

广发全球收益债券型证券投资基金（QDII） 清算报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告出具日期：2020年7月24日

报告公告日期：2020年9月15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	11

1. 重要提示

广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）（“本基金”）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【2018】596号《关于准予广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）注册的批复》准予募集注册，于2018年9月6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”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

2020年6月3日起至2020年7月6日15:00止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年7月7日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年7月8日公布的《关于广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）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9日起进入清算期。

2020年7月24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	广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）			
基金简称	广发全球收益债券（QDII）			
基金主代码	005912			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2018年9月6日			
基金管理人	广发基金管理有限公司			
基金托管人	中国银行股份有限公司			
最后运作日（2020年7月8日）基金份额总额	7,992,385.64份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	广发全球收益债券人民币（QDII）A	广发全球收益债券美元（QDII）A	广发全球收益债券人民币（QDII）C	广发全球收益债券美元（QDII）C
下属分级基金的交易代码	005912	006950	005913	006951
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	4,719,962.33份	132,576.99份	3,139,779.83份	66.49份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析全球各国和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（一）国家地区配置策略；（二）债券投资策略；（三）资产支持证券投资策略；（四）金融衍生品投资策略。此外，在严格控制风险的前提下，本基金将适度参与证券借贷交易、回购交易等投资以增加投资组合的收益。

业绩比较基准	摩根大通全球债券指数（J.P. Morgan Global Aggregate Bond Index）收益率×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%
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。本基金为境外证券投资的基金，除了需要承担境外市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

3. 基金运作情况说明

广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）（“本基金”）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【2018】596号《关于准予广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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《广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）基金合同》（“基金合同”）发起，于2018年9月6日募集成立。首次设立募集规模为536,044,986.26份基金份额。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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

2020年6月3日起至2020年7月6日15:00止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年7月7日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年7月8日公布的《关于广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）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9日起进入清算期。

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：广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2020年7月8日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2020年7月8日
资产：	
银行存款	2,570,145.39
结算备付金	525,868.73
交易性金融资产	4,929,491.13
应收证券清算款	7,523,971.09
应收利息	41,230.59
资产总计	15,590,706.93
负债：	
应付赎回款	7,427,921.09
应付管理人报酬	2,283.90
应付托管费	713.73
应付销售服务费	385.94
应付税费	542.12
其他负债	48,019.35
负债合计	7,479,866.13
所有者权益：	
实收基金	7,992,385.64
未分配利润	118,455.16
所有者权益合计	8,110,840.80
负债和所有者权益总计	15,590,706.93

注1：报告截止日2020年7月8日（基金最后运作日），本基金人民币A类基金份额单位净值为1.0183，基金份额总额为4,719,962.33份；美元A类基金份额单位净值为0.1450，基金份额总额为132,576.99份；人民币C类基金份额单位净值为1.0094，基金份额总额为3,139,779.83份；美元C类基金份额单位净值为0.1438，基金份额总额为66.49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《广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）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 8 日为本基金的运作终止日。本基金的清算期间为自 2020 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 24 日止（以下简称“清算期间”），2020 年 7 月 24 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

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 525,868.73 元，均为于期货公司开立的结算备付金账户余额。

于最后运作日本基金持仓如下期货。该等期货投资采用当日无负债结算制度，下述期货合约所产生的持仓损益已结算于上述结算备付金账户。

单位：人民币元

期货代码	持仓量（买/卖） （单位：手）	最后运作日 合约成本总额	最后运作日合 约市值总额	公允价值变 动
UCAUO	-9.00	-6,460,554.71	-6,338,700.00	121,854.71
TYUO	-1.00	-984,181.93	-987,582.55	-3,400.62
合计		-7,444,736.64	-7,326,282.55	118,454.09

注：卖出持仓以“-”填列

以上期货于 2020 年 7 月 24 日前完成平仓，相关款项及上述最后运作日结算备付金余额均已于 2020 年 7 月 24 日前划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 4,929,491.13 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 成本总额	最后运作日 估值总额
B 07/14/20	US9127963D91	707,933.50	702,060.87

STANLN 7 1/2 PERP	USG84228CQ91	1,466,730.81	1,463,689.58
GRNLGR 6 3/4 06/25/22	XS2016768439	1,407,329.36	1,424,612.36
INTNED 4 7/8 PERP	XS2122174415	1,404,640.00	1,339,128.32
合计		4,986,633.67	4,929,491.13

以上全部交易性金融资产于2020年7月24日前完成变现，变现产生的证券清算款为人民币4,952,461.84元，已于2020年7月24日前划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币7,523,971.09元，该款项已于2020年7月24日前划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币41,230.59元，其中应收银行存款利息为人民币204.29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41,026.30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

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 7,427,921.09 元，该款项已于 2020 年 7 月 24 日前支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,283.90 元，该款项已于 2020 年 7 月 24 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 713.73 元，该款项已于 2020 年 7 月 24 日前支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 385.94 元，该款项已于 2020 年 7 月 24 日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日应付税费为人民币 542.12 元，该款项已于 2020 年 7 月 24 日前支付完毕。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 48,019.35 元，主要为应付赎回费、信息披露费及其他应付款，该款项已于 2020 年 7 月 24 日前支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2020年7月9日 至2020年7月24日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	8,863.88
公允价值变动损益（注2）（损失以“-”填列）	-61,311.55
投资收益（注3）	55,228.36
汇兑收益（损失以“-”填列）	-34,928.83
其他收入（注4）	13.37
二、费用	
交易费用	277.04
税金及附加	30.74
其他费用（注5）	10,526.72
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-42,969.27

注1：利息收入系计提的清算期间的银行存款利息、债券利息。

注2：公允价值变动损益系清算期间的债券投资及衍生工具产生的公允价值变动。

注3：投资收益系清算期间的债券投资及衍生工具差价收入。

注4：其他收入系投资者于清算期间确认的最后运作日赎回申请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手续费、律师费及审计费。

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、最后运作日基金净资产	8,110,840.80

加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-42,969.27
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）	120,839.03
二、清算结束日基金净资产	7,947,032.50

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。

5.5 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分配。

6. 备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）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。

广发全球收益债券型证券投资基金（QDII）基金财产清算小组

二〇二〇年九月十五日