

南方恒泽 18 个月封闭式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：中国农业银行股份有限公司

报告出具日：2024 年 09 月 11 日

送出日期：2024 年 10 月 09 日

一、基金情况

(一) 基本信息

1. 基本信息

基金名称	南方恒泽 18 个月封闭式债券型证券投资基金	
基金简称	南方恒泽 18 个月封闭式债券	
基金主代码	017807	
基金运作方式	契约型封闭式，封闭期为 18 个月。	
基金合同生效日	2023 年 2 月 23 日	
最后运作日基金份额总额	4,247,194,249.00 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	基金管理人应根据资产估值方法不同，对投资的债券资产实行分单元管理，一是持有到期型单元，二是交易型单元。本基金投资前将对所投资的债券资产确认是否采用买入并持有至到期策略。具体投资策略包括：1、子单元管理策略；2、以摊余成本法计量的债券资产的投资策略；3、信用债投资策略；4、收益率曲线策略；5、放大策略；6、资产支持证券投资策略；7、国债期货投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、可转换债券及可交换债券投资策略等。	
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方恒泽 18 个月封闭式债券 A	南方恒泽 18 个月封闭式债券 C
下属分级基金的交易代码	017807	017808
最后运作日下属分级基金的份额总额	3,942,608,752.57 份	304,585,496.43 份

2. 基金运作情况

南方恒泽 18 个月封闭式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[2022]3246 号《关于准予南方恒泽 18 个月封闭式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《南方恒泽 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式，存续期限为 18 个月，即自本基金基金合同生效之日起至封闭期到期日止，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,246,508,294.34 元，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(2023)第 0085 号验资报告予以

验证。经向中国证监会备案,《南方恒泽 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》、基金合同”)于 2023 年 2 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,247,194,249.00 份,其中认购资金利息折合 685,954.66 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金自基金合同生效之日起进入封闭期,封闭期为本基金基金合同生效之日起至 18 个日历月后月度对日的前一日(若该日为非工作日,顺延至下一工作日)。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

本基金根据认购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额类别为在投资人认购时收取前端认购费用,但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额;C 类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费,但不收取认购费用的基金份额。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《基金合同》的有关规定,本基金投资于债券(包括国内依法发行上市交易的国债、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,但需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比例不低于基金资产的 80%,且投资于采用摊余成本法估值的债券资产不低于基金净资产的 50%(如因基金资产价格波动等原因导致摊余成本计量的债券资产被动低于上述 50%比例的,应在 1 个月内调整至符合比例要求),投资于采用交易策略并相应以市价法估值的债券资产不低于基金净资产的 20%;本基金投资可转换债券和可交换债券合计不超过基金总资产的 10%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金等。本基金在封闭期到期日前 2 个月内可以不满足上述投资比例限制。本基金的业绩比较基准为:中债-综合全价(总值)指数收益率。

根据《基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于 2024 年 8 月 23 日发布的《关于南方恒泽 18 个月封闭式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 2024 年 8 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》“第三部分基金的基本情况”的相关约定：“本基金的存续期限为 18 个月，即自本基金基金合同生效之日起至封闭期到期日止。”“本基金自基金合同生效之日起进入封闭期，封闭期为本基金基金合同生效之日起至 18 个日历月后月度对日的前一日（若该日为非工作日，顺延至下一工作日）。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。”“本基金将在封闭期到期日对基金份额进行自动赎回，按已变现的基金财产支付部分赎回款项，基金管理人将在 T+7 日内（含）将已变现的基金财产对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例自动赎回给本基金全体基金份额持有人。封闭期到期日的次日，本基金基金合同自动终止并进入基金财产清算程序。进入基金财产清算程序时，若存在未变现的资产，登记机构将于该部分资产变现完成后，将对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给本基金全体基金份额持有人，单位基金份额所分配的资产金额按照资产变现完成后的净额进行计算，单位基金份额对应的总到账款项可能与封闭期到期日基金份额净值不一致。基金管理人应在封闭期到期日的下一个工作日发布相关提示公告。若由于不可抗力的原因导致无法按时办理基金份额自动赎回的，则办理日相应顺延。”本基金基金合同生效日为 2023 年 2 月 23 日，封闭期到期日为 2024 年 8 月 22 日。本基金根据基金合同约定于封闭期到期日的次日（即 2024 年 8 月 23 日）起进入基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人于 2024 年 8 月 23 日发布《关于南方恒泽 18 个月封闭式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、上海市通力律师事务所和德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）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 2024 年 8 月 22 日，清算期为 2024 年 8 月 23 日（清算开始日）起至 2024 年 9 月 11 日（清算结束日）止期间。

