

## 南方中证科技 100 交易型开放式指数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：2023 年 12 月 25 日**

**送出日期：2024 年 1 月 8 日**

## 一、基金情况

### (一)、基本信息

#### 1、基本信息

基金名称	南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证科技 100ETF
场内简称	科技 100ETF
基金主代码	159853
交易代码	159853
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 29 日
最后运作日基金份额总额	9,251,992.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。主要投资策略包括：1、复制策略；2、替代策略；3、金融衍生品投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、融资及转融通证券出借业务投资策略；7、可转换债券及可交换债券投资策略；8、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证科技 100 指数，及其未来可能发生的变更。
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
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 10 月 15 日

#### 2、基金运作情况

南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金(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[2020]3683 号《关于准予南方中证科技 100 交易型开放式指数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

《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 302,232,500.00 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(2021)第 0954 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)于 2021 年 9 月 29 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 302,251,992.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,492.00 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]984 号核准，本基金 302,251,992.00 份基金份额于 2021 年 10 月 15 日在深交所挂牌交易。

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，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证科技 100 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产、货币市场工具以及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)。本基金可投资存托凭证。基金管理人根据相关规定可参与融资、转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金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、应收申购款等。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：中证科技 100 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分别于 2023 年 11 月 20 日发布的《关于南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的提示性公告》、于 2023 年 11 月 25 日发布的《关于南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》以及于 2023 年 11 月 22 日发布的《关于南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金终止上市的公告》，本基金自 2023 年 11 月 25 日起进入基金财产清算程序，自 2023 年 11 月 27 日起终止上市。

## (二)、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”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 2 年内，连续 50 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，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。如本基金在《基金合同》生效 2 年后继续存续的，连续 30 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 1 亿元情形的，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 2021 年 9 月 29 日。截至 2023 年 11 月 17 日日终，本基金在《基金合同》生效 2 年后已连续 30 个工作日基金资产净值低于 1 亿元，出现基金合同终止事由，基金管理人将终止《基金合同》，并根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算，按照深交所规定申请办理本基金终止上市的相关事宜。本基金最后运作日为 2023 年 11 月 24 日，自 2023 年 11 月 25 日（最后运作日的次日）起进入基金财产清算程序。

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 2023 年 11 月 24 日，清算期为 2023 年 11 月 25 日至 2023 年 12 月 25 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。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：南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 11 月 24 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 11 月 24 日（基金最后运作日）
银行存款	240,031.16
结算备付金	7,653.31
存出保证金	10,427.94
交易性金融资产	7,343,211.85
其中：股票投资	7,343,211.85
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
应收清算款	77,895.62
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	7,679,219.88
负债和净资产	本期末 2023 年 11 月 24 日（基金最后运作日）
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	61,132.49
应付赎回款	-
应付管理人报酬	2,373.56
应付托管费	791.17
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	246,454.96
负债合计	310,752.18
实收基金	9,251,992.00
其他综合收益	-

未分配利润	-1,883,524.30
净资产合计	7,368,467.70
负债和净资产总计	7,679,219.88

注：1、报告截止日 2023 年 11 月 24 日(基金最后运作日)，基金份额总额 9,251,992.00 份，基金份额净值 0.7964 元。

## 四、清算情况

自 2023 年 11 月 25 日至 2023 年 12 月 25 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。

### (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 7,437.53 元，存出保证金为 10,394.75 元，前述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 450.29 元，应收结算备付金利息为 215.78 元，应收存出保证金利息为 33.19 元；上述款项已于 2023 年 12 月 21 日季度结息日划至基金托管户。

3、本基金最后运作日应收清算款为 77,895.62 元，该款项已于 2023 年 11 月 27 日划入基金托管户。

4、本基金最后运作日本基金持有的交易性金融资产-股票投资为 7,343,211.85 元，该资产已于 2023 年 11 月 30 日前全部卖出，清算金额为 7,286,797.61 元，已全部划入基金托管户。

### (三)、最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付清算款 61,132.49 元，该款项已于 2023 年 11 月 28 日前支付完毕。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为 2,373.56 元，应付托管费为 791.17 元，前述款项已于 2023 年 12 月 5 日支付。

3、本基金最后运作日其他负债 246,454.96 元，其中应付券商佣金为 831.89 元，该款项已于 2023 年 12 月 7 日支付；应付审计费为 25,000 元，该款项已于 2023 年 12 月 15 日支付；应付律师费为 10,000 元，该款项已于 2023 年 12 月 15 日支付；应退退补款 210,623.07 元，该款项已于 2023 年 11 月 30 日前支付完毕。

#### （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：2023 年 11 月 25 日至 2023 年 12 月 25 日
一、营业总收入	-54,472.51
1.利息收入	4,012.92
其中：存款利息收入	4,012.92
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）	-574,210.90
其中：股票投资收益	-572,868.71
基金投资收益	-
债券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-1,342.19
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）	515,725.47
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	568.72
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	568.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-55,041.23
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-55,041.23
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-55,041.23

### （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 2023 年 11 月 24 日基金净资产	7,368,467.70
加：清算报告期间净收益	-55,041.23
减：赎回金额（含费用）	0.00
二、2023 年 12 月 25 日基金净资产	7,313,426.47

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日 2023 年 12 月 25 日，本基金剩余财产为 7,313,426.47 元。根据《基金合同》约定，基金财产清算小组依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自本次清算期结束日次日（2023 年 12 月 26 日）至清算款项支付日前一日的银行存款利息、备付金利息及保证金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）南方中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 11 月 24 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；



(2) 关于《南方中证科技 100 交易型开放式指数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。

南方中证科技 100 交易型开放式指数

证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 12 月 25 日