嘉实如意宝定期开放债券型
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：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二一年十月二十二日

报告公告日期：二〇二一年十月二十八日

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.....11

1、重要提示

嘉实如意宝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[2013]290号《关于核准嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金募集的批复》准予募集，于2013年6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》、《嘉实如意宝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，“本基金自基金合同生效之日起，有下列情形之一的，基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人在履行监管报告和信息披露程序后，可以终止本基金并按照本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。

1、基金合同生效后，开放期期满时，基金份额持有人数量不满200人的；

2、基金合同生效后，开放期期满时，基金资产净值低于5000万元的；

3、基金合同生效后，开放期期满时，基金前10大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额90%的。”

本基金在第八个开放期期满时，基金资产净值低于5000万元。为保护基金份额持有人利益，我司嘉实基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报备中国证监会，决定终止《基金合同》，本基金的最后运作日为2021年9月30日。本基金管理人自2021年10月8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2021年9月29日刊登在《证券时报》及公司网站上的《关于嘉实如意宝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2021年9月30日，并于2021年10月8日进入清算程序，由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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	嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实如意宝定期债券	
基金主代码	000113	
基金运作方式	契约型，以定期开放方式运作	
基金合同生效日	2013 年 6 月 4 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
基金最后运作日（2021 年 9 月 30 日）基金份额总额	29,710,155.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
下属分级基金的交易代码	000113	000115
基金最后运作日（2021 年 9 月 30 日）下属分级基金份额总额	25,611,152.62 份	4,099,002.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金谋求本金稳妥和稳定收益，在此基础上力争较高回报。
投资范围	本基金投资于国内依法发行或上市的债券、货币市场工具，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）。 本基金主要投资于短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、国债、央行票据、债券回购、银行存款等固定收益类资产。 本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金可持有因投资分离交易可转债而产生的权证，对因此持有的权证，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。 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。 基金的投资组合比例为：除每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期外，本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

	如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金追求本金安全的风险控制目标和收益稳定递增的产品运作风格，定期满足投资人的变现需求。本基金运用“嘉实下行风险波动模型”控制组合较低波动幅度。在此基础上，本基金将深刻的基本面研究、严谨的债券分析与主动的投资风格相结合，通过“自上而下”的宏观研究与“自下而上”的微观分析，挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会，确定和调整基金资产在非信用类固定收益类证券（国债、央行票据、政策性金融债等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例，力争持续稳定的收益，并择机少量投资可转债，谋求增强收益。 具体包括：资产配置策略、组合风险控制措施、信用债券投资策略、其他债券投资策略、资产支持证券（含资产收益计划）投资策略、可转债投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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[2013]290号《关于核准嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金募集的批复》准予募集，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2013年5月13日至2013年5月31日向社会公开发行募集，基金合同于2013年6月4日正式生效，募集规模为1,716,729,965.15份基金份额。

自2013年6月4日至2021年9月30日期间，嘉实如意宝定期开放债券型证券投资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》、《嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，“本基金自基金合同生效之日起，有下列情形之一的，基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人在履行监管报告和信息披露程序后，可以终止本基金并按照本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。

1、基金合同生效后，开放期期满时，基金份额持有人数量不满200人的；

2、基金合同生效后，开放期期满时，基金资产净值低于5000万元的；

3、基金合同生效后，开放期期满时，基金前10大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额90%的。

法律法规另有规定时，从其规定。”

本基金在第八个开放期期满时，基金资产净值低于5000万元。为保护基金份额持有人利益，本基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报备中国证监会，决定对本基金进行清算，本基金最后运作日2021年9月30日。自2021年10月8日起，本基金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

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

报告截止日： 2021 年 9 月 30 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2021 年 9 月 30 日
资 产：	
银行存款	744,137.26
结算备付金	940,966.38
存出保证金	12,483.21
交易性金融资产	29,988,000.00
其中：债券投资	29,988,000.00
买入返售金融资产	4,000,000.00
应收利息	258,723.11
应收证券清算款	3,086.35
资产总计	35,947,396.31
负债和所有者权益	**最后运作日 2021 年 9 月 30 日**
负 债：	
应付管理人报酬	39,329.32
应付托管费	11,236.96
应付销售服务费	1,594.72
应付交易费用	27,266.67
其他负债	173,054.21
其中：应付律师费	20,000.00
其中：应付审计费	50,000.00
其中：应付信息披露费	89,754.21
其中：应付银行间账户维护费	12,400.00
其中：应付银行手续费	900.00
负债合计	252,481.88
所有者权益：	
实收基金	29,710,155.12
未分配利润	5,984,759.31
所有者权益合计	35,694,914.43
负债和所有者权益总计	35,947,396.31

