

南方安养混合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：交通银行股份有限公司

报告出具日：2024年05月27日

送出日期：2024年06月07日

一、基金情况

(一)、基本信息

1、基本信息

基金名称	南方安养混合型证券投资基金
基金简称	南方安养混合
基金主代码	005397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6日
最后运作日基金份额总额	26,218,843.28份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，实际投资过程中，将“优化的CPPI策略”作为大类资产配置的主要出发点，主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

2、基金运作情况

南方安养混合型证券投资基金(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[2017]518号《关于准予南方安养混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017]2631号《关于同意南方安养混合型证券投资基金延期募集备案的函》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《南方安养混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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278,618,541.13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(2018)第0095号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方安养混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为278,830,087.99份基金份额，其中认购资金利息折

合 211,546.86 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方安养混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、股指期货、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)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：股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 0-30%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于 70%。每个交易日日终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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%。

根据《南方安养混合型证券投资基金基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于 2024 年 4 月 25 日发布的《南方安养混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2024 年 4 月 26 日进入财产清算期。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 5 月 27 日批准报出。

(二)、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中约定：“《基金合同》生效后，连续 20 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人民币 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”经持有人大会表决通过，本基金将从 2024 年 4 月 26 日起进入基金财产清算程序。本基金管理人于 2024 年 4 月 25 日发布《南方安养混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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）和北京金诚同达（深圳）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，北京金诚同达（深圳）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 04 月 25 日，清算期为 2024 年 04 月 26 日至 2024 年 05 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。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：南方安养混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 04 月 25 日

单位：人民币元

资产	本期末 2024 年 04 月 25 日
银行存款	5,251,715.96
结算备付金	8,046.68
存出保证金	3,970.97
交易性金融资产	95,298.00
其中：股票投资	95,298.00
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	20,252,091.58
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	25,611,123.19
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	81,034.94
应付管理人报酬	20,582.56
应付托管费	4,116.54
应付销售服务费	0.00
应付投资顾问费	0.00
应交税费	5.76
应付利润	0.00
递延所得税负债	0.00
其他负债	60,049.11
负债合计	165,788.91
实收基金	26,218,843.28
其他综合收益	0.00
未分配利润	-773,509.00
净资产合计	25,445,334.28
负债和净资产总计	25,611,123.19

注 1、报告截止日 2024 年 04 月 25 日(基金最后运作日)，基金份额总额 26,218,843.28 份，基金份额净值 0.9705 元。

四、清算情况

自 2024 年 04 月 26 日至 2024 年 05 月 27 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《南方安养混合型证券投资基金基金合同》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：基金份额持有人大会公证费 10,000 元，律师费 18,000 元，审计费 6,000 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 8,025.12 元，结算保证金为 3,964.49 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收活期存款利息为 836.46 元，应收结算备付金利息为 21.56 元，应收结算保证金利息为 6.48 元；上述款项预计于 2024 年 6 月 21 日季度结息日划至基金托管户。

3、本基金最后运作日深圳证券清算款为 891,592.33 元，该款项于 2024 年 4 月 26 日全部划入托管户；上海证券清算款为 19,033,763.85 元，该款项于 2024 年 4 月 26 日全部划入托管户；本基金最后运作日北京证券清算款为 326,735.40 元，该款项于 2024 年 4 月 26 日全部划入托管户。

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 95,298.00 元该资产已于 2024 年 4 月 26 日前全部卖出清算金额为 96,600.43 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管理费为 20,582.56 元，应付托管费为 4,116.54 元，该款项已于 2024 年 5 月 8 日支付。

2、本基金最后运作日应付银行间相关交易费用合计为 6,200.00 元，该款项已于 2024 年 5 月 13 日支付，银行间销户工作已经处理完毕。

3、本基金最后运作日应付券商佣金为 4,238.28 元，该款项已于 2024 年 5 月 13 日支付。

4、本基金最后运作日应付信息披露费为 12,500 元，该款项已于 2024 年 5 月 24 日支付。

5、本基金最后运作日应付审计费为 6,000 元，该款项已于 2024 年 5 月 21 日支付。

6、本基金最后运作日应付律师费为 18,000 元，该款项已于 2024 年 5 月 15 日支付。

7、本基金最后运作日应付公证费为 10,000 元，该款项已于 2024 年 5 月 13 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：2024 年 04 月 26 日至 2024 年 05 月 27 日
----	---

一、营业总收入	12,294.54
1.利息收入	12,113.85
其中：存款利息收入	12,113.85
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）	153.51
其中：股票投资收益	1,323.41
基金投资收益	-
债券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-1,169.90
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）	-72.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	99.91
减：二、营业总支出	-2,835.87
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	-2,835.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	15,130.41
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	15,130.41
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	15,130.41

（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 年 04 月 25 日基金净	25,445,334.28

资产	
加：清算报告期间净收益	15,130.41
减：赎回金额（含费用）	7,452,161.24
二、2024年05月27日基金净资产	18,008,303.45

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日2024年05月27日，本基金剩余财产为18,008,303.45元。自本次清算期结束日次日2024年05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。

（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析。

五、备查文件目录

（一）、备查文件目录

（1）南方安养混合型证券投资基金2024年01月01日至2024年04月25日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

（2）关于《南方安养混合型证券投资基金清算报告》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。

南方安养混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年05月27日