

嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二六年十月十二日

报告公告日期：二〇二六年十月二十一日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	4
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

嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金(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[2020]2154号予以注册,于2021年6月7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《嘉实丰年一年定期开放纯债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:“基金合同生效后,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,基金管理人经与基金托管人协商一致,可对本基金进行清算,终止本基金合同,无需召开基金份额持有人大会进行表决。

尽管有前述约定,本基金自基金合同生效之日起,在任一开放期最后一日日终(登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后),如基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元,基金管理人经与基金托管人协商一致,有权决定终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”

根据《关于嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金第五个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告》,本基金的第五个开放期为2026年8月17日(含该日)至2026年9月11日(含该日)。在第五个开放期最后一日(即2026年9月11日)日终(登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后),本基金基金资产净值低于5000万元。根据基金合同约定,嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致,决定终止基金合同,并对本基金进行清算。本基金最后运作日为2026年9月14日。基金管理人自2026年9月15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。

本基金基金合同终止及财产清算安排详见2026年9月15日刊登在《中国证券报》及公司网站上的《关于嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

本基金的最后运作日为2026年9月14日,并于2026年9月15日进入清算程序,由本基金

管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（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，并由德勤华永会计师事务所（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	嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实丰年一年定期纯债债券	
基金主代码	010254	
基金运作方式	定期开放式	
基金合同生效日	2021年6月7日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
基金最后运作日（2026年9月14日）基金份额总额	20,130,480.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实丰年一年定期纯债债券A	嘉实丰年一年定期纯债债券C
下属分级基金的交易代码	010254	010255
基金最后运作日（2026年9月14日）下属分级基金份额总额	17,504,426.32份	2,626,054.45份

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，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金主要投资于债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、国债期货等，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）。 本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 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。
主要投资策略	1、封闭期投资策略 （1）债券投资策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，力争获取较高的投资收益。 1）利率策略，2）信用债券投资策略，3）期限结构配置策略，4）骑乘策略，5）息差策略 （2）资产支持证券投资策略 （3）国债期货投资策略 2、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。
业绩比较基准	中债信用债总财富(1年以下)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可[2020]2154号《关于准予嘉实丰年一年定期开放纯债债券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2021年3月3日至2021年6月2日向社会公开发行募集，基金合同于2021年6月7日正式生效，募集规模为245,295,513.57份基金份额。

自2021年6月7日至2026年9月14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，“基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对本基金进行清算，终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。尽管有前述约定，本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，基金管理人经与基金托管人协商一致，有权决定终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

本基金的第五个开放期为2026年8月17日（含该日）至2026年9月11日（含该日）。在第五个开放期最后一日（即2026年9月11日）日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），本基金基金资产净值低于5000万元。根据基金合同约定，基金管理人经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，决定终止基金合同，并对本基金进行清算。本基金最后运作日为2026年9月14日。基金管理人自2026年9月15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。

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：嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 9 月 14 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2026 年 9 月 14 日
资 产：	
货币资金	22,466,221.03
结算备付金	442,906.61
存出保证金	15,930.70
应收申购款	80,972.68
资产合计	23,006,031.02
负债和净资产	最后运作日 2026 年 9 月 14 日
负 债：	
应付赎回款	989,861.96
应付管理人报酬	2,682.88
应付托管费	894.30
应付销售服务费	543.58
其他负债	139,671.41
负债合计	1,133,654.13
净资产：	
实收基金	20,130,480.77
未分配利润	1,741,896.12
净资产合计	21,872,376.89
负债和净资产总计	23,006,031.02

注 1：报告截止日 2026 年 9 月 14 日（基金最后运作日），嘉实丰年一年定期纯债债券 A 基金份额净值 1.0893 元，基金份额总额 17,504,426.32 份；嘉实丰年一年定期纯债债券 C 基金份额净值 1.0680 元，基金份额总额 2,626,054.45 份。基金份额总额合计为 20,130,480.77 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》、《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 2026 年 9 月 14 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2026年9月15日至2026年10月12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。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日货币资金金额22,466,221.03元，其中包含应计活期存款利息为112,795.32元，前述利息已于2026年9月21日收回。

本基金最后运作日结算备付金金额442,906.61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。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已于2026年9月21日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额15,930.70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已于2026年9月21日收回。

本基金最后运作日应收申购款为80,972.68元，该款项已于2026年9月15日收回。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款为989,861.96元，该款项已于2026年9月15日和2026年9月16日支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬为2,682.88元，该款项已于2026年9月16日支付。

本基金最后运作日应付托管费为894.30元，该款项已于2026年9月16日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为543.58元，该款项已于2026年9月16日支付。

本基金最后运作日其他负债为 139,671.41 元，为应付赎回费、结算服务费、交易手续费、预提账户维护费、预提律师费、预提审计费和预提信息披露费。其中，应付赎回费为 0.01 元，该款项已于 2026 年 9 月 15 日支付；结算服务费为 15,910.00 元，该款项已于 2026 年 9 月 23 日支付；交易手续费为 6,967.51 元，该款项尚未支付；预提账户维护费 9,300.00 元，该款项已于 2026 年 9 月 23 日支付；预提律师费为 15,000.00 元，该款项尚未支付；预提审计费为 8,000.00 元，该款项尚未支付；预提信息披露费为 84,493.89 元，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 2026 年 9 月 14 日基金净资产	21,872,376.89
加：清算期间（2026 年 9 月 15 日至 2026 年 10 月 12 日）收入	12,177.51
1、存款利息收入（注 1）	12,177.51
二、2026 年 10 月 12 日（清算报告出具日）基金净资产	21,884,554.40

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 2026 年 9 月 15 日至 2026 年 10 月 12 日止银行存款、结算备付金、存出保证金的利息以及申购款利息。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2026 年 10 月 12 日，本基金剩余财产为 21,884,554.40 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该类别基金份额的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持有的每一份基金份额就本类别基金份额的剩余资产享有同等分配权。

自本次清算期结束日次日 2026 年 10 月 13 日至清算款项支付日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金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分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 上海市通力律师事务所关于《嘉实丰年一年定期开放纯债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

嘉实丰年一年定期开放纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年十月十二日