

# 嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年十月九日

报告公告日期：二〇二四年十月十八日

## 目 录

1、重要提示 .....	2
2、基金概况 .....	3
3、基金运作情况说明 .....	6
4、财务报告 .....	7
5、清算事项说明 .....	9
6、备查文件目录 .....	11

## 1、重要提示

嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金(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[2021]2271号予以注册,于2021年9月8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《嘉实策略机遇混合型发起式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,基金合同生效之日起三年后的对应日(指自然日),若基金资产净值低于两亿元的,基金合同自动终止,无需召开基金份额持有人大会审议决定,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金的基金合同生效日为2021年9月8日,基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年9月8日。截至2024年9月8日日终,本基金的基金资产净值低于两亿元人民币,触发上述《基金合同》约定的终止情形,《基金合同》自动终止,基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2024年9月8日。本基金管理人自2024年9月9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。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见2024年9月9日刊登在《中国证券报》及公司网站上的《关于嘉实策略机遇混合型发起式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2024年9月8日,并于2024年9月9日进入清算程序,由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(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,并由安永华明会计师事务所(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	嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实策略机遇混合发起式	
基金主代码	013055	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年9月8日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
基金最后运作日（2024年9月8日）基金份额总额	11,064,198.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实策略机遇混合发起式A	嘉实策略机遇混合发起式C
下属分级基金的交易代码	013055	013056
基金最后运作日（2024年9月8日）下属分级基金份额总额	10,310,872.13份	753,326.11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，通过把握动态并比较分析行业景气度，精选景气行业中的优质投资标的，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资范围	本基金投资于国内依法发行上市的股票（包含创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转

	<p>债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权、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>本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务。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:股票资产的比例为基金资产的60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%。本基金应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p>
主要投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略,在深度研究的基础上,发挥行业比较选择和精选个股的优势。</p> <p>具体投资策略包括:资产配置策略、股票投资策略(行业配置策略、股票投资策略、港股通投资策略、存托凭证投资策略)、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资策略、风险管理策略。</p>
业绩比较基准	<p>中证800指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×10%</p>
风险收益特征	<p>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债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票,一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的</p>

	风险。
--	-----

### 3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可[2021]2271号《关于准予嘉实中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》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9月6日向社会公开发行募集，基金合同于2021年9月8日正式生效，募集规模为10,908,213.13份基金份额。

自2021年9月8日至2024年9月8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，基金合同生效之日起三年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金的基金合同生效日为2021年9月8日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年9月8日。截至2024年9月8日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2024年9月8日。本基金管理人自2024年9月9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：嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年9月8日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年9月8日
<b>资产：</b>	
货币资金	1,260,612.69
结算备付金	29,433.22
存出保证金	2,554.26
交易性金融资产	3,888,643.97
其中：股票投资	3,888,643.97
<b>资产合计</b>	<b>5,181,244.14</b>
负债和净资产	最后运作日 2024年9月8日
<b>负债：</b>	
应付清算款	52.31
应付赎回款	411,915.88
应付管理人报酬	1,389.39
应付托管费	231.56
应付销售服务费	37.34
其他负债	73,910.22
<b>负债合计</b>	<b>487,536.70</b>
<b>净资产：</b>	
实收基金	11,064,198.24
未分配利润	-6,370,490.80
<b>净资产合计</b>	<b>4,693,707.44</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>5,181,244.14</b>

注 1：报告截止日 2024 年 9 月 8 日（基金最后运作日），嘉实策略机遇混合发起式 A 基金份额净值 0.4246 元，基金份额总额 10,310,872.13 份；嘉实策略机遇混合发起式 C 基金份额净值 0.4195 元，基金份额总额 753,326.11 份。基金份额总额合计为 11,064,198.24 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》、《嘉实策略机遇混合型发起式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 2024 年 9 月

8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2024年9月9日至2024年10月9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

本基金最后运作日结算备付金金额29,433.22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2024年9月23日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额2,554.26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2024年9月23日收回。

本基金最后运作日货币资金金额1,260,612.69元，其中包含应收活期存款利息为830.33元，前述利息已于2024年9月21日收回。

本基金最后运作日交易性金融资产为股票投资。股票投资金额为3,888,643.97元人民币（最后运作日估值市值），截至2024年10月8日已全部变现，变现资金3,979,300.45元人民币已划入托管账户。

### 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付清算款为52.31元，该款项已于2024年9月9日支付。

本基金最后运作日应付赎回款为411,915.88元，该款项已于2024年9月9日和2024年9月10日支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬为1,389.39元，该款项预计于2024年10月10日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 231.56 元，该款项预计于 2024 年 10 月 10 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为 37.34 元，该款项预计于 2024 年 10 月 10 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 73,910.22 元，为预提银行手续费、赎回费、佣金、审计费、律师费。其中，预提银行手续费为 400.00 元，该款项截至 2024 年 10 月 9 日支付 130.00 元，剩余款项尚未支付；赎回费为 10.92 元，该款项已于 2024 年 9 月 9 日支付；佣金为 6,499.30 元，该款项预计于 2024 年 10 月 11 日支付；应付 2023 年度审计费和预提清算审计费合计为人民币 52,000.00 元，该款项尚未支付；律师费为 15,000.00 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 2024 年 9 月 8 日基金净资产	4,693,707.44
加：清算期间（2024 年 9 月 9 日至 2024 年 10 月 9 日）收入	88,783.67
1、存款利息收入（注 1）	1,061.59
2、投资收益（注 2）	-63,749.80
3、公允价值变动损益（注 3）	151,471.88
减：清算期间（2024 年 9 月 9 日至 2024 年 10 月 9 日）费用	2.21
1、其他费用（注 4）	2.21
二、2024 年 10 月 9 日（清算报告出具日）基金净资产	4,782,488.90

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 2024 年 9 月 9 日至 2024 年 10 月 9 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股票自 2024 年 9 月 9 日至 2024 年 10 月 9 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、股票投资产生的股利收益与股息红利税。

注 3：公允价值变动损益系最后运作日未变现股票自 2024 年 9 月 9 日至 2024 年 10 月 9 日止结转的公允价值变动损益。

注 4：其他费用系最后运作日未变现股票中的存托凭证、深港通持仓自 2024 年 9 月 9 日至 2024 年 10 月 9 日止产生的存托服务费、深港通证券组合费。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2024 年 10 月 9 日，本基金剩余财产

为 4,782,488.90 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各类别基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日 2024 年 10 月 10 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 嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于《嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金清算报告》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

嘉实基金管理有限公司客服电话：400-600-8800

嘉实策略机遇混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二四年十月九日