

嘉实合润双债两年期定期开放债券型
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：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇一九年十月三十日

报告公告日期：二〇一九年十二月十日

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	7
6、备查文件目录	10

1、重要提示

嘉实合润双债两年期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]847号予以核准注册, 经机构部函[2016]3121号《关于嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》确认, 进行募集, 并于2017年7月20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》、《嘉实合润双债两年期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的任一自由开放期期满之日, 基金资产净值低于 5000 万元的, 基金管理人经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, 可以作为终止本基金合同的事由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。

截至本年度自由开放期期满日(2019年7月26日)日终, 本基金基金资产净值已低于 5000万元, 基金管理人与基金托管人协商一致决定终止《基金合同》, 本基金触发上述基金合同终止情形。为维护基金份额持有人利益, 根据《基金合同》约定, 本基金进入基金财产清算程序, 无需召开基金份额持有人大会审议。自2019年8月17日起, 本基金进入基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见刊登在2019年8月16日《证券日报》及公司网站上的《关于嘉实合润双债两年期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》。

本基金从2019年8月17日起进入清算期, 由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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	嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实合润双债两年期定期债券
基金主代码	000269
基金运作方式	契约型开放式,以定期开放方式运作
基金合同生效日	2017年7月20日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金最后运作日(2019年8月16日)基金份额总额	34,443,722.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期总回报最大化,以谋求长期保值增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1. 固定收益类资产配置策略 2. 信用债券投资策略 3. 可转债投资策略 4. 中小企业私募债券投资策略 5. 投资决策
业绩比较基准	三年期定期存款基准利率(税后)+1.25%
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]847号《关于核准嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,经机构部函 [2016]3121号《关于嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》确认,进行募集。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2017年4月17日至2017年7月14日向社会公开发行募集,基金合同于2017年7月20日正式生效,募集规模为335,221,776.45份基金份额。

自2017年7月20日至2019年8月16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》、《基金合同》的有关规定,本基金自基金合同生效之日起的任一自由开放期期满之日,基金资产净值低于 5000 万元的,基金管理人经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,可以作为终止本基金合同的事由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。

截至本年度自由开放期期满日(2019年7月26日)日终,本基金基金资产净值已低于5000万元,基金管理人与基金托管人协商一致决定终止《基金合同》,本基金触发上述基金合同终止情形。为维护基金份额持有人利益,根据《基金合同》约定,本基金进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。自2019年8月17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（已经审计）

会计主体：嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年8月16日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2019年8月16日
资产：	
银行存款	35,111,625.33
结算备付金	2,134,957.18
存出保证金	10,668.82
应收利息	44,885.23
资产总计	37,302,136.56
负债和所有者权益	最后运作日 2019年8月16日
负债：	
应付管理人报酬	11,405.02
应付托管费	3,258.56
应付销售服务费	8,146.44
应付交易费用	3,562.74
其他负债	114,300.00
负债合计	140,672.76
所有者权益：	
实收基金	34,443,722.87
未分配利润	2,717,740.93
所有者权益合计	37,161,463.80
负债和所有者权益总计	37,302,136.56

注 1：报告截止日 2019 年 8 月 16 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.079 元，基金份额总额 34,443,722.87 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》、《嘉实合润双债两年期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 2019 年 8 月 16 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

5、清算事项说明

本基金的清算期间为自2019年8月17日至2019年10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，本基金的清算律师费用将由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日结算备付金2,134,957.18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,该款项已分别于2019年9月3日收回2,075,866.27元、2019年10月9日收回59,090.91元并划入托管账户。

本基金最后运作日存出保证金金额10,668.82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2019年9月3日收回10,668.82元并划入托管账户。

本基金最后运作日应收利息为44,885.23元，其中应收活期存款利息为23,835.50元，应收结算备付金利息21,037.68元，应收结算保证金利息12.05元。上述活期存款利息、结算备付金利息、结算保证金利息已分别于2019年9月21日、2019年9月23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 11,405.02 元,该款项已于 2019 年 8 月 21 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 3,258.56 元,该款项已于 2019 年 8 月 21 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为 8,146.44 元,该款项已于 2019 年 8 月 21 日支付。

本基金最后运作日应付交易费用 3,562.74 元，该款项已分别于 2019 年 8 月 29 日支付 2,610.00 元，2019 年 10 月 24 日支付 952.74 元。

本基金最后运作日其他负债为 114,300.00 元，为预提银行间账户维护费、预提审计费、预提信息披露费。其中，预提中央国债登记结算有限公司账户维护费 4,500.00 元，该款项已于 2019 年 8 月 29 日支付 3,000.00 元，故将差额部分冲回，计入基金资产的收入；预提上海清算所账户维护费 4,800.00 元，该款项已于 2019 年 8 月 29 日支付 3,200.00 元，故将差额部分冲回，计入基金资产的收入；预提证券时报信息披露费 80,000.00 元，该款项已于 2019 年 9 月 3 日支付；预提审计费 25,000.00 元，该款项已于 2019 年 9 月 17 日支付。

5.3 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 2019 年 8 月 16 日基金净资产	37,161,463.80
加：清算期间（2019 年 8 月 17 日至 2019 年 10 月 30 日）收入	
1、利息收入（注 1）	56,804.86
2、其他收入（注 2）	3,100.00
减：清算期间（2019 年 8 月 17 日至 2019 年 10 月 30 日）费用	
3、清算费用（注 3）	53.00
二、2019 年 10 月 30 日（清算报告出具日）基金净资产	37,221,315.66

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2019 年 8 月 17 日至 2019 年 10 月 30 日止银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

2、清算期间已确认上海清算所、中央国债登记结算有限公司根据实际销户时间确定收取的费用少于已预提的银行间账户维护费，故将差额部分冲回，计入基金资产的收入。

3、清算费用系自 2019 年 8 月 17 日至 2019 年 10 月 30 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2019 年 10 月 30 日，本基金剩余财产为 37,221,315.66 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）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 2019 年 10 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。

5.4 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 嘉实合润双债两年期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 嘉实合润双债两年期定期开放债券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

嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一九年十月三十日