

嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券 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：二〇二五年九月十七日

报告公告日期：二〇二五年九月二十六日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	3
3、基金运作情况说明	6
4、财务报告	7
5、清算事项说明	9
6、备查文件目录	12

1、重要提示

嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金(以下简称“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[2017]1438号予以注册,于2018年2月9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《嘉实润和量化6个月定期开放混合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中国建设银行股份有限公司协商一致,决定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2025年8月14日起至2025年8月27日17:00止(纸面表决票以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间为准,电话投票及短信投票以基金管理人系统记录时间为准),并于2025年8月28日表决通过了《关于嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金终止基金合同的议案》。

根据基金管理人于2025年8月29日公布的《关于嘉实润和量化6个月定期开放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》,本基金自2025年8月29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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、容诚会计师事务所(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,并由容诚会计师事务所(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	嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金
基金简称	嘉实润和量化定期混合
基金主代码	005166
基金运作方式	定期开放式
基金合同生效日	2018年2月9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（2025年8月28日）基金份额总额	16,111,206.01份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金投资于依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、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）。</p> <p>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>

	<p>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0-30%。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或中国证监会允许，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。</p>
主要投资策略	<p>（一）封闭期投资策略：本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略：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>
业绩比较基准	中债总财富指数收益率×70%+中证500指数收益率×30%。

风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
--------	---

3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可[2017]1438号《关于准予嘉实润和量化6个月定期开放混合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2018年1月18日起向社会公开发行募集，基金合同于2018年2月9日正式生效，募集规模为690,077,541.77份基金份额。

自2018年2月9日至2025年8月28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《基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定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2025年8月14日起至2025年8月27日17:00止（纸面表决票以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间为准，电话投票及短信投票以基金管理人系统记录时间为准），并于2025年8月28日表决通过了《关于嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金终止基金合同的议案》。根据基金管理人于2025年8月29日公布的《关于嘉实润和量化6个月定期开放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》，本基金自2025年8月29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：嘉实润和量化 6 个月定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 8 月 28 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2025 年 8 月 28 日
资产：	
货币资金	1,734,905.94
结算备付金	10,980.07
存出保证金	471.10
交易性金融资产	1,222.13
其中：债券投资	1,222.13
应收证券清算款	16,606,698.69
资产合计	18,354,277.93
负债和净资产	最后运作日 2025 年 8 月 28 日
负债：	
应付管理人报酬	13,070.74
应付托管费	2,178.47
应交税费	0.06
其他负债	315.00
负债合计	15,564.27
净资产：	
实收基金	16,111,206.01
未分配利润	2,227,507.65
净资产合计	18,338,713.66
负债和净资产总计	18,354,277.93

注 1：报告截止日 2025 年 8 月 28 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.1383 元，基金份额总额 16,111,206.01 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》、《嘉实润和量化 6 个月定期开放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 2025 年 8 月 28 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2025年8月29日至2025年9月17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。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，本基金清算期间的清算律师费和清算审计费由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日货币资金金额1,734,905.94元，其中包含应计活期存款利息为5,516.12元，前述利息将于2025年9月22日收回。

本基金最后运作日结算备付金金额10,980.07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本金和应计利息以及存放在东证期货有限公司的期货备付金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第6个工作日对结算备付金进行调整，存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金应计利息将于2025年9月23日收回。存放于东证期货有限公司的期货备付金已于2025年8月29日收回，期货备付金应计利息已于2025年9月1日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额471.10元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金本金和应计利息。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，存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金应计利息将于2025年9月23日收回。

本基金最后运作日交易性金融资产为债券投资。债券投资金额为1,222.13元人民币（最后运作日估值市值），截至2025年8月29日已全部变现，变现资金1,214.75元人民币已划入托管账户。

本基金最后运作日应收证券清算款为16,606,698.69元，该款项已于2025年8月29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 13,070.74 元，该款项已于 2025 年 9 月 3 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 2,178.47 元，该款项已于 2025 年 9 月 3 日支付。

本基金最后运作日应付税费为 0.06 元，该款项已于 2025 年 9 月 8 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 315.00 元，为应付交易费用，该款项尚未支付。

5.4 清算期间的损益情况

项目	金额
一、最后运作日 2025 年 8 月 28 日基金净资产	18,338,713.66
加：清算期间（2025 年 8 月 29 日至 2025 年 9 月 17 日）收入	3,558.07
1、存款利息收入（注 1）	3,565.45
2、投资收益（注 2）	76.43
3、公允价值变动损益（注 3）	-83.81
二、2025 年 9 月 17 日（清算报告出具日）基金净资产	18,342,271.73

单位：人民币元

注 1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2025 年 8 月 29 日至 2025 年 9 月 17 日止银行存款、结算备付金、存出保证金的利息。

注 2：投资收益系最后运作日未变现债券 2025 年 8 月 29 日至 2025 年 9 月 17 日止处置取得的投资收益扣除处置过程中发生的交易费用、债券投资产生的利息收入。

注 3：公允价值变动损益系最后运作日未变现债券自 2025 年 8 月 29 日至 2025 年 9 月 17 日止结转的公允价值变动损益。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2025 年 9 月 17 日，本基金剩余财产为 18,342,271.73 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，本基金清算期间的清算律师费和清算审计费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 2025 年 9 月 18 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 嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 上海源泰律师事务所关于嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金清算事宜之法律意见

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

嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二五年九月十七日