

嘉实理财宝7天债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二〇年十二月三十日

报告公告日期：二〇二一年一月十五日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	3
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	10

1、重要提示

嘉实理财宝7天债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2012]1047号予以核准,于2012年08月29日成立并正式运作。

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》、《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)的有关规定,《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案;连续30个工作日出现前述情形的,基金管理人在履行监管报告和信息披露程序后,本基金份额将自动转换为嘉实货币市场基金份额(此转换事项无须经基金份额持有人大会决议),基金合同终止;基金管理人也有权在履行监管报告和信息披露程序后,决定终止本基金并按照基金合同的约定进行清算,且无需召开基金份额持有人大会。

截至2020年12月18日日终,嘉实理财宝7天债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金资产净值低于5000万元,且本基金已连续30个工作日基金资产净值低于5000万元,嘉实基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”)决定终止《基金合同》,本基金的最后运作日为2020年12月18日。根据基金管理人于2020年12月19日公布的《关于嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》,本基金自2020年12月19日起进入清算程序,由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(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、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实理财宝7天债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实理财宝7天债券	
场内简称	-	
基金主代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年08月29日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
基金最后运作日（2020年12月18日）基金份额总额	13,781,432.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
下属分级基金的交易代码	070035	070036
基金最后运作日（2020年12月18日）下属分级基金份额总额	13,781,432.69份	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	1、整体资产配置策略 根据宏观经济指标（主要包括：市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率等），决定组合的平均剩余期限（长/中/短）和比例分布。根据各类资产的流动性特征（主要包括：平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情

	<p>况、回购抵押数量等），决定组合中各类资产的投资比例。根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别。 2、类别资产配置策略 根据整体策略要求，决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。 3、明细资产配置策略 第一步筛选，根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标（流通总量、日均交易量），决定是否纳入组合。第二步筛选，根据个别债券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）与剩余期限的配比，对照基金的收益要求决定是否纳入组合。第三步筛选，根据个别债券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定投资总量。对于含回售条款的债券，本基金将仅买入距回售日不超过397 天以内的债券，并在回售日前进行回售或者卖出。 4、其他衍生工具投资策略 未来如果法律法规或监管机构允许本基金投资其他衍生工具，在履行适当程序后，本基金将制订符合法律法规及本基金投资目标的投资策略，通过套利或避险交易，控制基金组合风险，谋求收益。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>七天通知存款税后利率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p>

3、基金运作情况说明

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[2012]1047号《关于核准嘉实理财宝7天债券型证券投资基金募集的批复》予以核准,由嘉实基金管理有限公司依照法律法规、基金合同等规定于2012年8月20日至2012年8月24日向社会公开发行募集,基金合同于2012年8月29日正式生效,募集规模为9,528,525,870.62份基金份额。

自2012年8月29日至2020年12月18日期间,本基金按基金合同正常运作。

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》、《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)的有关规定,《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案;连续30个工作日出现前述情形的,基金管理人在履行监管报告和信息披露程序后,本基金份额将自动转换为嘉实货币市场基金份额(此转换事项无须经基金份额持有人大会决议),基金合同终止;基金管理人也有权在履行监管报告和信息披露程序后,决定终止本基金并按照基金合同的约定进行清算,且无需召开基金份额持有人大会。

截至2020年12月18日日终,嘉实理财宝7天债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金资产净值低于5000万元,且本基金已连续30个工作日基金资产净值低于5000万元,嘉实基金管理有限公司决定终止《基金合同》,本基金的最后运作日为2020年12月18日,自2020年12月19日起本基金依法进入基金财产清算程序。

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：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 18 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2020 年 12 月 18 日
资 产：	
银行存款	13,895,434.79
应收利息	76,063.54
其他资产	2,625.00
资产总计	13,974,123.33
负 债 和 所 有 者 权 益	最后运作日 2020 年 12 月 18 日
负 债：	
应付管理人报酬	1,885.62
应付托管费	558.71
应付销售服务费	2,095.14
应付利润	10.00
其他负债	188,141.17
负债合计	192,690.64
所有者权益：	
实收基金	13,781,432.69
未分配利润	-
所有者权益合计	13,781,432.69
负债和所有者权益总计	13,974,123.33

注 1：报告截止日 2020 年 12 月 18 日（基金最后运作日），嘉实理财宝 7 天债券 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 13,781,432.69 份；无嘉实理财宝 7 天债券 B 基金份额。

注 2：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于 2020 年 12 月 18 日（基金最后运作日），所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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。

5、清算事项说明

本基金的清算期间为自2020年12月19日至2020年12月30日止。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 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用等。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算律师费由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日其他资产金额2,625.00元，为托管银行2020年11月扣收的手续费，该手续费金额对万份收益影响较大。为保护持有人利益，此笔款项由嘉实基金管理有限公司承担，已于2020年12月25日划入托管账户。

本基金最后运作日应收活期存款利息为76,063.54元，已于2020年12月21日收回并划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为1,885.62元，该款项已于2020年12月23日支付。

本基金最后运作日应付托管费为558.71元，该款项已于2020年12月23日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费(A类)为2,095.14元，该款项已于2020年12月23日支付。

本基金最后运作日应付利润为10.00元，为终止日当日未分配的收益，此收益将作为基金剩余资产，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

本基金最后运作日其他负债为188,141.17元，包括应付审计费和应付信息披露费。其中应付审计费为85,517.86元，该款项已于2020年12月25日支付，应付信息披露费为102,623.31元，该款项已于2020年12月24日支付。

5.4 清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2020 年 12 月 18 日基金净资产	13,781,432.69
加：清算期间（2020 年 12 月 19 日至 2020 年 12 月 30 日）收入	
1、存款利息收入（注 1）	3,323.24
2、应付利润（注 2）	10.00
减：清算期间（2020 年 12 月 19 日至 2020 年 12 月 30 日）费用	
1、其他费用（注 3）	240.00
减：期间基金份额交易产生的基金净值变动数	
1、基金赎回款（注 4）	21,931.24
二、2020 年 12 月 30 日（清算报告出具日）基金净资产	13,762,594.69

注 1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2020 年 12 月 19 日至 2020 年 12 月 30 日止银行存款的利息。

注 2：应付利润系终止日当日未分配的收益，此收益将作为基金剩余资产，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

注 3：其他费用系自 2020 年 12 月 19 日至 2020 年 12 月 30 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

注 4：基金赎回款系产品于 2020 年 12 月 21 日确认的赎回金额。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2020 年 12 月 30 日，本基金剩余财产为 13,762,594.69 元，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。

自本次清算期结束日次日 2020 年 12 月 31 日至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以

自有资金先行垫付该笔款项（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。基金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期后返还给基金管理人。

5.5 基金财产清算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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并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 嘉实理财宝7天债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司

嘉实基金管理有限公司客服电话：400-600-8800

嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年一月十五日