

嘉实中关村A股交易型开放式指数 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：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二二年九月六日

报告公告日期：二〇二二年九月二十日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	4
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

嘉实中关村A股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[2016]2925号予以核准,于2017年6月7日成立并正式运作。本基金基金管理人为嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定:“《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,并可采取以下解决方案:(1)基金管理人经与基金托管人协商一致,对本基金进行清算、终止基金合同,且无需召开持有人大会进行表决;(2)转换运作方式、与其他基金合并等其他解决方案,并召开基金份额持有人大会对解决方案进行表决。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”因本基金连续超过60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》的相关规定和《基金合同》的相关约定,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,详见基金管理人分别于2022年8月9日、8月10日、8月11日、8月12日、8月15日、8月16日在《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)、深圳证券交易所网站(<http://www.szse.cn>)及基金管理人官方网站(<http://www.jsfund.cn>)发布的《关于嘉实中关村A股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提示性公告》,以及于2022年8月17日发布的《关于嘉实中关村A股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》。

本基金最后运作日为2022年8月16日,并自2022年8月17日起进入清算程序。由本基金基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2022年8月17日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,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,上海市通力律师事务所对

清算报告出具法律意见。根据基金管理人于2022年8月19日发布的《关于嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金终止上市的公告》，本基金于2022年8月24日终止上市。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中关村A股ETF
场内简称	中关村ETF
基金主代码	159951
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年6月7日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金最后运作日（2022年8月16日）基金份额总额	6,322,910.00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	2017年7月10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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过3%。
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、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等），债券（国债、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）。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。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%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。 本基金的标的指数为深圳证券信息有限公司编制并发布的中关村A股指数，及其未来可能发生的变更。
投资策略	本基金采取完全复制法，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）导致无法获得足够数量的股票时，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。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正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。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。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	中关村A股指数收益率
风险收益特征	本基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[2016]2925号《关于准予嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》予以核准,由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定于2017年5月15日至2017年5月26日向社会公开发行业募集,本基金《基金合同》于2017年6月7日正式生效,募集规模为346,822,910.00份基金份额。

自2017年6月7日至2022年8月16日期间,本基金按《基金合同》正常运作。

本基金连续超过60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,详见基金管理人分别于2022年8月9日、8月10日、8月11日、8月12日、8月15日、8月16日发布的《关于嘉实中关村A股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提示性公告》,以及于2022年8月17日发布的《关于嘉实中关村A股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》。本基金最后运作日为2022年8月16日,自2022年8月17日起进入清算程序。根据基金管理人于2022年8月19日发布的《关于嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金终止上市的公告》,本基金于2022年8月24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：嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 8 月 16 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2022 年 8 月 16 日
资 产：	
银行存款	228,696.32
结算备付金	61.68
存出保证金	77.57
交易性金融资产	5,291,477.18
其中：股票投资	5,291,477.18
其他资产	-
资产合计	5,520,312.75
负债和所有者权益	最后运作日 2022 年 8 月 16 日
负 债：	
应付清算款	-
应付管理人报酬	1,195.91
应付托管费	239.19
其他负债	34,874.75
负债合计	36,309.85
所有者权益：	
实收基金	6,322,910.00
未分配利润	-838,907.10
所有者权益合计	5,484,002.90
负债和所有者权益总计	5,520,312.75

注 1：报告截止日 2022 年 8 月 16 日（基金最后运作日），嘉实中关村 A 股交易型开放式指数证券投资基金份额净值 0.8673 元，基金份额总额 6,322,910.00 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》、《嘉实中关村 A 股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 8 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2022年8月17日至2022年9月6日止。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 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，本基金清算的律师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41.35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。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，该款项已分别于2022年9月2日收回41.35元并划入托管账户。

本基金最后运作日存出保证金金额77.57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。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，该款项已于2022年9月2日收回77.57元并划入托管账户。

本基金最后运作日应收利息为138.52元，其中应收活期存款利息为118.19元，应收最低备付金利息20.33元。上述应收活期存款利息、最低备付金利息将于2022年9月21日收回并划入托管账户。

本基金最后运作日交易性金融资产为股票投资，金额为5,291,477.18元（最后运作日估值市值），截至2022年8月17日全部处置完毕。卖出股票成交金额共计人民币5,266,438.59元，证券清算款截至2022年8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1195.91元，该款项已于2022年9月5日支付。

本基金最后运作日应付托管费为239.19元，该款项已于2022年9月5日支付。

本基金最后运作日其他负债为 34,874.75 元，为预提审计费、应付指数使用费、应付交易费用。其中，预提审计费为 34,355.04 元，该款项已于 2022 年 9 月 5 日支付；应付指数使用费为 516.28 元，该款项已于 2022 年 8 月 31 日支付；应付交易费用为 3.43 元，该款项已于 2022 年 9 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 8 月 16 日基金净资产	5,484,002.90
加：清算期间（2022 年 8 月 17 日至 2022 年 9 月 6 日）收入	
1、存款利息收入（注 1）	1,018.29
2、债券利息收入	-
3、投资收益（注 2）	-23,887.19
4、公允价值变动损益	-
5、其他收入	-
减：清算期间（2022 年 8 月 17 日至 2022 年 9 月 6 日）费用	
1、交易费用（注 3）	9,015.85
2、其他费用（注 4）	78.39
减：期间基金份额交易产生的基金净值变动数	
1、基金赎回款	-
二、2022 年 9 月 6 日（清算报告出具日）基金净资产	5,452,039.76

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 8 月 17 日至 2022 年 9 月 6 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 2022 年 8 月 17 日至 2022 年 9 月 6 日止处置取得的投资收益。

注 3：交易费用系最后运作日未变现股票自 2022 年 8 月 17 日至 2022 年 9 月 6 日止处置过程中发生的交易费用。

注 4：其他费用系自 2022 年 8 月 17 日至 2022 年 9 月 6 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 2022 年 9 月 6 日，本基金剩余财产为

5,452,039.76 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、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 9 月 7 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 基金财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 嘉实中关村A股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 嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金财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

嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年九月六日