

嘉实价值增强灵活配置混合型  
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：二〇一九年二月一日

报告公告日期：二〇一九年三月二十日

## 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 .....   | 8 |

## 1、重要提示

嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2015]1917号予以核准注册,于2016年12月13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》、《嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金管理人于2018年9月26日发布了《嘉实基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,并于2018年11月1日以通讯方式召开基金份额持有人大会,基金份额持有人大会审议并表决通过了《关于嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》,决定终止《基金合同》,基金自2018年11月2日起进入清算程序。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见刊登在2018年11月2日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上的《嘉实基金管理有限公司关于嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金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2018年11月2日起进入清算期,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)和北京市天元律师事务所律师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,北京市天元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                      | 嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称                      | 嘉实价值增强混合            |
| 基金主代码                     | 002221              |
| 基金运作方式                    | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日                   | 2016年12月13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（2018年11月1日）基金份额总额 | 12, 103, 068. 27    |
| 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，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、大类资产配置</li> <li>2、股票投资策略</li> <li>3、债券投资策略</li> <li>4、中小企业私募债券投资策略</li> <li>5、衍生品投资策略</li> <li>6、资产支持证券投资策略</li> <li>7、风险管理策略</li> </ol> |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。   |

### 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[2015]1917号《关于准予嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,并经机构部函[2016]2197号《关于嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》确认,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2016年11月4日至2016年12月7日向社会公开发行募集,基金合同于2016年12月13日正式生效,募集规模为250,158,646.45份基金份额。

自2016年12月13日至2018年11月1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》、《嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金于2018年11月1日以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议并表决通过了《关于嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》,决定终止《基金合同》,本基金自2018年11月2日起进入清算程序。

## 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：嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年11月1日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产            | 最后运作日<br>2018年11月1日 |
|---------------|---------------------|
| <b>资产：</b>    |                     |
| 银行存款          | 12,253,758.96       |
| 存出保证金         | 404.67              |
| 应收利息          | 10,308.81           |
| 股票投资          | 657,396.00          |
| 资产总计          | 12,921,868.44       |
| 负债和所有者权益      | 最后运作日<br>2018年11月1日 |
| <b>负债：</b>    |                     |
| 应付管理人报酬       | 6,703.47            |
| 应付托管费         | 1,117.26            |
| 其他负债          | 106,200.00          |
| 负债合计          | 114,020.73          |
| <b>所有者权益：</b> |                     |
| 实收基金          | 12,103,068.27       |
| 未分配利润         | 704,779.44          |
| 所有者权益合计       | 12,807,847.71       |
| 负债和所有者权益总计    | 12,921,868.44       |

注1：报告截止日2018年11月1日（基金最后运作日），基金份额净值1.058元，基金份额总额12,103,068.27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》、《嘉实价值增强灵活配置混合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2018年11月1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2018年11月2日至2019年2月1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

本基金最后运作日存出保证金金额404.67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，该款项已于2018年11月2日收回95.15元并划入托管账户、于2018年12月4日收回111.16元并划入托管账户、于2019年01月03日支付13.06元并划出托管账户，截至2019年1月30日尚有211.42未收回，由基金管理人垫付，供清盘使用。

本基金最后运作日应收利息为10,308.81元，其中应收活期存款利息为10,307.61元，应收结算保证金利息1.20元。结算保证金利息已分别于2018年12月21日、2018年12月24日结息收回并划入托管账户。

本基金最后运作日交易性金融资产市值为657,396.00元，系停牌股票万达电影（代码：002739 SZ）657,396.00元，该资产已于2018年11月9日处置完毕，产生投资收益40,022.00元。

### 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为6,703.47元，该款项已于2018年11月5日、2018年11月22日支付。

本基金最后运作日应付托管费为1,117.26元，该款项已于2018年11月5日、2018年11月23日支付。

本基金最后运作日其他负债为106,200.00元，为预提银行间账户维护费、预提律师费、预提审计费、预提信息披露费、预提持有人大会费，其中，预提中央国债登记结算有

限责任公司账户维护费为 3,000.00 元, 该款项已于 2018 年 11 月 21 日支付; 预提上海清算所账户维护费为 3,200.00 元, 该款项已于 2018 年 11 月 27 日支付; 预提律师费为 10,000.00 元, 该款项已于 2018 年 11 月 14 日支付; 预提持有人大会费为 40,000.00 元, 该款项已于 2018 年 11 月 9 日支付 10,000.00 元、2018 年 11 月 14 日支付 30,000.00 元; 预提审计费 25,000.00 元, 该款项已于 2019 年 1 月 7 日支付; 预提证券时报信息披露费 15,000.00 元, 该款项已于 2019 年 1 月 29 日支付; 预提上海证券报信息披露费 10,000.00 元, 该款项已于 2019 年 1 月 29 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 2018 年 11 月 1 日基金净资产                 | 12,807,847.71 |
| 加: 清算期间 (2018 年 11 月 2 日至 2019 年 2 月 1 日) 收入 |               |
| 利息收入 (注 1)                                   | 23,590.95     |
| 投资收益 (注 2)                                   | 40,022.00     |
| 减: 清算费用 (注 3)                                | 435.00        |
| 减: 交易费用 (注 4)                                | 1,247.49      |
| 减: 基金净赎回金额 (2018 年 11 月 2 日确认的投资者赎回申请)       | 1.05          |
| 二、2019 年 2 月 1 日 (清算报告出具日) 基金净资产             | 12,869,777.12 |

注: 1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2018 年 11 月 2 日至 2019 年 2 月 1 日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。

2、投资收益系自 2018 年 11 月 2 日至至 2019 年 2 月 1 日止清算期间处置未变现资产发生的损益。

3、清算费用系自 2018 年 11 月 2 日至至 2019 年 2 月 1 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

4、交易费用系自 2018 年 11 月 2 日至至 2019 年 2 月 1 日止清算期间的处置未变现资产发生的交易费用。

资产处置及负债清偿后, 截至本次清算期结束日至 2019 年 2 月 1 日, 本基金剩余财产为 12,869,777.12 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 2018 年 2 月 2 日至清算款项支付日的银行汇划手续费由基金份额持有人承担。

自本次清算期结束日次日 2018 年 2 月 2 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 嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金基金财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

嘉实客服电话：400-600-8800

嘉实价值增强灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一九年二月一日