

广发量子对冲 19 号资产管理计划清算报告



一、基本情况

广发量子对冲 19 号资产管理计划（以下简称“本计划”）的合同生效日为 2014 年 11 月 21 日，资产管理人为广发基金管理有限公司，资产托管人中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部。本资产管理计划初始募集总份额 30,007,380.00 份。

根据《广发量子对冲 19 号资产管理计划资产管理合同》中关于合同终止的规定，经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致，本计划于 2016 年 5 月 23 日提前终止，进入清算阶段。资产管理人广发基金管理有限公司与资产托管人中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部共同组成清算小组，负责本计划的财产清算工作。

二、本计划终止日财产状况

单位：人民币元

科目名称	期末余额 (2016-05-23)
资产类合计	14,513,418.20
银行存款	13,144,132.26
结算备付金	360,477.14
其中：上交所最低结算备付金	292,107.22
深交所最低结算备付金	68,369.92
存出保证金	47,394.07
其中：上交所存出保证金	22,877.09
深交所存出保证金	24,516.98
停牌股票市值	928,695.00
应收利息	4,338.64
其中：应收银行存款利息	2,962.46
应收上交所最低备付金利息	1,020.55

应收深交所最低备付金利息	222.02
应收上交所存出保证金利息	60.91
应收深交所存出保证金利息	72.7
证券清算款	28,381.09
负债类合计	57,027.63
应付基本管理费	21,689.3
应付托管费	4,337.85
应付销售费用	21,689.30
应付席位佣金	9,311.18
资产净值	14,456,390.57

注： 1、截至 2016 年 5 月 23 日，委托财产份额净值为 1.331, 份额总额 10,859,287.89 份。

2、本计划于合同截止日持有停牌股票昌九生化、博通股份、慧球科技、宁波富邦、万科 A、国农科技、渤海金控、西安旅游、*S 合金、河北宣工、凯瑞德、鼎泰新材、台基股份、中能电气、华仁药业、顺网科技、易世达、上海钢联，停牌详情请查询上市公司公告。

三、 本计划财产清算情况

本计划财产清算期间为 2016 年 5 月 24 日至 2017 年 3 月 20 日，具体情况如下表：

单位：人民币元

项目名称	金额
合同终止日资产净值	14,456,390.57
加：停牌股票变现收益	59,828.08
停牌股票分红收益	671.78
清算期间应收银行存款利息	3733.46
清算期间应收最低清算备付金利息	64.88
清算期间应收交易保证金利息	8.52
减：清算期间银行费用	0.00

停牌股票变现费用	228.86
清算后委托计划财产净额	14,520,468.43

注：根据本计划资产管理合同规定，本计划清算过程中，发生的审计费用、银行汇划费为清算费用，由清算财产承担。

四、 本计划业绩报酬计提与归属委托人财产情况

单位：人民币元

项目名称	金额
清算后委托计划财产净额	14,520,468.43
减：业绩报酬	0.00
归属委托人财产净额	14,520,468.43

注：1、业绩报酬由注册登记机构根据本计划资产管理合同相关规定计算。

五、 归属委托人财产净额支付情况

单位：人民币元

支付时间	分配金额
2016-5-27	13,528,818.78
2016-7-22	227,728.94
2017-3-20	763,920.71
合计	14,520,468.43

注：该支付时间是指委托资产划往销售机构的时间。

五、 其他事项

1、本报告由资产管理人广发基金管理有限公司编制、资产托管人中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部复核。

2、按照本资产管理合同约定，对于资产委托人承担的税收，资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务，资产委托人应按国家有关规定自行缴纳。

3、根据本资产管理合同约定，资产管理人将配合托管人完成证券账户、银行账户等销户工作。待应收应付资金全部结清、账户销户后，资产管理人、资产

托管人职责终止。

资产管理人（盖章）：广发基金管理有限公司



2017 年 3 月 20 日

资产托管人（盖章）：工行广东省分行营业部



2017 年 3 月 20 日