

嘉实方舟一年持有期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：招商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二五年七月二十八日

报告公告日期：二〇二五年八月六日

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

嘉实方舟一年持有期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[2022]2199号予以注册,于2023年6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》和《嘉实方舟一年持有期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,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,基金合同终止,无需召开基金份额持有人大会进行表决。

截至2025年7月4日日终,本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。根据《基金合同》的上述约定,本基金管理人终止基金合同并进行基金财产清算,无需召开基金份额持有人大会。本基金最后运作日为2025年7月4日,自2025年7月5日起,本基金进入基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及财产清算安排详见2025年7月5日刊登在《证券时报》及公司网站上的《关于嘉实方舟一年持有期混合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2025年7月4日,并于2025年7月5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	嘉实方舟一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实方舟一年持有期混合	
基金主代码	016824	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年6月20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（2025年7月4日）基金份额总额	16,886,904.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实方舟一年持有期混合A	嘉实方舟一年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	016824	016825
基金最后运作日（2025年7月4日）下属分级基金份额总额	16,137,980.10份	748,924.52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（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品）、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）。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。 本基金的投资组合比例为：投资于股票资产、可转换债券和可交换债券的合计比例占基金资产的10%-30%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的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。本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的20%。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。
主要投资策略	资产配置策略：本基金将根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、政策面、资金面等多种因素综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，在控制风险的前提下，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 债券和资产支持证券投资策略：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。 股票投资策略：本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合，精选行业和个股的策略。以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种。 衍生品投资策略：本基金的衍生品投资将严格遵守中国证监会及

	相关法律法规的约束，合理利用股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品等衍生工具，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、股票期权、国债期货合约、信用衍生品进行交易，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。
业绩比较基准	中债总财富(总值)指数收益率 $\times$ 80%+中证800指数收益率 $\times$ 15%+恒生指数收益率 $\times$ 5%（人民币计价）
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和债券型基金，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风险。

3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可[2022]2199号《关于准予嘉实方舟一年持有期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2023年3月17日起向社会公开发行募集，基金合同于2023年6月20日正式生效，募集规模为278,825,105.32份基金份额。

自2023年6月20日至2025年7月4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，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

截至2025年7月4日日终，本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。根据《基金合同》的上述约定，本基金管理人终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。本基金最后运作日为2025年7月4日，自2025年7月5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：嘉实方舟一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 7 月 4 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2025 年 7 月 4 日
资 产：	
货币资金	4,698,320.42
结算备付金	49,212.71
存出保证金	6,299.28
交易性金融资产	14,030,362.91
其中：债券投资	12,086,725.31
股票投资	1,943,637.60
应收申购款	1.00
资产合计	18,784,196.32
负债和净资产	最后运作日 2025 年 7 月 4 日
负 债：	
应付赎回款	957,500.92
应付管理人报酬	1,229.78
应付托管费	307.44
应付销售服务费	76.53
应交税费	146.87
其他负债	93,163.80
负债合计	1,052,425.34
净资产：	
实收基金	16,886,904.62
未分配利润	844,866.36
净资产合计	17,731,770.98
负债和净资产总计	18,784,196.32

注 1：报告截止日 2025 年 7 月 4 日（基金最后运作日），嘉实方舟一年持有期混合 A 基金份额净值 1.0504 元，基金份额总额 16,137,980.10 份；嘉实方舟一年持有期混合 C 基金份额净值 1.0420 元，基金份额总额 748,924.52 份。基金份额总额合计为 16,886,904.62 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》、

《嘉实方舟一年持有期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 7 月 4 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7月5日至2025年7月28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金额49,212.71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、存放在中粮期货有限公司的期货备付金以及存放在永安期货股份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22日收回。存放于中粮期货有限公司的期货备付金已于2025年7月7日收回。存放于永安期货股份有限公司的期货备付金和应计利息已于2025年7月7日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额6,299.28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22日收回。

本基金最后运作日货币资金金额4,698,320.42元，其中包含应计活期存款利息为347.45元，前述利息将于2025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和债券投资。股票投资金额为1,943,637.60元人民币（最后运作日估值市值），截至2025年7月9日已全部变现，变现资金1,938,034.67元人民币已划入托管账户。债券投资金额为12,086,725.31元人民币（最后运作日估值市值），截至2025年7月8日已全部变现，变现资金12,087,754.66元人民币

已划入托管账户。

本基金最后运作日应收申购款1.00元，该款项已于2025年7月7日划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款为 957,500.92 元，该款项已于 2025 年 7 月 8 日支付完毕。

本基金最后运作日应付管理人报酬为 1,229.78 元，该款项已于 2025 年 7 月 10 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 307.44 元，该款项已于 2025 年 7 月 10 日支付。

本基金最后运作日应交税费为 146.87 元，该款项已于 2025 年 7 月 8 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为 76.53 元，该款项已于 2025 年 7 月 10 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 93,163.80 元，为预提银行手续费、交易费用、审计费、信息披露费。其中，预提已发生但尚未支付的银行手续费为 685.06 元，于清算期间计提银行手续费 135.00 元，该款项已于 2025 年 7 月 7 日支付 745.06 元，剩余款项 75.00 元将于 2025 年 8 月 7 日支付；应付交易费用 23,122.24 元，清算期间发生应付交易费用人民币 1,020.22 元，该款项已于 2025 年 7 月 23 日前支付完毕。应付 2024 年度审计费和预提清算审计费合计为人民币 31,000.00 元，该款项尚未支付；应付信息披露费为 38,356.50 元，该款项尚未支付。

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 2025 年 7 月 4 日基金净资产	17,731,770.98
加：清算期间（2025 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 28 日）收入	-2,871.34
1、存款利息收入（注 1）	3,751.41
2、投资收益（注 2）	109,334.58
3、公允价值变动损益（注 3）	-115,957.33
减：清算期间（2025 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 28 日）费用	12,535.00
1、其他费用（注 4）	12,535.00
减：清算期间 2025 年 7 月 7 日确认的净赎回（注 5）	520.11
二、2025 年 7 月 28 日（清算报告出具日）基金净资产	17,715,844.53

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 7 月 5 日至 2025 年 7 月 28 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、债券自 2025 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 28 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入、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股票、债券自 2025 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 28 日止结转的公允价值变动损益。

注 4：其他费用系自 2025 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 28 日止的银行手续费合计 135.00 元，2025 年 4 月至 7 月银行间账户维护费合计 12,000.00 元，以及 2025 年 4 月至 7 月银行间查询服务费 400.00 元。

注 5：2025 年 7 月 7 日确认的净赎回为 520.11 元。其中产品申购 1.00 元，该款项已于 2025 年 7 月 8 日结算，产品赎回 521.11 元，该款项已于 2025 年 7 月 9 日结算。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2025 年 7 月 28 日，本基金剩余财产为 17,715,844.53 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将由基金管理人承担）、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。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

自本次清算期结束日次日 2025 年 7 月 29 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 基金资产清算的公告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 嘉实方舟一年持有期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方舟一年持有期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

嘉实方舟一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二五年七月二十八日