

南方荣欢定期开放混合型发起式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：平安银行股份有限公司

报告出具日：2021年06月23日

报告送出日：2021年07月01日

一、基金情况

(一)、基本信息

1、基本信息

基金简称	南方荣欢定期开放混合发起
基金主代码	003064
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月3日
最后运作日基金份额总额	7,815,830.16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。
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	平安银行股份有限公司

2、基金运作情况

南方荣欢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]1063号《关于准予南方荣欢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《南方荣欢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、定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集510,097,814.22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1017号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方荣欢定期开放混

合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 510,099,951.92 份，其中认购资金利息折合 2,137.70 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《南方荣欢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。封闭期内，投资者不能申购和赎回基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、债券(包括国债、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、可转换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款)、货币市场工具、权证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)。本基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为 0-30%。开放期内，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；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%。

根据《南方荣欢定期开放混合型发起式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 6 月 4 日发布的《关于南方荣欢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》，本基金的最后运作日为 2021 年 6 月 4 日，并自 2021 年 6 月 5 日起进入清算程序。

(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》生效满 3 年后，连续 20 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 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决；连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情况下，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 2016 年 8 月 3 日。截至 2021 年 6 月 3 日日终，本基金连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发上述《基金合同》约定的基金合同自动

终止情形，为维护基金份额持有人利益，本基金管理人将按照约定终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人于2021年6月4日发布《关于南方荣欢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》。

基金管理人南方基金管理股份有限公司、基金托管人平安银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、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06月04日，自最后运作日的下一日（即2021年06月05日）起本基金进入基金财产清算程序。由于本基金持有的流通受限股票，本基金将进行两次清算，其中第一次清算期2021年06月05日至2021年06月23日。本基金将于前述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配。

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：南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月04日

资产	本期末 2021 年 06 月 04 日
资产：	
银行存款	10,049,722.17
结算备付金	3,217.02

存出保证金	159,935.30
交易性金融资产	1,427,682.12
其中：股票投资	1,427,682.12
债券投资	0.00
买入返售金融资产	0.00
应收证券清算款	576,487.31
应收利息	4,321.84
应收申购款	0.00
资产总计	12,221,365.76
负债和所有者权益	
负债：	
卖出回购金融资产款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	21.54
应付管理人报酬	835.46
应付托管费	167.09
应付销售服务费	0.00
应付交易费用	4,531.37
应交税费	22.58
应付利息	0.00
其他负债	9,300.00
负债合计	14,878.04
所有者权益：	0.00
实收基金	7,815,830.16
未分配利润	4,390,657.56
所有者权益合计	12,206,487.72
负债和所有者权益总计	12,221,365.76

注：报告截止日 2021 年 06 月 04 日(基金最后运作日)，基金份额总额 7,815,830.16 份，基金份额净值为 1.562 元。

四、清算情况

自 2021 年 06 月 05 日（最后运作日第二天）至 2021 年 06 月 23 日（报告出具日）止为本基金第一次清算报告期，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：

4.1 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。本基金的清算费用由基金管理人承担。

4.2 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 3,217.02 元，结算保证金为 159,935.30 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 1,044.19 元，应收结算备付金利息为 2,570.40 元，应收结算保证金利息为 707.25 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、本基金最后运作日深圳证券清算款为 94,402.89 元，该款项于 2021 年 6 月 7 日划入托管户；上海证券清算款为 482,084.42 元，该款项于 2021 年 6 月 7 日划入托管户。

4、本基金最后运作日持有交易性金融资产-股票投资为 1,427,682.12 元。截至 2021 年 06 月 23 日，除因尚处于锁定期内而无法卖出的股票投资外，本基金持有的其他交易性金融资产-股票投资已于 2021 年 6 月 17 日前卖出，收回金额合计人民币 1,253,551.18 元。锁定期股票在清算结束日(2021 年 06 月 23 日)市值为 313,283.31 元，该部分预计于锁定期结束后变现并进入二次清算程序。

4.3 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 835.46 元，应付托管费为 167.09 元，该款项预计在未来支付。

2、本基金最后运作日应付税费为 22.58 元，2021 年 6 月 9 日已支付 21.88 元，剩余的 0.70 元预计在未来支付。

3、本基金最后运作日应付银行间相关交易费用合计为 9,300.00 元，该款项已于 2021 年 6 月 21 日之前支付，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 4,531.37 元，该款项预计在未来支付。

5、本基金最后运作日应付赎回款为 21.54 元，该款项已于 2021 年 6 月 8 日划付。

4.4 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 05 日至 2021 年 06 月 23 日
一、收入	142,347.34
1.利息收入	2,195.33
其中：存款利息收入	2,195.33
债券利息收入	0.00
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）	505,679.55
其中：股票投资收益	506,046.15
基金投资收益	0.00
债券投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
股利收益	-366.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-365,527.54
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	2,509.79
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	2,509.79
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	0.00
9.其他费用（注 2）	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	139,837.55
减：所得税费用	0.00
四、净利润（净亏损以“-”填列）	139,837.55

4.5 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 2021 年 06 月 04 日基金净资产	12,206,487.72
加：清算报告期间净收益	139,837.55
减：赎回金额（含费用）	1,392.88
二、2021 年 06 月 23 日基金净资产	12,344,932.39

截止本基金第一次清算结束 2021 年 06 月 23 日（报告出具日），本基金剩余财产为 12,344,932.39 元。其中包含了备付金 3,217.02 元、保证金 159,935.30 元、应收利息 245.58 元、处于锁定期的股票市值为 313,283.31 元，所以本次进行清算的剩余财产为 11,868,251.18 元。锁定期股票将于后续进行变现，变现后发生投资盈利或亏损的情况及二次分配剩余财产届时将另行公告，二次分配剩余财产以实际变现并扣除相关费用后的金额为准。

4.6 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分配。

五、备查文件目录

（一）、备查文件目录

- （1）南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 04 日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；
- （2）《南方荣欢定期开放混合型发起式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。

南方荣欢定期开放混合型发起式证券

投资基金财产清算小组

2021年06月23日