

嘉实中证金边中期国债交易型开放式  
指数证券投资基金联接基金  
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：二〇二二年七月二十六日

报告公告日期：二〇二二年八月五日

## 目 录

1、重要提示 .....	2
2、基金概况 .....	3
3、基金运作情况说明 .....	6
4、财务报告 .....	7
5、清算事项说明 .....	9
6、备查文件目录 .....	12

## 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联接基金(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联接基金基金合同》(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》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联接基金终止基金合同有关事项的议案》。

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联接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。

## 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联接基金	
基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接	
基金主代码	000087	
基金运作方式	契约型开放式	
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	3,041,418.12份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接A	嘉实中证金边中期国债ETF联接C
下属分级基金的交易代码	000087	000088
基金最后运作日（2022年6月14日）下属分级基金份额总额	2,479,293.89份	562,124.23份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，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0.3%，年跟踪误差不超过4%。
投资范围	本基金以目标ETF基金份额，标的指数成份券及备选成份券为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中

	<p>现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>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>
投资策略	<p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。</p> <p>在目标ETF开放申购赎回之前，本基金可通过特殊申购的方式用基金资产换购目标ETF份额，以进行基金建仓。</p> <p>基金衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征，以便更好地实现基金的投资目标。本基金将主要投资于国债期货，持有金融衍生工具风险敞口的绝对总额不得超过基金资产的5%。基金的衍生品投资只能用于风险对冲而不能用于投机。</p> <p>未来，如法律法规或监管机构允许基金投资于其他与利率、标的指数、标的指数成份券或构成基金组合的其他非成份券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等，以及其他投资品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，并更新和丰富基金投资策略。</p>
业绩比较基准	中证金边中期国债指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为嘉实中期国债ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实中期国

	<p>债ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证金边中期国债指数及嘉实中期国债ETF的表现密切相关。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基金、混合基金，高于货币市场基金。</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8日至2013年5月8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1,341,303,435.56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联接基金基金合同》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》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联接基金终止基金合同有关事项的议案》。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联接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。

## 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联接基金

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
<b>资产：</b>	
银行存款	142,469.87
结算备付金	0.63
存出保证金	6,092.25
交易性金融资产	3,031,231.25
其中：基金投资	2,863,537.60
债券投资	167,693.65
应收申购款	139.98
资产总计	3,179,933.98
<b>负债和净资产</b>	<b>最后运作日 2022年6月14日</b>
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	26.54
应付托管费	8.85
应付销售服务费	65.39
应交税费	0.87
其他负债	80,303.50
负债合计	80,405.15
<b>净资产：</b>	
实收基金	3,041,418.12
未分配利润	58,110.71
净资产合计	3,099,528.83
负债和净资产总计	3,179,933.98

注1：报告截止日2022年6月14日（基金最后运作日），嘉实中证金边中期国债ETF联接A基金份额净值1.0211元，基金份额总额2,479,293.89份；嘉实中证金边中期国债ETF联接C基金份额净值1.0104元，基金份额总额562,124.23份。基金份额总额合计为3,041,418.12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联接基金基金合同》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26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，清算费用由基金资产清算组优先从基金资产中支付。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0.63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，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6,092.25元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金和应计利息。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2022年7月4日收回并划入托管账户，应计利息已于2022年6月21日收回。

本基金最后运作日应收银行存款利息为529.57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和基金投资。其中，债券投资金额为167,693.65元（最后运作日估值市值），其中应计债券利息1,461.25元，截至2022年6月15日全部处置完毕。卖出债券成交金额共计人民币167,698.23元，证券清算款截至2022年6月16日全部由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。基金投资金额为2,863,537.60元，截至2022年7月22日已全部变现完毕，成交金额2,862,741.65元，已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申购款利息为139.98元，已于2022年6月27日收回。

### 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为 26.54 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 8.85 元，该款项已于 2022 年 6 月 28 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费（C 类份额）为 65.39 元，该款项已于 2022 年 6 月 28 日支付。

本基金最后运作日应交税费为 0.87 元，该款项已于 2022 年 7 月 8 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 80,303.50 元，为预提审计费和应付交易费用。其中，审计费 55,000.00 元已于 2022 年 7 月 12 日支付，剩余清算审计费 25,000.00 元尚未支付，待分配后支付。应付交易费用为 303.50 元，已于 2022 年 7 月 4 日支付中央国债登记结算有限责任公司结算服务费 300.00 元，已于 2022 年 7 月 14 日支付中国外汇交易中心交易费用 3.50 元。

#### 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	3,099,528.83
加：清算期间（2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 26 日）收入	-557.60
1、存款利息收入（注 1）	233.94
2、投资收益（注 2）	50,548.09
3、公允价值变动损益（注 3）	-51,339.63
减：清算期间（2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 26 日）费用	35.00
1、其他费用（注 4）	35.00
减：期间份额交易产生的基金净值变动数	19.73
1. 基金赎回款（注 5）	19.73
二、2022 年 7 月 26 日（清算报告出具日）基金净资产	3,098,916.50

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 26 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 2022 年 6 月 15 日实现的差价收入 -54.95 元、债券利息收入 9.56 元；未变现基金 2022 年 7 月 22 日实现的差价收入 50,593.48 元。

注 3：公允价值变动损益系最后运作日未变现债券 2022 年 6 月 15 日结转的债券公允价值变动 49.80 元；未变现基金 2022 年 7 月 22 日结转的基金公允价值变动 -51,389.43

元。

注 4：其他费用系自 2022 年 6 月 15 日至 2022 年 7 月 26 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

注 5：基金赎回款系产品于 2022 年 6 月 15 日确认的赎回金额，包括应付赎回款 19.72 元、应付赎回费 0.01 元。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2022 年 7 月 26 日，本基金剩余财产为 3,098,916.50 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。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。同一类别的基金份额持有人对基金资产清算后剩余资产具有同等的分配权。

自本次清算期结束日次日 2022 年 7 月 27 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 嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接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联接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联接基金基金资产清算组

二〇二二年七月二十六日