

广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划 清算报告

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2022年3月21日

报告公告日期：2022年4月27日

目录

1. 重要提示.....	3
2. 集合计划概况.....	4
3. 集合计划运作情况说明.....	6
4. 财务报告.....	7
5. 清算事项说明.....	8
6. 备查文件目录.....	10

1. 重要提示

广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由广发金管家睿利债券1号集合资产管理计划变更而来，并经中国证监会[机构部函[2021]1176号]批准。《广发资管睿利3年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“《集合合同》”或“集合合同”）自2021年10月11日起生效。本集合计划管理人为广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“管理人”），托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“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》等法律法规的规定和《集合合同》的有关约定，2022年2月14日起至2022年3月14日止，本集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会。本次份额持有人大会于2022年3月16日审议并通过了《关于广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划提前终止合同相关事项的议案》。根据管理人于2022年3月17日公布的《关于广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本集合计划从2022年3月18日起进入清算期，管理人按照本集合计划集合合同的约定，组织成立集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序。

2022年3月21日为本集合计划清算的最后一日，由管理人广发证券资产管理（广东）有限公司、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）和上海市通力律师事务所组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，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，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2. 集合计划概况

2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划
集合计划简称	广发资管睿利3年定开债
集合计划主代码	870012
集合计划运作方式	定期开放式
集合计划合同生效日	2021年10月11日
管理人	广发证券资产管理（广东）有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司
最后运作日（2022年3月17日）集合计划份额总额	23,010,853.92份
集合合同存续期	自2021年10月11日起存续期不超过3年

2.2 集合计划产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险和保持集合计划资产流动性的前提下，努力降低组合净值波动率，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。
投资策略	<p>（一）在运作周期</p> <p>1、资产配置策略；2、固定收益类资产投资策略；3、信用债投资策略；4、回购策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略。</p> <p>（二）在自由开放期</p> <p>开放期内，本集合计划为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小集合计划净值的波动。</p>
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%。

风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），属于证券投资基金中的较低预期风险和较低预期收益品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。
--------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------

3. 集合计划运作情况说明

广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划原为广发金管家睿利债券1号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），自2013年4月1日进行推广并于2013年4月9日正式成立，于2013年5月31日获中国证券业协会中证协函[2013]468号文备案确认。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币600,094,190.14元（含利息转份额），折合600,094,190.14份集合计划份额，上述资金经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验。原集合计划原管理人为广发证券股份有限公司，后变更为广发证券资产管理（广东）有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于2018年11月30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）的规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。自2021年10月11日起，《广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《广发金管家睿利债券1号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本集合计划为契约型开放式大集合产品，系管理人依据《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》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。

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》等法律法规的规定和《集合合同》的有关约定，2022年2月14日起至2022年3月14日止，本集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会。本次份额持有人大会于2022年3月16日审议并通过了《关于广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划提前终止合同相关事项的议案》。根据管理人于2022年3月17日公布的《关于广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》和《关于广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》，本集合计划最后运作日为2022年3月17日，从2022年3月18日起进入集合计划财产清算程序。

4. 财务报告

集合计划最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022年3月17日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2022年3月17日
资产：	
银行存款	23,029,398.32
结算备付金	36,635.00
存出保证金	100,552.94
资产总计	23,166,586.26
负债：	
应付管理人报酬	3,218.12
应付托管费	1,072.71
应付销售服务费	21,253.58
其他负债	114,394.76
负债合计	139,939.17
所有者权益：	
实收基金	23,010,853.92
未分配利润	15,793.17
所有者权益合计	23,026,647.09
负债和所有者权益总计	23,166,586.26

注1：报告截止日2022年3月17日（集合计划最后运作日），本集合计划A类份额单位净值为1.0007，本集合计划B类份额单位净值为1.0019，本集合计划C类份额单位净值为0.9995，集合计划份额总额为23,010,853.92份。

注2：本集合计划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。自本集合计划最后运作日起，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《广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定，自出现集合合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。2022年3月17日为本集合计划的最后运作日。本集合计划的清算期间为自2022年3月18日至2022年3月21日止（以下简称“清算期间”），2022年3月21日为本集合计划的清算期间结束日。

于清算期间，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：

5.1 资产处置情况

(1) 本集合计划的银行存款主要包括活期存款及应计利息，于最后运作日余额为人民币23,029,398.32元，截至清算期间结束日余额为人民币23,067,301.30元，于清算期间累计净增加人民币37,902.98元。

(2) 本集合计划的结算备付金主要包括本金及应计利息，于最后运作日余额为人民币36,635.00元，截至清算期间结束日均已收回。

(3) 本集合计划的存出保证金主要包括本金及应计利息，于最后运作日存出保证金余额为人民币100,552.94元，截至清算期间结束日余额为人民币100,194.86元，于清算期间累计净减少人民币358.08元。

5.2 负债清偿情况

(1) 本集合计划的应付管理人报酬主要包括应付基金管理费，于最后运作日及清算期间结束日余额均为人民币3,218.12元，于清算期间无变动。

(2) 本集合计划的应付托管费于最后运作日及清算期间结束日余额均为人民币1,072.71元，于清算期间无变动。

(3) 本集合计划的应付销售服务费于最后运作日及清算期间结束日余额均为人民币21,253.58元，于清算期间无变动。

(4) 本集合计划的其他负债主要包括审计费和信息披露费，于最后运作日余额为人民币114,394.76元，截至清算期间结束日余额为人民币115,301.60元，于清算期间累计净增加人民币906.84元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2022年3月18日 至2022年3月21日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
存款利息收入（注1）	909.90
二、费用	
其他费用（注2）	906.84
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	3.06

注1：存款利息收入系清算期间计提的银行存款利息、备付金利息和保证金利息。

注2：其他费用系清算期间所产生的信息披露费。

5.4 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、最后运作日集合计划净资产	23,026,647.09
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	3.06
二、清算结束日集合计划净资产	23,026,650.15

根据本集合计划的集合合同约定，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 《广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划清算审计报告》

6.1.2 《关于〈广发资管睿利3年定期开放债券型集合资产管理计划清算报告〉的法律意见》

6.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城马场路26号广发证券大厦30-32楼

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至管理人的办公场所免费查阅。

广发资管睿利3年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
二〇二二年四月二十七日