

嘉实民企精选一年定期开放债券型  
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：中国光大银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二二年四月十一日

报告公告日期：二〇二二年四月十九日

## 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 .....	8
6、备查文件目录 .....	10

## 1、重要提示

嘉实民企精选一年定期开放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[2019]977号予以注册,于2019年12月4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》和《嘉实民企精选一年定期开放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,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人经与基金托管人协商一致,可对本基金进行清算,终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会进行表决。尽管有前述约定,本基金自《基金合同》生效之日起,在任一开放期最后一日日终(登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后),如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,基金管理人经与基金托管人协商一致,基金合同终止,无需召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

本基金在第二个开放期最后一日日终,即2022年1月10日日终,基金资产净值低于5000万元。为保护基金份额持有人利益,嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,决定终止基金合同,并对本基金进行清算。本基金最后运作日为2022年1月17日。基金管理人将自2022年1月18日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见2022年1月14日刊登在《证券时报》及公司网站上的《关于嘉实民企精选一年定期开放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》。

本基金的最后运作日为2022年1月17日,并于2022年1月18日进入清算程序,由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人中国光大银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰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,上海源泰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	嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实民企精选一年定期债券
基金主代码	008118
基金运作方式	契约型，以定期开放的方式运作
基金合同生效日	2019年12月4日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
基金最后运作日（2022年1月17日）基金份额总额	8,781,041.60份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金主要投资于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券，以及资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、国债期货、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

<p>主要投资策略</p>	<p><b>1、封闭期投资策略</b></p> <p>本基金主要投资于民企类债券，本基金将根据民企债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立不同品种的收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：由于市场风险偏好导致利差处于高位的民企债券、行业及融资状况好转而价值尚未被市场充分发现等其他情况的信用债券。债券投资策略具体包括：利率策略、信用债券投资策略（个别债券选择、行业配置、信用风险控制措施）、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略，其他策略包括：国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p><b>2、开放期投资策略</b></p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证综合债指数收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。</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[2019]977号《关于准予嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,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2019年11月18日至2019年12月2日向社会公开发行募集,基金合同于2019年12月4日正式生效,募集规模为286,093,641.04份基金份额。

自2019年12月4日至2022年1月17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》、《嘉实民企精选一年定期开放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,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人经与基金托管人协商一致,可对本基金进行清算,终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会进行表决。尽管有前述约定,本基金自《基金合同》生效之日起,在任一开放期最后一日日终(登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后),如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,基金管理人经与基金托管人协商一致,基金合同终止,无需召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

本基金在第二个开放期最后一日日终,即2022年1月10日日终,基金资产净值低于5000万元。为保护基金份额持有人利益,本基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,决定终止基金合同,并对本基金进行清算。本基金最后运作日为2022年1月17日。本基金管理人将自2022年1月18日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

## 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：嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022年1月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2022年1月17日
<b>资产：</b>	
银行存款	8,636,116.51
结算备付金	448,585.03
存出保证金	4,680.64
交易性金融资产	-
其中：债券投资	-
买入返售金融资产	-
应收利息	-
资产总计	9,089,382.18
负债和所有者权益	最后运作日 2022年1月17日
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	15,032.62
应付托管费	2,505.44
应付交易费用	-
应交税费	3,068.63
其他负债	178,490.00
负债合计	199,096.69
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	8,781,041.60
未分配利润	109,243.89
所有者权益合计	8,890,285.49
负债和所有者权益总计	9,089,382.18

注 1：报告截止日 2022 年 1 月 17 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0124 元，基金份额总额 8,781,041.60 份。

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》、《嘉实民企精选一年定期开放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 2022

年 1 月 17 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

本基金的本次清算期间为自2022年1月18日至2022年4月11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财产清算过程中发生的所有合理费用。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剩余财产中支付。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

本基金最后运作日结算备付金448,585.03元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第2个工作日对结算备付金进行调整，结算备付金款项已于2022年2月8日全部收回并划入托管账户，应计利息已于2022年3月21日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额4,680.64元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第2个工作日对存出保证金进行调整，存出保证金款项已于2022年2月8日全部收回并划入托管账户，应计利息已于2022年3月21日收回。

本基金最后运作日应收银行存款利息为21,706.74元，已于2022年3月21日收回。

### 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为 15,032.62 元，该款项已于 2022 年 2 月 9 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 2,505.44 元，该款项已于 2022 年 2 月 9 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 178,490.00 元，为预提审计费、预提信息披露费、应付上清所账户维护费、应付中债登账户维护费、应付中债登结算服务费和交易手续费。其中，预提审计费为 55,000.00 元，该款项已于 2022 年 2 月 10 日支付；预提信息披露费为

120,000.00 元, 该款项已于 2022 年 2 月 10 日支付; 应付上清所账户维护费 1,600.00 元, 该款项已于 2022 年 1 月 24 日支付; 应付中债登账户维护费 1,500.00 元, 该款项已于 2022 年 1 月 24 日支付; 应付中债登结算服务费为 270.00 元, 该款项已于 2022 年 1 月 24 日支付; 应付交易手续费为 120.00 元, 该款项尚未支付。

#### 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 2022 年 1 月 17 日基金净资产	8,890,285.49
加: 清算期间 (2022 年 1 月 18 日至 2022 年 4 月 11 日) 收入	15,240.74
1、存款利息收入 (注 1)	15,240.74
二、2022 年 4 月 11 日 (清算报告出具日) 基金净资产	8,905,526.23

注 1: 存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2022 年 1 月 18 日至 2022 年 4 月 11 日止银行存款、结算备付金、存出保证金的利息。

资产处置及负债清偿后, 截至本次清算期结束日 2022 年 4 月 11 日, 本基金剩余财产为 8,905,526.23 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 (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, 本基金的清算律师费用将由基金管理人承担)、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 2022 年 4 月 12 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 基金资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 嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金资产清算的法律意见书

### 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

嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年四月十一日