

嘉实保证金理财场内实时申赎 货币市场基金 清算报告

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二一年六月四日

报告公告日期：二〇二一年六月八日

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	7
6、备查文件目录	10

1、重要提示

嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2013]1196号予以核准,于2013年12月11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《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的有关规定,本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”)经与本基金的基金托管人北京银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议终止《基金合同》有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2021年4月21日起,至2021年5月20日17:00止(送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准),并于2021年5月21日表决通过了《关于嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金终止基金合同有关事项的议案》。

根据基金管理人于2021年5月22日公布的《关于嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金自2021年5月22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、基金托管人北京银行股份有限公司、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律师组成基金资产清算组履行基金资产清算程序,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	嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金	
基金简称	嘉实宝A/B	
基金主代码	519808	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月11日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
基金最后运作日（2021年5月21日）基金份额总额	4,193,806,990.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实宝A	嘉实宝B
下属分级基金的交易代码	519808	519809
基金最后运作日（2021年5月21日）下属分级基金份额总额	4,193,806,990.00份	0份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据宏观经济指标（主要包括：利率水平、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），决定债券组合的剩余期限（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、机构投资者持有情况、回购抵押数量、分拆转换进程），决定组合中各类资产的投资比例。

嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金清算报告

	具体包括：整体资产配置策略、类别资产配置策略、明细资产配置策略。
业绩比较基准	人民币活期存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金

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]1196号《关于核准嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金募集的批复》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2013年12月4日至2013年12月6日向社会公开发行募集,基金合同于2013年12月11日正式生效,募集规模为3,322,693,288.00份基金份额。

自2013年12月11日至2021年5月21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》和《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司经与本基金的基金托管人北京银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议终止《基金合同》有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2021年4月21日起,至2021年5月20日17:00止(送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准),并于2021年5月21日表决通过了《关于嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金终止基金合同有关事项的议案》。根据基金管理人于2021年5月22日公布的《关于嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金自2021年5月22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：嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金

报告截止日：2021年5月21日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2021年5月21日
资产：	
银行存款_活期	30,951,375.48
银行存款_协议	10,000,000.00
结算备付金	746,696.78
存出保证金	227,151.98
应收利息	84,015.47
资产总计	42,009,239.71
负债和所有者权益	最后运作日 2021年5月21日
负债：	
应付托管费	2,069.89
应付销售服务费_A 份额	6,468.39
应付交易费用	1,795.00
应付增值服务费_A 份额	9,055.78
预提费用	51,780.75
负债合计	71,169.81
所有者权益：	
实收基金	41,938,069.90
负债和所有者权益总计	42,009,239.71

注 1：报告截止日 2021 年 5 月 21 日(基金最后运作日)，嘉实宝 A 基金份额净值 0.0100 元，基金份额总额 4,193,806,990.00 份；嘉实宝 B 基金份额净值 0.0000 元，基金份额总额 0.00 份。基金份额总额合计为 4,193,806,990.00 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》、《嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金合同》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 5 月 21 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5月22日至2021年6月4日止。基金资产清算组对本基金的资产、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

清算费用是指基金资产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金资产清算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

本基金最后运作日协议存款余额10,000,000.00元，其中存放于兴业银行股份有限公司济南分行5,000,000.00元，存放于上海浦东发展银行股份有限公司北京丰台支行5,000,000.00元。以上两笔定存已分别于2021年5月26日、2021年5月27日到期并划入托管账户。

本基金最后运作日结算备付金金额746,696.78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，截至报告日该款项暂未全部收回。

本基金最后运作日存出保证金金额227,151.98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，截至报告日该款项暂未全部收回。

本基金最后运作日应收利息为84,015.47元，其中应收活期存款利息为20,613.42元，应收最低备付金利息1,497.85元，应收结算保证金利息515.50元，应收协议存款利息61,388.70元。上述应收协议存款利息已于2021年5月26日、27日收回并划入托管账户，截至报告日活期存款利息、最低备付金利息、结算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托管费为2,069.89元，该款项已于2021年5月25日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费（A类份额）为6,468.39元，该款项已于2021年

5月25日支付。

本基金最后运作日应付增值服务费（A类份额）为9,055.78元，该款项已于2021年5月25日支付。

本基金最后运作日应付交易费用为1,795.00元，含应付中央国债登记结算有限责任公司结算服务费235.00元，应付上海清算所结算服务费940.00元，应付中国外汇交易中心交易费用620.00元。截至报告日上述费用尚未支付。

本基金最后运作日预提费用为51,780.75元，为预提审计费和信息披露费。预提审计费为17,259.90元，已于2021年6月2日支付，预提信息披露费为34,520.85元，截至报告日尚未支付。

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5月21日基金净资产	41,938,069.90
加：清算期间（2021年5月22日至2021年6月4日）收入	
利息收入（注1）	14,385.09
减：清算期间（2021年5月22日至2021年6月4日）费用	
其他费用（注2）	16.00
二、2021年6月4日（清算报告出具日）基金净资产	41,952,438.99

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年5月22日至2021年6月4日止活期存款、协议存款、结算备付金、存出保证金的利息。

注2：其他费用系自2021年5月22日至2021年6月4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2021年6月4日，本基金剩余财产为41,952,438.99元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金资产清算的分配方案，将基金资产清算后的全部剩余资产扣除基金资产清算费用、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。同一类别的基金份额持有人对基金资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6月5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 嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金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

嘉实客服电话：400-600-8800

嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金资产清算组

二〇二一年六月四日