

嘉实中证先进制造100策略交易型开放式 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：二〇二三年二月十四日

报告公告日期：二〇二三年二月二十七日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	3
3、基金运作情况说明.....	7
4、财务报告	8
5、清算事项说明	10
6、备查文件目录	13

1、重要提示

嘉实中证先进制造100策略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]1765号予以注册,于2019年12月5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《嘉实中证先进制造100策略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,本基金连续超过50个工作日基金资产净值低于5000万元,触发《基金合同》约定的终止情形,为维护基金份额持有人利益,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,决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》,该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决,详见基金管理人于2023年1月4日在《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站

(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)、上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)及基金管理人官方网站(<http://www.jsfund.cn>)发布的《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,以及分别于2023年1月5日、1月6日、1月16日发布的《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第一次提示性公告》、《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第二次提示性公告》、《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第三次提示性公告》。

本基金最后运作日为2023年1月16日,并自2023年1月17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、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律师组成基金财产清算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	嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实先进制造100ETF
场内简称	制造100
扩位场内简称	先进制造ETF
基金主代码	515870
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年12月5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16日）基金份额总额	31,498,890.00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1月17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，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%。
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、科创板、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），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

	<p>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，参与融资业务和转融通证券出借业务。</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%，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>1、股票投资策略</p> <p>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分股时，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>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投资目标所述范围的，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>2、金融衍生品投资策略</p> <p>为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权。</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>① 股指期货投资策略</p>

	<p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>② 股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，采取备兑开仓、delta中性等策略适度参与股票期权投资。</p> <p>3、融资及转融通证券出借</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资及转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、本基金历史申赎数据、出借证券流动性情况等因素，合理确定出借证券的范围、期限和比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>5、随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。</p>
<p>标的指数和业绩比较基准</p>	<p>本基金的标的指数为中证先进制造100策略指数，业绩比较基准为中证先进制造100策略指数收益率。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本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</p>

	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]1765号《关于准予嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数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2019年11月4日至2019年11月29日向社会公开发行人募集,基金合同于2019年12月5日正式生效,募集规模为271,498,890.00份基金份额。

自2019年12月15日至2023年1月16日期间,本基金按基金合同正常运作。

本基金连续超过50个工作日基金资产净值低于5000万元,触发《基金合同》约定的终止情形,为维护基金份额持有人利益,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,基金管理人经与基金托管人协商一致,决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》,该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决,详见基金管理人于2023年1月4日发布的《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,以及分别于2023年1月5日、1月6日、1月16日发布的《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第一次提示性公告》、《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第二次提示性公告》、《关于嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第三次提示性公告》。本基金最后运作日为2023年1月16日,自2023年1月17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：嘉实中证先进制造 100 策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 1 月 16 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 16 日
资 产：	
银行存款	685,112.52
结算备付金	72,185.24
存出保证金	9,288.66
交易性金融资产	36,162,124.50
其中：股票投资	36,162,124.50
应收证券清算款	586,413.83
资产总计	37,515,124.75
负债和净资产	最后运作日 2023 年 1 月 16 日
负 债：	
应付管理人报酬	8,233.91
应付托管费	1,646.79
应付证券清算款	500,674.72
应付交易费用	1,162.14
其他负债	95,992.74
负债合计	607,710.30
净资产：	
实收基金	31,498,890.00
未分配利润	5,408,524.45
净资产合计	36,907,414.45
负债和净资产总计	37,515,124.75

注 1：报告截止日 2023 年 1 月 16 日（基金最后运作日），嘉实中证先进制造 100 策略交易型开放式指数证券投资基金的基金份额净值 1.1717 元，基金份额总额 31,498,890.00 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》、《嘉实中证先进制造 100 策略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 16 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1月17日至2023年2月14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72,185.24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65,900.36元，尚余6,361.31元未收回，剩余结算备付金将于2023年3月8日收回，应计利息将于2023年3月21日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额9,288.66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2月2日收回9,275.22元并划入托管账户。剩余利息将于2023年3月21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222.17，将于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36,162,124.50元（最后运作日估值市值），截至2023年1月17日全部处置完毕。卖出股票成交金额共计人民币36,210,152.65元，证券清算款截至2023年1月18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8,233.91元，该款项已于2023年1月31日支

付。

本基金最后运作日应付托管费为 1,646.79 元，该款项已于 2023 年 1 月 31 日支付。

本基金最后运作日应付交易费用 1,162.14 元，该款项已于 2023 年 1 月 31 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 95,992.74 元，为预提审计费、应付指数使用费和预提信息披露费。其中，预提审计费为 42,000.00 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付；应付指数使用费为 3,444.78 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付；预提信息披露费为 50,547.96 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付 50,000.00 元，剩余 547.96 元于 2023 年 2 月 8 日经证券时报确认免除收取，于 2023 年 2 月 8 日回冲。

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 16 日基金净资产	36,907,414.45
加：清算期间（2023 年 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 日）收入	
1、存款利息收入（注 1）	9,795.03
2、投资收益（注 2）	66,290.88
3、公允价值变动损益（注 3）	-24,103.22
减：清算期间（2023 年 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 日）费用	
1、交易费用（注 4）	64,416.02
2、其他费用（注 5）	-452.96
二、2023 年 2 月 14 日（清算报告出具日）基金净资产	36,895,434.08

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 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 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 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 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 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 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 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 日止处置过程中发生的交易费用。

注 5：其他费用系自 2023 年 1 月 17 日至 2023 年 2 月 14 日止清算期间的银行汇划手续费以及证券时报免除的 2023 年度信息披露费。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2023 年 2 月 14 日，本基金剩余财产为 36,895,434.08 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 2 月 15 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 嘉实中证先进制造100策略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 嘉实中证先进制造100策略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

嘉实中证先进制造100策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产清算组

二〇二三年二月十四日