

嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型  
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：二〇二三年五月二十五日

报告公告日期：二〇二三年六月五日

## 目 录

1、重要提示 .....	2
2、基金概况 .....	3
3、基金运作情况说明.....	4
4、财务报告 .....	6
5、清算事项说明 .....	8
6、备查文件目录 .....	11

## 1、重要提示

嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2015]2380号予以注册,于2017年7月4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《嘉实中小企业量化活力灵活配置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》相关事宜。本次基金份额持有人大会表决投票时间自**2023年3月31日**起至**2023年4月28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5月4日**表决通过了《关于嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。

根据基金管理人于**2023年5月5日**公布的《关于嘉实中小企业量化活力灵活配置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**2023年5月5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、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资产清算组履行基金资产清算程序,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	嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	嘉实中小企业量化活力灵活配置混合
基金主代码	004536
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月4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（2023年5月4日）基金份额总额	12,472,416.71份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用积极、主动的量化投资策略，以中小企业经营、发展和创新的内在活力为研究基础，通过系统的专业性研究分析，积极挖掘符合经济规律及产业发展规律的优质中小企业所蕴含的投资机会，在严控投资风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资范围	本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：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），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（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、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、大额存单、银行存款等固定收益类资产以及现金，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>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>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0-95%，本基金投资于本基金界定的中小企业类股票占非现金基金资产的比例不低于80%；在扣除股指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；股指期货、权证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>
投资策略	<p>本基金立足于中国资本市场独特的变化，利用综合评价对中小企业经营、发展和创新的内在活力进行由点到面的多层次量化分析，构建包含中小企业投资价值、成长性、创新力、经营质量、管理层模式以及企业文化等方面的全方位投资策略，优选增长潜力最大的中小企业股票进行投资。具体投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略（包括对中小企业的定义以及多层次的量化投资策略、构建最优的投资组合）、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略等。</p>
业绩比较基准	中证1000指数*95%+中证综合债券指数*5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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[2015]2380号《关于准予嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》予以注册，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2017年4月11日至2017年6月28日向社会公开发行募集，基金合同于2017年7月4日正式生效，募集规模为233,331,386.71份基金份额。

自2017年7月4日至2023年5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《嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型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建设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》有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2023年3月31日起至2023年4月28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5月4日表决通过了《关于嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。根据基金管理人于2023年5月5日公布的《关于嘉实中小企业量化活力灵活配置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2023年5月5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：嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年5月4日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2023年5月4日
<b>资产：</b>	
货币资金	15,956,956.27
结算备付金	0.89
存出保证金	6,723.04
交易性金融资产	490,494.91
其中：股票投资	289,403.40
债券投资	201,091.51
应收申购款	100.30
<b>资产总计</b>	<b>16,454,275.41</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>最后运作日 2023年5月4日</b>
<b>负债：</b>	
应付赎回款	11,419.60
应付管理人报酬	26,462.02
应付托管费	4,410.31
其他负债	73,848.13
<b>负债合计</b>	<b>116,140.06</b>
<b>净资产：</b>	
实收基金	12,472,416.71
未分配利润	3,865,718.64
<b>净资产合计</b>	<b>16,338,135.35</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>16,454,275.41</b>

注1：报告截止日2023年5月4日（基金最后运作日），嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金的基金份额净值1.310元，基金份额总额12,472,416.71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》、《嘉实中小企业量化活力灵活配置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

2023年5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2023年5月5日至2023年5月25日止。基金资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0.89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的应计利息和存放于东证期货的结算备付金的应计利息。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的应计利息预计于2023年6月21日至2023年6月22日收回，存放于东证期货的结算备付金的应计利息预计于期货账户销户日期收回。

本基金最后运作日存出保证金金额6,723.04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，存出保证金本金款项预计于2023年6月2日全部收回并划入托管账户，应计利息预计于2023年6月21日至2023年6月22日收回。

本基金最后运作日应收银行存款利息为9,719.55元，预计于2023年6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，金额为490,494.91元（最后运作日估值市值），其中股票投资金额为289,403.40元，债券投资金额为201,091.51元，截至2023年5月5日全部处置完毕。本基金卖出股票成交总额287,565.68元，对应股票成本总额404,338.12元，对应交易费用总额508.51元，实现买卖股票差价收入-117,280.95元；本基金卖出债券成交总额201,194.52元，对应债券成本总额199,756.00元，对应应收利息总额1,222.52元，实现买卖债券差价收入216.00元。

本基金最后运作日应收申购款100.30元，为存放于嘉实基金直销中心申购款的应计利息，预计于2023年6月末收回。

### 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为26,462.02元，该款项已于2023年5月8日支付。

本基金最后运作日应付托管费为4,410.31元，该款项已于2023年5月8日支付。

本基金最后运作日应付赎回款为11,419.60元，该款项已于2023年5月5日和2023年5月8日支付。

本基金最后运作日其他负债为73,848.13元，为预提审计费、应付交易费用和应付赎回费。其中，预提审计费为73,684.32元，该款项已于2023年5月24日支付；应付交易费用为134.44元，该款项已于2023年5月8日支付；应付赎回费为29.37元，该款项已于2023年5月5日和2023年5月8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5月4日基金净资产	16,338,135.35
加：清算期间（2023年5月5日至2023年5月25日）收入	1,164.31
1、存款利息收入（注1）	3,315.68
2、投资收益（注2）	-117,053.94
3、公允价值变动损益（注3）	114,810.72
4、其他收入（注4）	91.85
减：清算期间（2023年5月5日至2023年5月25日）费用	115.00
1、其他费用（注5）	115.00
减：期间基金份额交易产生的基金净值变动数	144,609.61
1、基金赎回款	144,609.61
二、2023年5月25日（清算报告出具日）基金净资产	16,194,575.05

注1：存款利息收入系以当前适用的利率计提的自2023年5月5日至2023年5月25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2023年5月5日至2023年5月25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、债券自 2023 年 5 月 5 日至 2023 年 5 月 25 日止结转的公允价值变动。

注 4：其他收入系自 2023 年 5 月 5 日至 2023 年 5 月 25 日止清算期间的赎回费归资产收入。

注 5：其他费用系自 2023 年 5 月 5 日至 2023 年 5 月 25 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 5 月 25 日，本基金剩余财产为 16,194,575.05 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，本基金的清算律师费用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 2023 年 5 月 26 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 嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型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

嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金基金资产清算组

二〇二三年五月二十五日