

# 天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理 计划清算报告

管理人:天风(上海)证券资产管理有限公司

托管人:招商银行股份有限公司

清算报告出具日:2023年5月30日

清算报告报送日:2023年6月5日

## 一、重要提示

天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由天风（上海）证券资产管理有限公司担任管理人，由招商银行股份有限公司担任托管人。本集合计划是由天风证券天泽5号集合资产管理计划转型而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2020]828号文准予变更。变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自2020年5月14日起《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议》和《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划招募说明书》生效。

依据《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》等相关法律法规的规定以及《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的约定，本集合计划于2023年5月12日终止。

本集合计划从2023年5月13日起进入清算流程，由集合计划管理人、集合计划托管人、大信会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市君泽君（上海）律师事务所成立集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由大信会计师事务所（特殊普通合伙）对本集合计划进行清算审计，北京市君泽君（上海）律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基本情况

产品名称	天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划
产品简称	天泽六个月定开债
产品主代码	970001
运作方式	契约型、定期开放式
集合计划合同生效日	2020年5月14日
集合计划合同存续期	3年

2023年5月12日日 终集合计划份额 总额	2,386,735.49份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现集合计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本集合计划封闭期投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略和资产支持证券投资策略。</p> <p>1、资产配置策略。通过综合研判宏观经济形势、市场流动性及估值等因素，形成对各大类资产的预测和判断，确定各类资产的配置比例，并进行动态调整，提高资产风险调整后收益。</p> <p>2、债券投资策略。主要包括五个方面：（1）通过利率策略确定组合的整体久期，有效控制资产风险；（2）根据不同信用等级资产的相对价值，并通过信用分析，确定信用债投资策略；（3）通过收益率曲线策略进行利率期限结构管理，合理确定不同期限品种的配置比例；（4）通过判断是否存在利差套利空间从而决定是否采取杠杆操作；（5）根据不同的经济形势选择配置可转债来增强债券组合的收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略。基于对发行主体和证券风险收益特征等要素的考察，选择具有投资价值的资产支持证券进行投资。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将增加高流动性的投资品种的配置，满足开放期流动性需求。</p>	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率	
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型基金及股票型集合资产管理计划、混合型基金及混合型集合资产管理计划，高于货币市场基金。	
管理人	天风（上海）证券资产管理有限公司	
托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级集合计划的简称	天泽六个月定开债A	天泽六个月定开债C

下属分级集合计划的交易代码	970001	970002
2023年5月12日日终下属分级集合计划的份额总额	1, 515, 446. 68份	871, 288. 81份

### 三、运作情况概述

天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划由天风证券天泽 5 号集合资产管理计划变更而来。天风证券天泽 5 号集合资产管理计划自 2013 年 3 月 12 日至 2013 年 3 月 14 日募集，经中勤万信会计师事务所有限公司对集合计划进行验资并出具勤信验字[2013]第[11]号验资报告后，于 2013 年 3 月 20 日成立并开始运作，中国证券业协会出具中证协函[2013]310 号备案确认函。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]39 号），天风证券天泽 5 号集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划”，变更后的《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》自 2020 年 5 月 14 日起生效，原《天风证券天泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

根据相关法律法规及《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》的“第五部分集合计划的存续”约定，“本集合计划自《天风证券天泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同》变更、资产管理合同生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自《天风证券天泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同》变更、资产管理合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。如资产管理合同生效之日起 3 年后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。”，本集合计划于 2023 年 5 月 12 日终止，并进入清算程序。

#### 四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年5月12日（最后运作日）

单位：人民币元

项目	金额
<b>资产：</b>	
货币资金	2,667,627.37
结算备付金	1,336.38
存出保证金	4,510.49
资产合计	2,673,474.24
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	551.58
应付托管费	137.88
应付销售服务费	100.15
其他负债	98,210.00
负债总计	98,999.61
<b>净资产：</b>	
实收资金	2,386,735.49
未分配利润	187,739.14
净资产合计	2,574,474.63
负债及净资产总计	2,673,474.24