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：南方恒泽 18 个月封闭式债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 08 月 22 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2024/08/22（基金最后运作日）
货币资金	4,281,596,652.55
结算备付金	341,121.28
存出保证金	0.00
交易性金融资产	0.00
其中：股票投资	0.00
基金投资	0.00
债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
贵金属投资	0.00
其他投资	0.00
衍生金融资产	0.00
买入返售金融资产	0.00
债权投资	0.00
其中：债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
其他投资	0.00
应收清算款	0.00
应收股利	0.00
应收申购款	0.00
递延所得税资产	0.00
其他资产	0.00
资产总计	4,281,937,773.83
负债和净资产	本期末 2024/08/22（基金最后运作日）
短期借款	0.00
交易性金融负债	0.00
衍生金融负债	0.00
卖出回购金融资产款	0.00
应付清算款	0.00
应付赎回款	0.00
应付管理人报酬	805,527.77
应付托管费	134,254.66
应付销售服务费	38,501.78
应付投资顾问费	0.00
应交税费	194,267.41

应付利润	0.00
递延所得税负债	0.00
其他负债	717,569.94
负债合计	1,890,121.56
实收基金	4,247,194,249.00
其他综合收益	0.00
未分配利润	32,853,403.27
净资产合计	4,280,047,652.27
负债和净资产总计	4,281,937,773.83

注：报告截止日 2024 年 08 月 22 日（基金最后运作日），南方恒泽 18 个月封闭式债券 A 份额净值 1.0078 元，基金份额总额 3,942,608,752.57 份；南方恒泽 18 个月封闭式债券 C 份额净值 1.0074 元，基金份额总额 304,585,496.43 份；总份额合计 4,247,194,249.00 份。

四、清算情况

自 2024 年 08 月 23 日至 2024 年 09 月 11 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财产承担。其中包括：律师费 10,000 元，审计费 65,000 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本金 308,715.38 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计活期存款利息为 88,285.53 元，应计结算备付金利息为 32,405.90 元；上述款项预计于 2024 年 9 月 21 日季度结息日划至基金托管户。

（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 805,527.77 元，应付托管费为 134,254.66 元，应付销售服务费为 38,501.78 元，前述款项已于 2024 年 9 月 4 日支付。

2. 本基金最后运作日应交税费为 194,267.41 元，该款项已于 2024 年 9 月 10 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 59,764.94 元, 该款项已于 2024 年 9 月 6 日支付, 银行间销户工作已经处理完毕。

4. 本基金最后运作日应付信息披露费为 77,000 元, 该款项已于 2024 年 8 月 26 日支付。

5. 本基金最后运作日应付审计费为 65,000 元, 该款项预计在未来支付。

6. 本基金最后运作日应付律师费为 10,000 元, 该款项已于 2024 年 8 月 26 日支付。

(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: 2024/08/23 至 2024/09/11
一、营业总收入	635.95
1.利息收入	635.95
其中: 存款利息收入	635.95
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)	-
其中: 股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	-
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	-

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	635.95
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	635.95
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	635.95

（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 2024/08/22 基金净资产	4,280,047,652.27
加：清算报告期间净收益	635.95
减：赎回金额（含费用）	4,280,047,652.27
二、2024/09/11 基金净资产	635.95

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人以自有资金先行垫付截至最后运作日 2024 年 8 月 22 日的相关应收未收款项，本基金已于清算期首日 2024 年 8 月 23 日根据基金合同自动赎回相关约定按最后运作日的基金净资产全额支付投资者赎回款项。自本次清算期首日 2024 年 8 月 23 日至清算期结束日 2024 年 9 月 11 日的利息收入 635.95 元属于基金管理人垫付资金产生，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。本基金清算财产已全部于 2024 年 8 月 23 日全额支付投资者赎回款项，后续不涉及对投资者的财产分配。

五、 备查文件目录

（一） 备查文件目录

（1）南方恒泽 18 个月封闭式债券型证券投资基金 2024 年 8 月 22 日（最后运作日）及 2024 年 9 月 11 日（清算结束日）的清算资产负债表和 2024 年 8 月 23 日（清算开始日）至 2024 年 9 月 11 日（清算结束日）止清算期间的清算损益表及清算财务报表附注。

（2）关于《南方恒泽 18 个月封闭式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

投资者可登录基金管理人网站查阅,或在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

南方恒泽 18 个月封闭式债券型证券

投资基金基金财产清算小组

2024 年 09 月 11 日