

南方瑞利灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

报告出具日：2023年04月03日

送出日期：2023年04月13日

一、基金情况

(一)、基本信息

1、基本信息

基金名称	南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方瑞利灵活配置混合
基金主代码	002220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月30日
最后运作日基金份额总额	25,021,228.16份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
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

2、基金运作情况

南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金是根据原《南方瑞利保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由原南方瑞利保本混合型证券投资基金(以下简称“南方瑞利保本基金”)转型而来。南方瑞利保本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,于2015年12月18日至2015年12月18日进行募集,并于2015年12月23日成立。南方瑞利保本基金保本期为两年,第一个保本期于2017年12月25日到期,但基金管理人无法为南方瑞利保本基金转入下一保本期确定保本担保人,南方瑞利保本基金因不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,根据《南方瑞利保本混合型证券投资基金基金合同》及《南方瑞利保本混合型证券投资基金保本到期安排及转型为南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金

相关业务规则的公告》，自 2017 年 12 月 30 日起，南方瑞利保本基金转型为南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金可以投资于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)、债券(包括国债、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、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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范围为 0-95%。本基金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，应当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，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×60%+上证国债指数收益率×40%。

根据《基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于 2023 年 3 月 15 日发布的《关于南方瑞利灵活配置混合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 2023 年 3 月 16 日起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 基金的存续”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 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 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，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会。……”《基金合同》生效日为 2017 年 12 月 30 日。截至 2023 年 3 月 14 日日终，本基金已连续 30 个工作日基金资产净值低于 1 亿元，触发上述《基金合同》约定的自动终止情形。本基金管理人于 2023 年 3 月 15 日发布《关于南方瑞利灵活配置混合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、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 03 月 15 日，清算期为 2023 年 03 月 16 日至 2023 年 04 月 03 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：南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 03 月 15 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2023 年 03 月 15 日
资产：	
银行存款	11,737,159.75
结算备付金	599,779.38
存出保证金	49,164.70
交易性金融资产	20,232,647.45
其中：股票投资	-
债券投资	20,232,647.45
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	16,463,166.43
应收利息	-
资产总计	49,081,917.71
负债和所有者权益	

负债：	
应付证券清算款	-
应付赎回款	3,036,539.62
应付管理人报酬	14,129.85
应付托管费	2,354.98
应付销售服务费	-
应交税费	1,150.85
其他负债	230,162.07
负债合计	3,284,337.37
所有者权益：	
实收基金	25,021,228.16
未分配利润	20,776,352.18
所有者权益合计	45,797,580.34
负债和所有者权益总计	49,081,917.71

注：报告截止日 2023 年 3 月 15 日(基金最后运作日)，基金份额总额为 25,021,228.16 份，基金份额净值 1.8303 元。

四、清算情况

自 2023 年 03 月 16 日至 2023 年 04 月 03 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《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 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 599,779.38 元，存出保证金为 49,164.70 元，该款项将按照结算规则，逐步划回托管户。

2、本基金最后运作日深圳证券清算款为 2,882,911.47 元，该款项于 2023 年 03 月 16 日划入托管户；上海证券清算款为 13,580,254.96 元，该款项于 2023 年 03 月 16 日划入托管户。

3、本基金最后运作日本基金持有的交易性金融资产-债券投资为 20,232,647.45 元,该资产已于 2023 年 03 月 16 日全部卖出,清算金额为 20,256,447.36 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 14,129.85 元,应付托管费为 2,354.98 元,该款项已于 2023 年 03 月 17 日支付。

2、本基金最后运作日应付税费为 1,150.85 元,该款项已于 2023 年 03 月 17 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 12,885.00 元,该款项已于 2023 年 03 月 24 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券商佣金为 38,691.99 元,该款项已于 2023 年 03 月 17 日支付。

5、本基金最后运作日应付预提信息披露费为 132,500 元,该款项已于 2023 年 03 月 17 日支付。

6、本基金最后运作日应付预提年度审计费为 30,000 元,该款项已于 2023 年 03 月 23 日支付。

7、本基金最后运作日应付预提清算审计费为 6,000 元,该款项将于 2023 年 04 月 03 日之后支付。

8、本基金最后运作日应付预提律师费为 10,000 元,该款项将于 2023 年 04 月 03 日之后支付。

9、本基金最后运作日应付赎回款为 3,036,539.62 元,应付赎回费为 85.08 元,该款项已于 2023 年 03 月 16 日及 17 日支付。

(四)、清算期间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 03 月 16 日至 2023 年 04 月 03 日
一、营业总收入	37,364.78
1.利息收入	14,145.12
其中：存款利息收入	14,145.12
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）	81,356.51
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	81,794.71
衍生工具收益	-
股利收益	-438.20
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）	-58,187.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	50.32
减：二、营业总支出	-2,390.91
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	3.88
8.其他费用	-2,394.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	39,755.69
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	39,755.69
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	39,755.69

（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 03 月 15 日基金净资产	45,797,580.34
加：清算报告期间净收益	39,755.69
减：赎回金额（含费用）	10,134,938.47
二、2023 年 04 月 03 日基金净资产	35,702,397.56

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 04 月 03 日，本基金剩余财产为 35,702,397.56 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04月04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、南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 03 月 15 日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

2、关于《南方瑞利灵活配置混合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。

南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组
2023 年 04 月 03 日