

嘉实中证500成长估值交易型开放式指数 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：中国银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二三年三月三十一日

报告公告日期：二〇二三年四月十四日

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	8
6、备查文件目录	11

1、重要提示

嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2019]1454号予以注册,于2020年3月16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《嘉实中证500成长估值交易型开放式指数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》并终止上市有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2022年12月28日起至2023年1月30日17:00止(纸面表决票以表决票收件人收到表决票时间为准,电话投票以基金管理人系统记录时间为准),并于2023年1月31日表决通过了《关于嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。

根据基金管理人于2023年2月1日公布的《关于嘉实中证500成长估值交易型开放式指数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2023年2月1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财产清算组履行基金财产清算程序,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	嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证500成长估值ETF
场内简称	500成长
扩位场内简称	500成长ETF
基金主代码	515510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年3月16日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金最后运作日（2023年1月31日）基金份额总额	9,534,005.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年5月6日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同）。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权等），债券资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及

	<p>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。</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>本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p>
<p>投资策略</p>	<p>股票投资策略：本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。</p> <p>在正常市场情况下，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%，如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。</p> <p>金融衍生品投资策略：为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。</p> <p>融资：在条件许可的情况下，本基金可在不改变基金既有投资目标、</p>

嘉实中证 500 成长估值交易型开放式指数证券投资基金清算报告

	投资策略和风险收益特征并在充分考虑风险控制的前提下，根据相关法律法规审慎参与融资。
标的指数和业绩比较基准	本基金的标的指数为中证500成长估值指数，业绩比较基准为中证500成长估值指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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[2019]1454号《关于准予嘉实回报精选混合型证券投资基金变更注册的批复》予以注册,嘉实回报精选混合型证券投资基金变更注册为嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金。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2020年2月3日至2020年3月6日向社会公开发行募集,基金合同于2020年3月16日正式生效,募集规模为235,534,005.00份基金份额。

自2020年3月16日至2023年1月31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《嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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中国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》并终止上市有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2022年12月28日起至2023年1月30日17:00止(纸面表决票以表决票收件人收到表决票时间为准,电话投票以基金管理人系统记录时间为准),并于2023年1月31日表决通过了《关于嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。根据基金管理人于2023年2月1日公布的《关于嘉实中证500成长估值交易型开放式指数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2023年2月1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：嘉实中证 500 成长估值交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2023 年 1 月 31 日
资 产：	
银行存款	227,701.04
结算备付金	170,693.59
存出保证金	6,679.60
交易性金融资产	13,436,425.08
其中：股票投资	13,436,425.08
资产总计	13,841,499.31
负债和净资产	最后运作日 2023 年 1 月 31 日
负 债：	
应付管理人报酬	5,683.38
应付托管费	1,136.70
其他负债	61,055.93
负债合计	67,876.01
净资产：	
实收基金	9,534,005.00
未分配利润	4,239,618.30
净资产合计	13,773,623.30
负债和净资产总计	13,841,499.31

注 1：报告截止日 2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日），嘉实中证 500 成长估值交易型开放式指数证券投资基金的基金份额净值 1.4447 元，基金份额总额 9,534,005.00 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》、《嘉实中证 500 成长估值交易型开放式指数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 2023 年 1 月 31 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2023年2月1日至2023年3月31日止。基金财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

清算费用是指基金财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，清算费用应由基金财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费用由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日结算备付金金额170,693.59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，结算备付金款项已于2023年2月8日收回，应计利息已于2023年3月21日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额6,679.60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，存出保证金款项已于2023年3月2日收回，应计利息已于2023年3月21日收回。

本基金最后运作日应收银行存款利息为193.53元，已于2023年3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，金额为13,436,425.08元（最后运作日估值市值），截至2023年2月2日全部处置完毕。卖出股票成交金额共计人民币13,589,945.78元，证券清算款截至2023年2月3日全部由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为5,683.38元，该款项已于2023年2月3日支

付。

本基金最后运作日应付托管费为 1,136.70 元，该款项已于 2023 年 2 月 3 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 61,055.93 元，为预提审计费、应付指数使用费和应付交易费用。其中，预提审计费为 59,600.00 元，该款项已于 2023 年 3 月 8 日支付完毕；应付指数使用费为 1,373.93 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付；应付交易费用为 82.00 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付。

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 2023 年 1 月 31 日基金净资产	13,773,623.30
加：清算期间（2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日）收入	161,172.36
1、存款利息收入（注 1）	7,651.66
2、投资收益（注 2）	848,731.43
3、公允价值变动损益（注 3）	-695,210.73
减：清算期间（2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日）费用	23,670.28
1、交易费用（注 4）	23,630.28
2、其他费用（注 5）	40.00
二、2023 年 3 月 31 日（清算报告出具日）基金净资产	13,911,125.38

注 1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 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 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日止处置取得的投资收益。

注 3：公允价值变动损益系最后运作日未变现股票自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日止结转的股票公允价值变动。

注 4：交易费用系最后运作日未变现股票自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日止处置过程中发生的交易费用。

注 5：其他费用系自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 3 月 31 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 2023 年 3 月 31 日，本基金剩余财产

为 13,911,125.38 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费用由基金管理人承担）、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 2023 年 4 月 1 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分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资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

嘉实基金管理有限公司客服电话：400-600-8800

嘉实中证500成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金资产清算组

二〇二三年三月三十一日