

嘉实稳康纯债债券型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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告出具日期：二〇一七年十一月二日

报告公告日期：二〇一八年一月十一日

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 6
- 6、备查文件目录 9

1、重要提示

嘉实稳康纯债债券型证券投资基金(以下简称本基金)经中国证监会证监许可[2016]2224号予以核准注册,于2017年6月13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》、《嘉实稳康纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)的有关规定,《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,《基金合同》终止,无需召开基金份额持有人大会审议。

截至2017年10月19日日终,嘉实稳康纯债债券型证券投资基金(以下简称本基金或嘉实稳康纯债债券)的基金资产净值低于5000万元,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,触发上述基金合同终止情形,本基金的最后运作日为2017年10月19日。嘉实基金管理有限公司(以下简称本基金管理人)自2017年10月20日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见刊登在2017年10月20日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上的《关于嘉实稳康纯债债券型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》。

本基金从2017年10月20日起进入清算期,由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和北京市天元律师事务所律师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,北京市天元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 嘉实稳康纯债债券型证券投资基金

基金简称 嘉实稳康纯债债券

基金主代码 004029

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年6月13日

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 中国邮政储蓄银行股份有限公司

基金最后运作日(2017年10月19日)基金份额总额 10,042,260.81份

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增

值。

投资策略 1.债券投资策略

本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。

2.国债期货投资策略

本基金将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上，预判利率债品种的后期表现，在有效控制组合杠杆水平的基础上，充分利用国债期货保证金交易特点，灵活调整组合国债期货多头仓位。本基金在综合分析经济基本面、资金面和政策面的基础上，结合组合内各利率债持仓结构的基础上，按照利率风险评估套期保值比例计算保证金、期现价格变化等风险控制的流程，构建并实时调整利率债的套期保值组合。利率风险是信用债的重要风险组成。本基金将在基于经济形势和信用风险预期的基础上，利用国债期货，对于信用债的利率风险部分进行一定程度的套期保值，实现信用利差交易，即在预期信用利差缩窄的情况下，做空国债期货，做多信用债，在预期信用利差变宽的情况下，做多国债期货，做空信用债。

3.资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

业绩比较基准 中债总全价指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

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]2224号《关于准予嘉实稳康纯债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，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2017年3月27日至2017年6月7日向社会公开发行募集，基金合同于2017年6月13日正式生效，募集规模为200,184,644.77份基金份额。

自2017年6月13日至2017年10月19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》、《嘉实稳康纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，《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，《基金合同》终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

截至2017年10月19日日终，嘉实稳康纯债债券型证券投资基金（以下简称本基金或嘉实稳康纯债债券）的基金资产净值低于5000万元，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发上述基金合同终止情形。自2017年10月20日起，本基金进入基金财产清算程序。

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：嘉实稳康纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017年10月19日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产 最后运作日

2017年10月19日

资产：

银行存款 10,112,003.30

存出保证金 1,521.10

应收利息 5,869.20
资产总计 10,119,393.60
负债和所有者权益 最后运作日
2017年10月19日
负债：
应付管理人报酬 1,574.53
应付托管费 524.84
其他负债 6,300.00
负债合计 8,399.37
所有者权益：
实收基金 10,042,260.81
未分配利润 68,733.42
所有者权益合计 10,110,994.23
负债和所有者权益总计 10,119,393.60

注 1：报告截止日 2017 年 10 月 19 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.0068 元，基金份额总额 10,042,260.81 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》、《嘉实稳康纯债债券型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 2017 年 10 月 19 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 2017 年 10 月 20 日至 2017 年 11 月 2 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，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用等。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，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日存出保证金金额 1,521.10 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，已于 2017 年 11 月 2 日全部收回并划入托管账户。

本基金最后运作日应收利息为 5,869.20 元，其中应收活期存款利息为 5,867.17 元，应收结算保证金利息 2.03 元。上述活期存款利息、结算保证金利息暂由基金管理人垫付，供清盘分配使用，结息后返还给基金管理人。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为 1,574.53 元，该款项已于 2017 年 10 月 23 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为 524.84 元，该款项已于 2017 年 10 月 23 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 6,300.00 元，为预提银行间账户维护费，其中，预提中央国债登记结算有限责任公司账户维护费为 3,000.00 元，清算期间已确认中央国债登记结算有限责任公司根据实际销户时间确定收取的费用为 1,500.00 元，该款项已于 2017 年 10 月 27 日支付，故将差额部分冲回，计入基金资产的收入；预提上海清算所账户维护费为 3,300.00 元，清算期间已确认上海清算所根据实际销户时间确定收取的费用为 0.00 元，故将预提部分冲回，计入基金资产的收入。

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 2017 年 10 月 19 日基金净资产 10,110,994.23

加：清算期间（2017 年 10 月 20 日至 2017 年 11 月 2 日）收入

利息收入（注 1） 2,831.65

其他收入（注 2） 4,800.00

减：清算费用（注 3） -

二、2017 年 11 月 2 日（清算报告出具日）基金净资产 10,118,625.88

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2017 年 10 月 20 日至 2017 年 11 月 2 日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。

2、清算期间已确认中央国债登记结算有限责任公司和上海清算所根据实际销户时间确定收取的费用少于已预提的银行间账户维护费，故将差额部分冲回，计入基金资产的收入。3、本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2017 年 11 月 2 日，本基金剩余财产为 10,118,625.88 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，本基金的清算费用将由基金管理人承担）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 2017 年 11 月 3 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进行分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 嘉实稳康纯债债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实稳康纯债债券型证券投资基金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

嘉实客服电话：400-600-8800

嘉实稳康纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一七年十一月二日