注 1：报告截止日 2021 年 9 月 30 日(基金最后运作日)，嘉实如意宝定期债券 A/B 基

金份额净值 1.205 元，基金份额总额 25,611,152.62 份；嘉实如意宝定期债券 C 基金份额净值 1.182 元，基金份额总额 4,099,002.50 份。基金份额总额合计为 29,710,155.12 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》、《嘉实如意宝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 2021 年 9 月 30 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2021年10月8日至2021年10月22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。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日债券投资为29,988,000.00元,其中210206 CY 市值20,012,000.00元，为银行间政策性金融债；210211CY 市值9,976,000.00元，为银行间政策性金融债。两笔债券于2021年10月12日卖出变现并结算，结算金额合计30,267,796.85元。

本基金最后运作日买入返售金融资产为4,000,000.00元，为2021年9月30日成交的204001 SH交易所逆回购首期。该资产于2021年10月11日到期并结算，结算金额合计4,000,415.34元。

本基金最后运作日结算备付金金额940,966.38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。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,2021年10月11日调出860,966.38元至银行存款,截至报告日剩余80,000.00元暂未收回。

本基金最后运作日存出保证金金额12,483.21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。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，2021年10月11日由银行存款调入57.11元，截至报告日剩余12,540.32元未收回。

本基金最后运作日应收利息为258,723.11元，其中应收活期存款利息为304.26元，应收结算备付金利息423.40元，应收存出保证金利息5.60元，应收债券利息260,690.41元，于2021年10月12日债券变现时结算，应收买入返售金融资产利息-2,700.56元,于

2021 年 10 月 11 日买入返售金融资产到期时结算。截至报告日活期存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息暂未收回。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为 39,329.32 元，该款项已于 2021 年 10 月 12 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 11,236.96 元，该款项已于 2021 年 10 月 12 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为 1,594.72 元，该款项已于 2021 年 10 月 12 日支付。

本基金最后运作日应付交易费用为 27,266.67 元，为应付银行间交易费用，该款项已于 10 月 21 日已全部支付。另外，本基金清算期间因债券变现产生银行间交易费用 375.00 元，截至报告日尚未支付。

本基金最后运作日其他负债金额 173,054.21 元，为预提律师费、审计费、信息披露费、银行汇划手续费以及银行间账户维护费。其中，预提律师费为 20,000.00 元，该款项截至报告日尚未支付；预提审计费为 50,000.00 元，该款项截至报告日尚未支付；预提信息披露费为 89,754.21 元，该款项截至报告日尚未支付；预提银行汇划费为 900.00 元，该款项截至报告日尚未支付；预提银行间账户维护费为 12,400.00 元，其中 10 月 21 日支付 9,300.00 元，剩余 3,100.00 元尚未支付。

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 2021 年 9 月 30 日基金净资产	35,694,914.43
加：清算收入计提期间（2021 年 10 月 1 日至 2021 年 10 月 22 日）收入	
利息收入（注 1）	29,679.25
公允价值变动损益（注 2）	17,880.00
投资收益（注 3）	-19,990.00
减：清算费用（注 4）	375.00
二、2021 年 10 月 22 日（清算报告出具日）基金净资产	35,722,108.68

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2021 年 10 月 1 日至 2021 年 10 月 22 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、买入返售证券利息收入以及债券利息收入。

注 2：公允价值变动损益系持有债券公允价值变动产生的损益。

注 3：投资收益系债券变现产生的投资收益。

注 4：清算费用系 2021 年 10 月 12 日债券变现产生的银行间交易费用。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2021 年 10 月 22 日,本基金剩余财产为 35,722,108.68 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，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后剩余资产具有同等的分配权。

自本次清算期结束日次日 2021 年 10 月 23 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 嘉实如意宝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 关于《嘉实如意宝定期开放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

嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年十月二十二日