

南方卓享绝对收益策略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：中国工商银行股份有限公司

报告出具日：2020年09月09日

报告送出日：2020年09月22日

一、基金简介

(一) 基本情况

1、基本信息

基金简称	南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金主代码	002655
基金运作方式	契约型、定期开放式、发起式。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。
基金合同生效日	2016年05月09日
最后运作日基金份额总额	11,241,509.97份
投资目标	灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选个股，并通过卖出股指期货合约对冲股票组合的市场风险，在尽量避免投资组合资产损失的前提下力争实现较为稳定的绝对回报。</p> <p>本基金主要采用投资策略包括：1、资产配置策略；2、多头投资策略；3、空头工具投资策略；4、其他绝对收益策略；5、风险控制策略；6、债券投资策略；7、中小企业私募债投资策略；8、权证投资策略。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2、基金运作情况

南方卓享绝对收益策略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[2015]2682号《关于准予南方卓享绝对收益策略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《南方卓享绝对收益策略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)295,855,239.27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564号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2016年5月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为295,855,239.27份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)和《南方卓享绝对收益策略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《基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),股指期货、权证,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、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规或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:权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。开放期内的每个交易日日终,本基金持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭期内的每个交易日日终,本基金持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。开放期内,在扣除股指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、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:中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。

(二) 清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”第三条规定,本基金自《基金合同》生效后,每个开放期届满时,若基金份额持有人数量不满200人,或当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于5000万元,将终止《基金合同》,不需召开基金份额持有人大会。在2020年第3次开放期届满时,即该次开放期的最后一日(即2020年8月20日)日终,本基金基金资产净值加上当日净申购金额

或者减去当日净赎回金额后低于 5000 万元，已触发上述《基金合同》约定的终止事由。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。本基金管理人已于 2020 年 8 月 22 日发布《关于南方卓享绝对收益策略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、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已于 2020 年 8 月 22 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，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 2020 年 8 月 21 日，自最后运作日的下一日（即 2020 年 8 月 22 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，其中第一次清算期为 2020 年 8 月 22 日至 2020 年 9 月 9 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数据列示。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 8 月 21 日

单位：人民币元

资产	本期末 2020 年 8 月 21 日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	5,793,624.61
结算备付金	5,195,062.38
存出保证金	1,058,461.43
交易性金融资产	11,188,203.38
其中：股票投资	11,188,203.38
债券投资	-
衍生金融资产（注 2）	-

应收证券清算款	1,092,523.96
应收利息	24,275.77
应收申购款	55,123.41
资产总计	24,407,274.94
负债和所有者权益	
负债：	
应付证券清算款	-
衍生金融负债（注2）	-
应付赎回款	10,293,782.00
应付管理人报酬	475,765.34
应付托管费	14,811.01
应付交易费用	46,740.35
其他负债	133,856.64
负债合计	10,964,955.34
所有者权益：	
实收基金	11,241,509.97
未分配利润	2,200,809.63
所有者权益合计	13,442,319.60
负债和所有者权益总计	24,407,274.94

注：1、报告截止日 2020 年 8 月 21 日(基金最后运作日)，基金份额总额 11,241,509.97 份，基金份额净值 1.1958 元。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2020 年 8 月 21 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2009	IF2009	-7	-9,821,280.00	-37,642.50
减：可抵销期货暂收款				-37,642.50
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

四、清算情况

自 2020 年 8 月 22 日至 2020 年 9 月 9 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：

（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财产承担。其中包括：审计费 3.5 万元、律师费 1 万元。

