

广发海外多元配置证券投资基金（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10月20日

报告公告日期：2020年11月27日

目录

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

1. 重要提示

广发海外多元配置证券投资基金（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[2017]2116号《关于准予广发海外多元配置证券投资基金（QDII）注册的批复》准予募集注册，于2018年2月8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8月21日起至2020年9月22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9月23日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止广发海外多元配置证券投资基金（QDII）基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年9月24日公布的《关于广发海外多元配置证券投资基金（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9月25日起进入清算期。

2020年10月20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	广发海外多元配置证券投资基金（QDII）	
基金简称	广发海外多元配置（QDII）	
基金主代码	005557	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年2月8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9月24日）基金份额总额	21,273,685.96份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发海外多元配置人民币（QDII）	广发海外多元配置美元（QDII）
下属分级基金的交易代码	005557	005558
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	5,084,659.29份	16,189,026.67份

2.2 基金产品说明

投资目标	本产品与控制风险与保持资产流动性的基础上，通过资产配置的理论与选择海外ETF与主动管理基金作为主要投资标的，通过全球化的资产配置和组合管理，有效地分散投资风险；在降低组合波动性的同时，实现资产的长期增值。
投资策略	（一）大类资产配置策略，（二）标的基金投资策略，（三）金融衍生品投资策略。此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益。未来，

	随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可以在经监管部门允许，并履行相应程序后，可调整和更新相关投资策略。
业绩比较基准	人民币计价的 MSCI 全球股票指数 (MSCI World Index) 收益率×40% +人民币计价的富时世界国债指数 (FTSE World Government Bond Index) ×60%
风险收益特征	本基金主要投资于境外公募基金，属于中等风险收益水平的证券投资基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

3. 基金运作情况说明

广发海外多元配置证券投资基金 (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【2017】2116 号《关于准予广发海外多元配置证券投资基金 (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《广发海外多元配置证券投资基金 (QDII) 基金合同》 (“基金合同”) 发起，于 2018 年 2 月 8 日募集成立。首次设立募集规模为 243,779,259.23 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 8 月 21 日起至 2020 年 9 月 22 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 9 月 23 日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止广发海外多元配置证券投资基金 (QDII) 基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于 2020 年 9 月 24 日公布的《关于广发海外多元配置证券投资基金 (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 9 月 25 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：广发海外多元配置证券投资基金（QDII）

报告截止日：2020年9月24日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2020年9月24日
资产：	
银行存款	73,064,383.57
交易性金融资产	20,950,778.72
应收利息	1,953.50
资产总计	94,017,115.79
负债：	
应付赎回款	70,135,908.42
应付管理人报酬	89,884.19
应付托管费	14,044.39
应付税费	34,638.97
其他负债	58,502.21
负债合计	70,332,978.18
所有者权益：	
实收基金	21,273,685.96
未分配利润	2,410,451.65
所有者权益合计	23,684,137.61
负债和所有者权益总计	94,017,115.79

注1：报告截止日2020年9月24日（基金最后运作日），本基金人民币基金份额单位净值为1.1133，基金份额总额为5,084,659.29份；美元基金份额单位净值为0.1637，基金份额总额为16,189,026.67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《广发海外多元配置证券投资基金（QDII）基金合同》约定，自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，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 9 月 24 日为本基金的运作终止日。本基金的清算期间为自 2020 年 9 月 25 日至 2020 年 10 月 20 日止（以下简称“清算期间”），2020 年 10 月 20 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) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 20,950,778.72 元，全部为基金投资，明细如下：

单位：人民币元

基金名称	基金代码	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
INCOME PARTNERS MVO HY BD-2B	IPRHY2B HK	10,680,000.00	10,107,658.60
E FUND HK DOLLAR M/M-I A HKD	EFHDMIH HK	9,653,580.00	9,483,975.78
ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BO	SHY US	1,350,627.66	1,359,144.34
合计		21,684,207.66	20,950,778.72

以上全部交易性金融资产于2020年10月20日前完成变现，变现扣除交易费用后产生的金额为人民币20,866,736.89元，已于2020年10月20日前划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币1,953.50元，为应收银行存款利息，该款项将于结息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 70,135,908.42 元，该款项已于 2020 年 10 月 20 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 89,884.19 元，该款项已于 2020 年 10 月 20 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 14,044.39 元，该款项已于 2020 年 10 月 20 日前支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付税费为人民币 34,638.97 元，该款项已于 2020 年 10 月 20 日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 58,502.21 元，主要为应付赎回费及信息披露费，该款项已于 2020 年 10 月 20 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9月25日 至2020年10月20日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	5,290.80
公允价值变动损益（注2）	733,706.76
投资收益（注3）（损失以“-”填列）	-817,275.34
汇兑收益（损失以“-”填列）	-186,891.93
其他收入（注4）	556.57
二、费用	
交易费用	502.19
税金及附加	36.82
其他费用（注5）	10,513.82
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-275,665.97

注1：利息收入主要系清算期间的银行存款利息收入。

注2：公允价值变动损益系清算期间的基金投资产生的公允价值变动。

注3：投资收益系清算期间的基金投资差价收入。

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	23,684,137.61

加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-275,665.97
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）	1,416,343.82
二、清算结束日基金净资产	21,992,127.82

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进行分配。

6. 备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发海外多元配置证券投资基金（QDII）清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发海外多元配置证券投资基金（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。

广发海外多元配置证券投资基金（QDII）基金财产清算小组

二〇二〇年十一月二十七日