律师费为 18,000.00 元，该款项已于 2021 年 4 月 15 日支付。
- 7、本基金最后运作日应付审计费为 35,000.00 元，该款项预计在收到相关缴费单据后支付。
- 8、本基金最后运作日预提银行汇划费 919.65 元，该款项预计在未来分笔付款时支付。

#### (四) 停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	清算报告期间：2021-3-5 至 2021-4-16
一、收入	93,908.11
1、利息收入	10,706.56
其中：存款利息收入	10,706.56
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）	-1,013,008.25
其中：股票投资收益	-1,013,008.25
基金投资收益	-
债券投资收益	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	1,057,844.05
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-
5、其他收入（损失以“-”填列）	38,365.75
二、费用	30,502.82
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	30,302.82
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	200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	63,405.29
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	63,405.29

**(五) 停止运作后的清算损益情况说明**

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 3 月 4 日基金净资产	37,937,160.98
加：清算报告期间净收益	63,405.29
减：赎回金额（含费用）	12,987,130.88
二、2021 年 4 月 16 日基金净资产	25,013,435.39

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4月16日，本基金剩余财产为25,013,435.39元。自本次清算期结束日次日2021年4月17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析。

**五、备查文件目录****1、备查文件目录**

- (1) 南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 4 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告；
- (2) 北京金诚同达（深圳）律师事务所《关于南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金清算的法律意见书》。

**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。

南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2021 年 4 月 16 日

