

嘉实中证金边中期国债交易型开放式
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：二〇二二年七月八日

报告公告日期：二〇二二年七月二十一日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	3
3、基金运作情况说明	5
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

嘉实中证金边中期国债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[2013]153号予以核准,于2013年5月10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《嘉实中证金边中期国债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5月12日起至2022年6月13日17:00止(送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准),并于2022年6月14日表决通过了《关于嘉实中证金边中期国债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2022年6月15日公布的《关于嘉实中证金边中期国债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2022年6月15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。根据基金管理人于2022年6月17日发布的《关于嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金终止上市交易的公告》,本基金于2022年6月22日终止上市。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证中期国债ETF
场内简称	国债ETF
基金主代码	159926
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年5月10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（2022年6月14日）基金份额总额	62,698.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年8月5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，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%，年跟踪误差不超过3%。
投资范围	本基金投资范围主要为标的指数成份券和备选成份券。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的80%。 此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于衍生工具（国债期货）、其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资

	<p>产、现金资产、以及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>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>投资策略</p>	<p>本基金主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的成份券及备选成份券，或选择非成份券作为替代，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所和银行间债券交易特性及交易惯例等情况，通过“久期匹配”、“信用等级匹配”、“期限匹配”等优化策略对基金资产进行抽样化调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量控制跟踪误差最小化。</p> <p>由于采用抽样复制法，同时结合本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券只数、权重和券种与标的指数成份券个数、权重和券种间将存在差异。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、衍生品投资策略、其他品种投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证金边中期国债指数</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用代表性分层抽样复制策略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债券市场相似的风险收益特征。</p>

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[2013]153号《关于核准嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》予以核准,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2013年4月17日至2013年5月3日向社会公开发行募集,基金合同于2013年5月10日正式生效,募集规模为641,893,704.00份基金份额。

自2013年5月10日至2022年6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《嘉实中证金边中期国债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5月12**日起至**2022年6月13日17:00**止(送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准),并于**2022年6月14**日表决通过了《关于嘉实中证金边中期国债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**2022年6月15**日公布的《关于嘉实中证金边中期国债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**2022年6月15**日起进入清算程序。根据基金管理人于**2022年6月17**日发布的《关于嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金终止上市交易的公告》,本基金于**2022年6月22**日终止上市。

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：关于嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年6月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2022年6月14日
资产：	
银行存款	19,437.98
结算备付金	49,517.48
存出保证金	11.92
交易性金融资产	7,770,485.93
其中：债券投资	7,770,485.93
应收清算款	3,695.55
资产总计	7,843,148.86
负债和净资产	最后运作日 2022年6月14日
负债：	
卖出回购金融资产款	450,000.00
应付管理人报酬	962.85
应付托管费	320.96
应付清算款	18.30
其他负债	105,425.96
负债合计	556,728.07
净资产：	
实收基金	6,269,834.57
未分配利润	1,016,586.22
净资产合计	7,286,420.79
负债和净资产总计	7,843,148.86

注1：报告截止日2022年6月14日（基金最后运作日），嘉实中证中期国债ETF份额净值116.215元，基金份额总额62,698.00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》、《嘉实中证金边中期国债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

2022年6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2022年6月15日至2022年7月8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

清算费用是指基金资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，清算费用应由基金资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49,517.48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个工作日对结算备付金进行调整，结算备付金款项已于2022年7月4日收回28,867.43元，尚余20,620.59元未收回，应计利息已于2022年6月21日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额11.92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。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2022年7月4日收回并划入托管账户。

本基金最后运作日应收银行存款利息为1,127.13元，已于2022年6月21日收回。

本基金最后运作日交易性金融资产为债券投资，金额为7,770,485.93元（最后运作日估值市值），其中应计债券利息75,413.33元，截至2022年6月27日全部处置完毕。卖出债券成交金额共计人民币7,766,864.73元，证券清算款截至2022年6月28日全部由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

本基金最后运作日应收清算款3,695.55元，已于2022年6月15日收回并划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日卖出回购金融资产款共计450,000.00元，该款项已于2022年6月

15 日偿还完毕。

本基金最后运作日应付管理人报酬为 962.85 元，该款项已于 2022 年 6 月 28 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 320.96 元，该款项已于 2022 年 6 月 28 日支付。

本基金最后运作日应付清算款 18.30 元，已于 2022 年 6 月 15 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 105,425.96 元，为预提审计费、应付指数使用费。其中，预提审计费为 80,000 元，尚未支付；预提指数使用费为 25,425.96 元，该款项已于 2022 年 7 月 5 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 2022 年 6 月 14 日基金净资产	7,286,420.79
加：清算期间（2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 8 日）收入	-2,567.42
1、存款利息收入（注 1）	1,226.72
2、投资收益（注 2）	30,881.53
3、公允价值变动损益（注 3）	-34,675.67
减：清算期间（2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 8 日）费用	55.36
1、其他费用（注 4）	35.00
2、利息支出（注 5）	20.36
二、2022 年 7 月 8 日（清算报告出具日）基金净资产	7,283,798.01

注 1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 8 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债券自 2022 年 6 月 15 日至 2022 年 6 月 27 日止实现的差价收入 26,872.17 元、债券利息收入 4,009.36 元。

注 3：公允价值变动损益系最后运作日未变现债券自 2022 年 6 月 15 日至 2022 年 6 月 27 日止结转的债券公允价值变动。

注 4：其他费用系自 2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 8 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

注 5：利息支出系 2022 年 6 月 15 日偿还卖出回购金融资产产生的利息支出。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2022 年 7 月 8 日，本基金剩余财产为

7,283,798.01 元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金资产清算的分配方案，将基金资产清算后的全部剩余资产扣除基金资产清算费用、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 2022 年 7 月 9 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 嘉实中证金边中期国债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 嘉实中证金边中期国债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

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金基金资产清算组

二〇二二年七月八日