注：1、报告截止日 2023 年 5 月 12 日(最后运作日)，集合计划份额净值 1.0787 元，集合计划份额总额 2,386,735.49 份。其中 A 类计划份额总额为 1,515,446.68 份，计划份额净值 1.0819 元；C 类计划份额总额为 871,288.81 份，计划份额净值 1.0730 元。

2、货币资金、结算备付金、存出保证金等所列金额包含对应的应计利息，可能与实际结息金额存在细微差异。

3、本集合计划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。本集合计划自最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期

间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自 2023 年 5 月 13 日至 2023 年 5 月 24 日止清算期间，集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、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：

### 1、清算费用

按照《资产管理合同》“第十九部分资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算”的规定，清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划剩余财产中支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日货币资金为人民币 2,667,627.37 元（含货币资金应计利息人民币 1,594.87 元）。

(2) 本集合计划最后运作日结算备付金为人民币 1,336.38 元（含结算备付金应计利息人民币 268.60 元）。

(3) 本集合计划最后运作日结算保证金为人民币 4,510.49 元（含结算保证金应计利息人民币 8.66 元）。

### 3、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币 551.58 元，该款项预计于清算期结束后安排支付；应付托管费为人民币 137.88 元，该款项于 2023 年 5 月 24 日划付；应付销售服务费为人民币 100.15 元，该款项于 2023 年 5 月 24 日划付。

(2) 本集合计划最后运作日应付信息披露费为人民币 80,000.00 元，该款项于 2023 年 5 月 24 日划付。

(3) 本集合计划最后运作日应付银行间账户维护费为人民币 6,200.00 元，该款项于 2023 年 5 月 23 日划付。

(4) 本集合计划最后运作日应付审计费为人民币 12,000.00 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

(5) 本集合计划最后运作日应付汇划费为人民币 10.00 元，该款项预计于

清算期结束后安排支付。产品清算期结束后产生的汇划手续费及后续其他费用由管理人承担。托管账户销户时实际结息金额与账上计提金额的尾差由管理人承担。

#### 4、清算期间损益情况

单位：人民币元

项目	清算期：2023年5月13日至2023年5月24日
一、收益	
1、利息收入（注①）	313.14
收益小计	313.14
二、费用	
4、银行汇划费	25.00
5、其他费用（注②）	10,000.00
费用小计	10,025.00
三、清算期间净收益	-9,711.86

注：①利息收入为自2023年5月13日至2023年5月24日期间的托管账户货币资金利息收入、最低结算备付金利息收入和结算保证金利息收入，该金额为预计金额，可能与实际结息金额存在细微差异。

②其他费用为清算期间计提的清算律师费。

#### 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日（2023年5月12日）集合计划净资产	2,574,474.63
加：清算期间净收益	-9,711.86
减：申购赎回净额	0.00
二、清算期结束日（2023年5月24日）集合计划净资产（注①）	2,564,762.77

注：①资产处置及负债清偿后，于2023年5月24日（清算结束日）本集合计划剩余财产为人民币2,564,762.77元。根据《资产管理合同》约定，依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

2023年5月25日（清算结束日的下一个自然日）至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归集合计划份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率

计算。

为保护投资者利益，加快清盘速度，在需要时集合计划管理人将以自有资金先行垫付尚未收到的结算备付金、结算保证金及利息款项（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。集合计划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结束后返还给集合计划管理人。

#### 6、集合计划财产清算报告的告知安排

本清算报告已经托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向集合计划份额持有人公告。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

（1）《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划清算审计报告》

（2）北京市君泽君（上海）律师事务所关于《天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划清算报告》的法律意见书

### 2、存放地点

上海市虹口区东大名路 678 号 5 楼。

### 3、查阅方式

投资者可访问本管理人公司网站，网址：[www.tfzqam.com](http://www.tfzqam.com)。

天风证券天泽六个月定期开放债券型集合资产管理计划

集合计划财产清算小组

2023 年 5 月 30 日