

嘉合中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：嘉合基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2024 年 2 月 29 日

清算报告公告日：2024 年 3 月 2 日

§ 1 重要提示

嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金（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”）《关于准予嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]2534号文）准予注册，由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规和《嘉合中债-1-3年政策性金融债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”）发售，基金合同于2021年4月14日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集的基金份额总数为323,079,805.80份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为毕马威华振验字第2100223号验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》等相关法律法规和《基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会的投票表决时间为2023年12月27日至2024年1月23日17:00止。本基金管理人已于2024年1月25日在规定媒介发布了《嘉合基金管理有限公司关于嘉合中债-1-3年政策性金融债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》，本次基金份额持有人大会于2024年1月24日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。本次基金份额持有人大会决议生效日即2024年1月24日为本基金最后运作日。自基金份额持有人大会决议生效的下一工作日起，即2024年1月25日起本基金进入清算程序。

由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2024年1月25日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金名称	嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金
基金简称	嘉合中债-1-3年政金债指数
基金主代码	010516
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年4月14日
报告期末（2024年1月24日）基金份	8,035,969.44份

额总额	
投资目标	本基金采用指数化投资，通过控制基金组合对标的指数的偏离度，力争在扣除各项费用前获得与标的指数相似总回报。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为指数基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中债-1-3年政策性金融债指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	嘉合基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金由中国证监会《关于准予嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]2534号文）准予注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定向社会公开募集。本基金基金合同于2021年4月14日正式生效，首次设立募集的基金份额总数为323,079,805.80份。

根据相关法律法规及《基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，并经本基金基金份额持有人大会投票表决，本次会议议案于2024年1月24日表决通过，大会决议自该日起生效，本基金2024年1月25日起进入清算程序。

自基金合同生效日至基金最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金

单位：人民币元

资产	清算结束日 2024年2月2日	最后运作日 2024年1月24日
资产：		
银行存款	8,289,504.64	226,555.34
结算备付金		
存出保证金	13.04	6,027.34
交易性金融资产		8,079,451.37
其中：股票投资		
基金投资		
债券投资		8,079,451.37
资产支持证券投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		
资产总计	8,289,517.68	8,312,034.05
负债和所有者权益		
负 债：		
应付赎回款		1,958.18
应付证券清算款		
应付管理人报酬		868.02
应付托管费		289.34
应付销售服务费		522.70
应付交易费用		
其他负债		16,316.01
负债合计	0.00	19,954.25
所有者权益：		
实收基金	8,034,956.31	8,035,969.44
未分配利润	254,561.37	256,110.36
所有者权益合计	8,289,517.68	8,292,079.80
负债和所有者权益总计	8,289,517.68	8,312,034.05

注：本基金最后运作日2024年1月24日，本基金A类基金份额净值1.0314元，C类基金份额净值1.0319元，基金份额总额8,035,969.44份，其中A类基金份额741,020.72份，C类基金份额7,294,948.72份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金

单位：人民币元

项目	2024年1月25日(清算开始日)至 2024年2月2日(清算结束日)止期 间

一、收入	1,638.33
1. 利息收入	728.33
其中：存款利息收入	728.33
买入返售金融资产利息收入	
2. 投资收益（损失以“-”填列）	20,342.00
其中：股票投资收益	
基金投资收益	
债券投资收益	20,342.00
资产支持证券投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-19,432.00
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
二、费用	3,155.00
1、管理人报酬	
2、托管费	
3、销售服务费	
4、利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
5、税金及附加	
6、其他费用	3,155.00
三、利润总额	-1,516.67
减：所得税费用	
四、净收益	-1,516.67

注：清算期间的利息收入系以当前适用利率预估计提的自2024年1月25日（清算开始日）至2024年2月2日（清算结束日）止期间的银行存款利息收入人民币726.17元、结算备付金利息收入人民币0元和存出保证金利息收入人民币2.16元，共计人民币728.33元。

§ 5 清算情况

自2024年1月25日至2024年2月2日止为清算期间，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 资产处置及负债清偿情况

5.1.1 资产处置情况

本基金最后运作日银行存款余额为人民币226,555.34元，其中活期存款人民币226,401.13元，应计活期存款利息人民币154.21元，上述活期存款在清算期支付了赎回金额、管理费、托管费、交易费用及其他费用，调整了最低备付金及存出保证金后，于清算结束日银行存款余额为人民币8,289,504.64元，其中活期存款人民币8,288,624.26元，应计活期存款利息人民币880.38元。

本基金最后运作日存出保证金余额为人民币6,027.34元,其中交易所结算保证金人民币6,016.46元,应计存出保证金利息人民币10.88元,于清算结束日存出保证金余额为人民币13.04元,其中应计存出保证金利息人民币13.04元。

本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币8,079,451.37元,均于清算期间处置变现,于清算结束日交易性金融资产余额为人民币0.00元。

5.2 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款人民币1,958.18元,该款项已于2024年1月25日支付,清算期首日2024年1月25日确认应付赎回款人民币1,045.45元,该款项已于2024年1月26日支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬人民币868.02元,该款项已于2024年2月2日支付。

本基金最后运作日应付托管费人民币289.34元,该款项已于2024年2月2日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费人民币522.70元,该款项已于2024年2月2日支付。

本基金最后运作日其他负债人民币16,316.01元。其中预提律师费人民币15,000.00元,该款项已于2024年2月1日支付。其中应付指数使用费人民币1,316.01元,该款项已于2024年1月30日支付。于清算期间确认应付交易费用人民币170.00元,该款项已于2024年1月30日支付。

5.3 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额
一、最后运作日2024年1月24日基金净资产	8,292,079.80
加:清算期间净收益	-1,516.67
减:基金净赎回转出金额 (于2024年1月25日确认的投资者赎回转出申请)	1,045.45
二、2024年2月2日基金净资产	8,289,517.68

注: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、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。清算期结束日次日至清算款划出前一日收益和费用由基金份额持有人享有和承担。

资产处置及部分负债清偿后,本基金截至2024年2月2日的净资产为人民币8,289,517.68元。经基金管理人以及基金托管人确认,本基金托管账户2024年2月2日银行存款余额共人民币8,288,624.26元。为保护基金份额持有人利益,加快清盘速度,基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额供清盘分配使用,待实际资金到账后再返还基金管理人,实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

5.4 基金财产清算报告的告知安排

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,向监管机构备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 一、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 二、《嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金清算报告》的法律意见书

6.2 存放地点

基金管理人办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（www.haoamc.com）进行查阅。

嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金财产清算小组

2024年2月29日