

南方兴锦利一年定期开放债券型发起式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：兴业银行股份有限公司

报告出具日：2025年01月16日

送出日期：2025年2月12日

一、基金情况

（一）、基本信息

1. 基本信息

基金名称	南方兴锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	南方兴锦利一年定开债券发起
基金主代码	013197
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月16日
最后运作日基金份额总额	2,000,000.00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	本基金将投资信用类债券，以提高组合收益能力，并将在南方基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。具体投资策略包括：（一）封闭期投资策略：1、信用债投资策略；2、收益率曲线策略；3、放大策略；4、资产支持证券投资策略；5、信用衍生品投资策略。（二）开放期投资策略。
业绩比较基准	中债信用债总指数收益率
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

2. 基金运作情况

南方兴锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2021]2456号文《关于准予南方兴锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，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《南方兴锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）作为基金管理人向社会公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2021年9月15日至2021年9月15日，首次设立募集规模为3,009,999,000.00份基金份额，其中认购资金利息折合0.00份基金份额，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具普华永道中天验字（2021）第0061号验资报告。经向中国证监会备案，《基金合同》

于 2021 年 9 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，登记机构为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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。本基金自基金合同生效后，每年开放一次申购和赎回，每个开放期的起始日为基金合同生效日的年度对日（如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日），开放期不少于 1 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。开放期内，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额。本基金首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

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、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。本基金不投资股票、可转换债券、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本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%，应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金开放期开始前一个月、开放期以及开放期结束后的一个月內，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，封闭期内不受上述 5% 的限制，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：中债信用债总指数收益率。

根据《基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于 2025 年 1 月 10 日发布《关于南方兴锦利一年定期开放债券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》，本基金于 2025 年 1 月 11 日进入基金财产清算程序。

（二）、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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，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。如本基金在基金合同生效 3 年后继续存续的，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 5000 万元情形的，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；……”

截至 2025 年 1 月 9 日日终，本基金基金资产净值已连续 60 个工作日低于 1 亿元，触发上述《基金合同》约定的终止情形，基金管理人终止《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。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（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，并由安永华明会计师事务所（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 2025 年 01 月 10 日，清算期为 2025 年 01 月 11 日至 2025 年 01 月 16 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：南方兴锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 01 月 10 日

单位：人民币元

资产	本期末 2025 年 01 月 10 日（基金最后运作日）
货币资金	402,382.56
结算备付金	0.00
存出保证金	129.62
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	1,823,628.23
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	2,226,140.41
负债和净资产	本期末 2025 年 01 月 10 日（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	191.86
应付托管费	63.94
应付销售服务费	0.00
应付投资顾问费	0.00
应交税费	0.00
应付利润	0.00
递延所得税负债	0.00
其他负债	95,010.00
负债合计	95,265.80
实收基金	2,000,000.00
其他综合收益	0.00
未分配利润	130,874.61
净资产合计	2,130,874.61
负债和净资产总计	2,226,140.41

注 1、报告截止日 2025 年 01 月 10 日(基金最后运作日)，基金份额总额 2,000,000.00 份，基金份额净值 1.0654 元。

四、清算情况

自 2025 年 01 月 11 日至 2025 年 01 月 16 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。从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金的清算费用由基金管理人承担。其中包括:律师费 10,000.00 元,审计费 10,000.00 元。

(二)、最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日存出保证金为 125.74 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 81.36 元,应收结存出保证金利息为 3.88 元;上述款项预计于 2025 年 3 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上海证券清算款为 1,823,628.23 元,该款项于 2025 年 1 月 13 日划入托管户。

(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 191.86 元,应付托管费为 63.94 元,该款项已于 2025 年 1 月 14 日支付。

2、本基金最后运作日其他负债为 95,010.00 元,其中应付信息披露费为 95,000.00 元,该款项已于 2025 年 1 月 14 日支付;其他应付款为 10.00 元,为预提的银行划款手续费,该款项预计于 2 月 5 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: 2025/01/11 至 2025/01/16
一、营业总收入	91.59
1.利息收入	91.59
其中:存款利息收入	91.59
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）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	20.00
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	20.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	71.59
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	71.59
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	71.59

（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 2025 年 01 月 10 日基金净资产	2,130,874.61
加：清算报告期间净收益	71.59
减：赎回金额（含费用）	0.00
二、2025 年 01 月 16 日基金净资产	2,130,946.20

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日 2025 年 01 月 16 日，本基金剩余财产为 2,130,946.20 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 2025 年 01 月 17 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）南方兴锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算审计报告；
- （2）关于《南方兴锦利一年定期开放债券型发起式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。

南方兴锦利一年定期开放债券型发起式
证券投资基金基金财产清算小组
2025 年 01 月 16 日