

南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）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：2022年08月31日

报告送出日：2022年09月08日

一、基金情况

（一）、基本信息

1、基本信息

基金名称	南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）	
基金简称	南方全球精选债券发起（QDII）	
基金主代码	007628	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2019年08月21日	
最后运作日基金份额总额	62,178,325.36份	
投资目标	本基金通过分析全球各个国家和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎前提下力争实现长期稳定的投资回报。	
投资策略	<p>本基金通过分析全球各个国家和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面，对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断；根据对政府债券、信用债、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定不同经济周期阶段下的债券类属配置并寻找各类债券的投资机会，在谨慎前提下力争实现长期稳定的投资回报。</p> <p>本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资，包括远期、期权、期货等，以更好地进行组合风险管理，提高组合运作效率，实现投资目标。</p>	
业绩比较基准	巴克莱全球债券指数（Barclay Global Aggregate Index）*95%+同期人民币一年定期存款利率（税后）*5%	
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	
下属分级基金的基金简称	南方全球精选债券发起（QDII）A	南方全球精选债券发起（QDII）C
下属分级基金的交易代码	007628/007630	007629/007631
最后运作日下属分级基金的份额总额	48,881,094.13	13,297,231.23

2、基金运作情况

南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）（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[2019]1071号《关于准予南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）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《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（Q

DII）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 287,222,587.27 人民币元、38,072,308.38 美元（按照募集期最后一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算为人民币 267,737,752.41 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（2019）第 0441 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》于 2019 年 8 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 555,056,973.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 96,633.65 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，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

根据《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》和《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》的规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。在每一份类别内，根据认购、申购、赎回计价币种的不同，分为人民币销售和美元销售。A 类基金份额包括 A 类人民币基金份额和 A 类美元基金份额。C 类基金份额包括 C 类人民币基金份额和 C 类美元基金份额。本基金美元份额的基金份额净值以人民币份额的基金份额净值为基础，按照估值日的估值汇率进行折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，本基金投资于境内境外市场。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：境外政府债券、公司债券（包括公司发行的金融债券）、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等，以及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的优先股、境外固定收益型及货币型公募基金（包括 ETF）；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、与固定收益、股权、信用商品指数、基金等标的物挂钩的境外结构性投资产品；以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。针对境内投资，本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、金融债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、可分离交易可交换债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、国债期货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相关规定）。本基金不主动参与股票等权益类资产的投资，包括不直接从二级市场买入股票等权益类资产，不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。其中，投资于境外发行的债券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为：巴克莱全球债券指数(Barclay Global Aggregate Index) x95%+同期人民币一年定期存款利率(税后) x5%。

根据《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于2022年08月22日发布的《关于南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自2022年08月23日起进入基金财产清算程序。

（二）、清算原因

根据《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》“第五部分 基金的备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中约定：“基金合同生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元人民币（美元折算为人民币），基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”

截至本基金基金合同生效之日起3年后的对应日（2022年08月21日）日终，本基金基金资产净值低于2亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的自动终止情形。本基金管理人于2022年08月22日发布《关于南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）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于2022年08月23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2022年08月22日，清算期为2022年08月23日至2022年08月31日。

二、清算报表编制基础

本基金自2022年8月23日起进入清算程序，因此本基金的财务报表以清算基础编制。

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。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。

此外，本基金财务报表按照财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及在财务报表所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）

报告截止日：2022年08月22日（最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2022年08月22日
资产：	
银行存款	18,491,099.95
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	80,929,826.59
应收申购款	-
应收利息	-
资产总计	99,420,926.54
负债和净资产	
负债：	
应付清算款	-
应付赎回款	51,774,110.09
应付管理人报酬	48,325.36
应付托管费	13,289.46
应付销售服务费	4,338.65
应交税费	5,007.85
其他负债	77,646.89
负债合计	51,922,718.30
净资产：	-
实收基金	62,178,325.36
未分配利润	-14,680,117.12
净资产合计	47,498,208.24
负债和净资产总计	99,420,926.54

注：1. 报告截止日 2022 年 08 月 22 日（基金最后运作日），基金份额总额 62,178,325.36 份其中南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）A 类（人民币）基金份额总额为 16,815,261.86 份，基金份额净值 0.7657 元；南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）A 类（美元现汇）基金份额总额为 32,065,832.27 份，基金份额净值 0.1123 美元；南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）C 类（人民币）基金份额总额为 1,620,987.92 份，基金份额净值 0.7574 元；南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）C 类（美元现汇）基金份额总额为 11,676,243.31 份，基金份额净值 0.1111 美元。

四、清算情况

自 2022 年 08 月 23 日至 2022 年 08 月 31 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《南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）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。本基金的清算相关费用由基金管理人承担。

（二）、最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日应收活期存款利息为 573.67 元，将由基金管理人南方基金管理股份有限公司先行垫付。

2、本基金最后运作日证券清算款 11,866,891.49 美元（折合人民币 80,929,826.59 元），该款项已于 2022 年 08 月 30 日划入基金托管户。

（三）、最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理费为 48,325.36 元，应付托管费为 13,289.46 元，应付销售服务费为 4,338.65 元，前述款项已于 2022 年 08 月 26 日支付。

2、本基金最后运作日应交税费为 5,007.85 元，该款项已于 2022 年 08 月 26 日支付。

3、本基金最后运作日应付信息披露费为 76,932.18 元，该款项已于 2022 年 08 月 29 日支付。

4、本基金最后运作日应付赎回款 51,774,110.09 元，应付赎回费 714.71 元，上述款项已于 2022 年 08 月 30 日支付。

（四）、停止运作后的清算损益情况说明

项目	清算报告期间：2022年08月23日至2022年08月31日
一、营业总收入	423,558.88
1.利息收入	682.49
其中：存款利息收入	682.49
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	-
证券出借利息收入	-
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）	422,062.51
5.其他收入（损失以“-”号填列）	813.88
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）	423,558.88
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	423,558.88
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	423,558.88

- 1、汇兑损益为清算期间持有外币资产由于汇率变动而产生的损益。
- 2、其他收入为清算期间归入基金资产的基金赎回费收入及境外CSDR罚息收入。

（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 2022 年 08 月 22 日基金净资产	47,498,208.24
加：清算报告期间净收益	423,558.88
减：赎回金额（含费用）	24,914,212.35
二、2022 年 08 月 31 日基金净资产	23,007,554.77

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日 2022 年 08 月 31 日，本基金剩余财产为 23,007,554.77 元。自本次清算期结束日次日 2022 年 09 月 01 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配。

五、备查文件目录

（一）、备查文件目录

（1）南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）2022 年 01 月 01 日至 2022 年 08 月 22 日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

（2）关于南方全球精选债券型发起式证券投资基金（QDII）清算报告的法律意见书。

（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。

南方全球精选债券型发起式证券投资
基金（QDII）基金财产清算小组
2022 年 08 月 31 日

