

# 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：中国工商银行股份有限公司

报告编制日：2021年1月27日

报告送出日：2021年2月24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
基金二次清算结束日（2021年1月27日）基金份额总额	567,090.88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》,基金管理人于2020年8月22日发布的《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》和于2020年9月22日发布的《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》,本基金的最后运作日为2020年8月21日,第一次清算期间为自2020年8月22日(基金最后运作日次日)至2020年9月9日止期间。截至2020年9月9日止,本基金交易性金融资产市值为235,705.55元,为尚处于锁定期内而无法卖出的股票投资。本基金于2020年9月10日起进入第二次清算期间,截至2021年1月27日(基金第二次清算结束日)止,上述交易性金融资产已出售变现。

### (二) 清算原因

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》、基金管理人于2020年8月22日发布的《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》和于2020年9月22日发布的《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》，本基金的基金最后运作日为2020年8月21日，第一次清算期间为自2020年8月22日至2020年9月9日止期间。截至2020年9月9日止，本基金交易性金融资产市值为235,705.55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）二次清算起始日及清算期间

本基金第二次清算起始日为2020年9月10日，第二次清算期为2020年9月10日至2021年1月27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2020年8月22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

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：2021年1月27日（基金第二次清算结束日）

单位：人民币元

资产	基金第二次清算结束日 2021年1月27日
<b>资产：</b>	
银行存款	681,640.44
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	-
应收利息	167.70
<b>资产总计</b>	<b>681,808.14</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债：</b>	
应付证券清算款	-
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	-
应交税费	-
其他负债	-
<b>负债合计</b>	<b>-</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	567,090.88
未分配利润	114,717.26
<b>所有者权益合计</b>	<b>681,808.14</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>681,808.14</b>

注：基金第二次清算结束日为2021年1月27日，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份额总额为567,090.88份，基金份额净值为1.2023元。

#### 四、清算情况

自2020年9月10日至2021年1月27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1月27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 235,705.55 元，已于 2021 年 1 月 25 日前卖出，收回金额合计人民币 232,270.13 元。本次基金第二次清算结束日账面应收利息 167.70 元，预计于 2021 年 3 月 22 日划回托管户。
- 2、本基金第二次清算期因投资变现产生的应付佣金 23.25 元，上述款项已于 2021 年 1 月 26 日支付。
- 3、本基金第一次清算结束日结算备付金为 341,540.44 元，保证金为 89,333.42 元，该金额按照结算规则于 2020 年 12 月 2 日前逐步划回托管户。
- 4、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 2,981.32 元，应收上海、深圳保证金利息为 274.79 元，应收银行存款利息为 10,701.55 元，该金额于 2020 年 12 月 21 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：2020 年 9 月 10 日至 2021 年 1 月 27 日
一、收入	1,571.47
1、利息收入	3,139.14
其中：存款利息收入	3,139.14
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）	91,002.48
其中：股票投资收益	89,387.88
基金投资收益	-
债券投资收益	-
股利收益（注 1）	1,614.60
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-92,570.15
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-
5、其他收入（损失以“-”填列）	-
二、费用	300.40

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	276.40
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（注2）	24.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	1,271.07
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	<b>1,271.07</b>

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。

## （二）二次清算损益情况说明

单位：人民币

元

项目	金额
一、第一次清算结束日（2020年9月9日）基金净资产	13,493,045.61
加：清算报告期间净收益	1,271.07
减：第一次清算支付金额	12,812,508.54
二、2021年1月27日基金净资产	<b>681,808.14</b>

资产处置及负债清偿后，截止本基金二次清算报告编制日2021年1月27日，本基金剩余财产为681,808.14元。自本次清算期结束日次日（2021年1月28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析。

## **五、备查文件目录**

### **1、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 8 月 22 日(基金最后运作日次日)至 2021 年 1 月 27 日(基金第二次清算结束日)止期间的财务报表及审计报告；

(2) 《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二次清算报告》的法律意见。

### **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

2021 年 1 月 27 日