

广发集泰债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2020年7月22日

报告公告日期：2020年8月18日

目录

1. 重要提示	3
2. 基金概况	4
3. 基金运作情况说明	5
4. 财务报告	6
5. 清算事项说明	7
6. 备查文件目录	9

1. 重要提示

广发集泰债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】2257号文准予注册，于2018年7月26日成立并正式运作。本基金基金管理人为广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《广发集泰债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，2020年5月27日起至2020年6月29日止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年6月30日，本基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于广发集泰债券型证券投资基金终止基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年7月1日公布的《关于广发集泰债券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》，本基金从2020年7月2日起进入清算期，基金管理人按照本基金基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

2020年7月22日为本基金清算的最后一日，由基金管理人广发基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和广东广信君达律师事务所组成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）对清算报告进行审计，广东广信君达律师事务所对清算报告出具法律意见。

2. 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	广发集泰债券型证券投资基金	
基金简称	广发集泰债券	
基金主代码	005559	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年7月26日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
最后运作日（2020年7月1日）基金份额总额	19,570,523.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发集泰债券A	广发集泰债券C
下属分级基金的交易代码	005559	005560
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	16,334,074.43份	3,236,448.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	（一）大类资产配置策略；（二）债券投资策略；（三）股票投资策略；（四）资产支持证券投资策略；（五）融资及转融通投资策略；（六）国债期货投资策略；（七）权证投资策略
业绩比较基准	中债总全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

3. 基金运作情况说明

广发集泰债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予广发集泰债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】2257号）准予注册，由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发集泰债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）的规定公开募集，于2018年7月26日成立并正式运作，基金合同生效日基金份额总额为573,764,491.14份。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《广发集泰债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，2020年5月27日起至2020年6月29日止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年6月30日，本基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于广发集泰债券型证券投资基金终止基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年7月1日公布的《关于广发集泰债券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》，本基金最后运作日为2020年7月1日，自2020年7月2日起进入基金财产清算程序。

4. 财务报告

4.1 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：广发集泰债券型证券投资基金

报告截止日：2020年7月1日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2020年7月1日
资产：	
银行存款	30,801,729.63
结算备付金	27,777.78
存出保证金	3,666.50
交易性金融资产	30,546,000.00
应收证券清算款	3,684,068.74
应收利息	110,260.03
资产总计	65,173,502.68
负债：	
应付赎回款	43,770,117.01
应付管理人报酬	40,287.60
应付托管费	11,510.78
应付销售服务费	15,842.12
应付交易费用	450.00
其他负债	49,003.77
负债合计	43,887,211.28
所有者权益：	
实收基金	19,570,523.14
未分配利润	1,715,768.26
所有者权益合计	21,286,291.40
负债和所有者权益总计	65,173,502.68

注1：报告截止日2020年7月1日（基金最后运作日），本基金A类基金份额单位净值为1.0892，基金份额总额为16,334,074.43份；C类基金份额单位净值为1.0799，基金份额总额为3,236,448.71份。

注2：本基金的清算财务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，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

5. 清算事项说明

根据《广发集泰债券型证券投资基金基金合同》约定，自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。2020 年 7 月 1 日为本基金的终止日。本基金的清算期间为自 2020 年 7 月 2 日至 2020 年 7 月 22 日止（以下简称“清算期间”），2020 年 7 月 22 日为本基金的清算期间结束日。

于清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 30,546,000.00 元，全部为债券投资，明细如下：

单位：人民币元

债券名称	债券代码	最后运作日 估值单价	数量 (单位：份)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
18 农发 09	180409	101.82	300,000.00	30,335,496.00	30,546,000.00

以上全部交易性金融资产于 2020 年 7 月 2 日前完成变现，交易费用为人民币 225.00 元，变现产生的金额为人民币 30,641,132.88 元，已于 2020 年 7 月 2 日前划入托管账户。

本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 3,684,068.74 元，款项将于收款时按实际金额划入托管账户。

本基金最后运作日应收利息为人民币 110,260.03 元，其中应收银行存款利息、应收备付金利息和应收保证金利息共计人民币 2,227.15 元，款项将于结息时按实际金额划入托管账户；应收债券利息为人民币 108,032.88 元，款项已于债券卖出时按实际金额划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款为人民币 43,770,117.01 元，该款项已于 2020 年 7 月 22 日前支付完毕。

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 40,287.60 元，该款项已于 2020 年 7 月 22 日前支付完毕。

本基金最后运作日应付托管费为人民币 11,510.78 元，该款项已于 2020 年 7 月 22 日前支付完毕。

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 15,842.12 元，该款项已于 2020 年 7 月 22 日前支付完毕。

本基金最后运作日应付交易费用为人民币 450.00 元，该款项已于 2020 年 7 月 22 日前支付完毕。

本基金最后运作日其他负债为人民币 49,003.77 元，为账户维护费、信息披露费和应付赎回费，已于 2020 年 7 月 22 日前支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元
	自2020年7月2日至2020年7月22日止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
存款利息收入（注1）	4,433.40
投资收益（注2）	197,604.00
公允价值变动损益（注3）（损失以“-”填列）	-210,504.00
其他收入（注4）	149.77
二、费用	
交易费用	225.00
其他费用（注5）	13,742.61
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-22,284.44

注1：存款利息收入系计提的清算期间的银行存款利息和保证金利息。

注2：投资收益系清算期间的债券差价收入。

注3：公允价值变动损益系清算期间的债券投资产生的公允价值变动。

注4：其他收入系投资者在最后运作日申请赎回所产生的基金赎回费收入。

注5：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费、律师费、审计费和账户维护费。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	单位：人民币元
	金额
一、最后运作日基金净资产	21,286,291.40
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-22,284.44
减：基金净赎回金额（于清算期间确认的最后运作日赎回申请）	561,765.90
二、清算结束日基金净资产	20,702,241.06

根据本基金的基金合同约定，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。

6. 备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发集泰债券型证券投资基金清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发集泰债券型证券投资基金基金财产清算之法律意见书》

6.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

6.3 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。

广发集泰债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二〇年八月十八日