(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为 5,195,062.38 元，该款项于 2020 年 9 月 2 日调整为 341,540.44 元，将按照结算规则，逐步划回托管户。
- 2、本基金最后运作日存出保证金为 1,058,461.43 元，该款项于 2020 年 9 月 2 日调整为 89,333.42 元，将按照结算规则，逐步划回托管户。
- 3、本基金最后运作日持有交易性金融资产 11,188,203.38 元。截至 2020 年 9 月 9 日(本财务报表批准报出日)，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已于 2020 年 9 月 7 日前卖出，收回金额合计人民币 11,158,150.65 元。于 2020 年 8 月 31 日，本基金认购新股 14,239.75 元，已于 2020 年 9 月 8 日前全部卖出，收回金额合计人民币 20,482.91 元。锁定期的科创板股票在清算结束日(2020 年 9 月 9 日)市值为 235,705.55 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、本基金最后运作日持有的卖出衍生金融工具市值 9,821,280.00 元。上述卖出衍生金融工具已于 2020 年 8 月 25 日前全部平仓。
- 5、本基金最后运作日应收活期存款利息为 8,799.74 元，应收上海、深圳备付金利息合计为 2,231.49 元，应收上海、深圳保证金利息为 205.49 元；上述款项预计于 2020 年 9 月 21 日季度结息日划至基金托管户。
- 6、本基金最后运作日应收华泰期货备付金应收利息为 13,009.24 元，应收东证期货备付金应收利息为 29.81 元，该款项已于 2020 年 8 月 27 日划至托管户。
- 7、本基金最后运作日上海证券清算款 1,041,237.27 元，该款项已于 2020 年 8 月 24 日划至托管户；深圳证券清算款 51,286.69 元，该款项已于 2020 年 8 月 24 日划至托管户。
- 8、本基金最后运作日应收申购款为 55,123.41 元，该款项已于 2020 年 8 月 24 日收回。

(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 475,765.34 元，应付托管费为 14,811.01 元，该款项已于 2020 年 9 月 3 日支付。
- 2、本基金最后运作日应付券商佣金为 46,740.35 元（因投资变现，2020 年 8 月 22 日至 2020 年 9 月 8 日，产生应付佣金 1,119.04 元），上述款项已于 2020 年 9 月 9 日前支付。
- 3、本基金最后运作日应付信息披露费为 70,000.00 元，该款项已于 2020 年 8 月 31 日支付。
- 4、本基金最后运作日应付审计费为 35,000.00 元，该款项将于取得审计费发票后支付。
- 5、本基金最后运作日应付律师费为 10,000.00 元，该款项将于 2020 年 9 月 10 日支付。
- 6、本基金最后运作日应付赎回款为 10,293,782.00 元，应付赎回费为 18,856.64 元，该款项已于 2020 年 8 月 25 日划付。

(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：2020-08-22至2020-09-09
一、收入	64,388.95
1、利息收入	3,293.50
其中：存款利息收入	3,293.50
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）	710,271.45
其中：股票投资收益	910,898.97
基金投资收益	-
债券投资收益	-
衍生工具收益	-196,042.50
股利收益（注1）	-4,585.02
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-649,176.00
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-
5、其他收入（损失以“-”填列）	-
二、费用	13,662.94
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	13,610.94
7、利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
8、其他费用（注2）	52.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	50,726.01
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	50,726.01

注：

- 1、 该金额为股票股利及股票卖出涉及的红利补税。
- 2、 其他费用为银行汇划费。

(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2020年8月21日基金净资产	13,442,319.60
加：清算报告期间净收益	50,726.01
减：赎回金额（含费用）	-

二、2020年9月9日基金净资产	13,493,045.61
------------------	---------------

截止本基金第一次清算结束日2020年9月9日，本基金剩余财产为13,493,045.61元。其中包含了备付金341,540.44元，保证金89,333.42元、应收利息13,957.66元、处于锁定期的科创板股票市值为235,705.55元，所以本次进行清算的剩余财产为12,812,508.54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。

自本次清算期结束日次日2020年9月10日至第一次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。

(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、南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2020年1月1日至2020年8月21日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告；
- 2、上海市通力律师事务所关于《南方卓享绝对收益策略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。

管理人网站：<http://www.nffund.com>

(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。

南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2020年9月9日