

# 华夏鼎实债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇一八年三月二十三日

清算报告公告日：二〇一八年五月五日

## 重要提示

华夏鼎实债券型证券投资基金（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”）2016年11月28日证监许可[2016]2892号文准予注册，自2017年6月15日起基金合同生效，本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华夏鼎实债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《基金合同》应当终止。本基金管理人于2018年2月8日发布《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏鼎实债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议终止本基金基金合同有关事项，审议议案于2018年3月13日通过，本次基金份额持有人大会决议自同日起生效，本基金管理人于2018年3月14日发布《华夏鼎实债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》（以下简称“决议生效公告”）。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2018年3月14日，自2018年3月15日起，本基金进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市天元律师事务所成立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）对本基金进行清算审计，北京市天元律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 一、基金概况

基金名称 华夏鼎实债券型证券投资基金

基金简称 华夏鼎实债券

基金主代码 004054

各份额类别简称及基金交易代  
码

华夏鼎实债券 A 华夏鼎实债券 C

004054 004055

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017 年 6 月 15 日

基金管理人 华夏基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

注册登记机构 华夏基金管理有限公司

## 二、基金运作情况

本基金经中国证监会 2016 年 11 月 28 日证监许可[2016]2892 号文准予注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2017 年 3 月 14 日至 2017 年 6 月 9 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 6 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 205,951,248.33 份（含募集期间利息结转的份额）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《基金合同》应当终止。本基金管理人于 2018 年 2 月 8 日发布《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏鼎实债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议终止本基金基金合同有关事项，审议议案于 2018 年 3 月 13 日通过，本次基金份额持有人大会决议自同日起生效，本基金管理人于 2018 年 3 月 14 日发布《华夏鼎实债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2018 年 3 月 14 日，自 2018 年 3 月 15 日起，本基金进入基金财产清算程序。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

### 三、财务会计报告

#### (一) 基金最后运作日资产负债表 (已经审计)

会计主体: 华夏鼎实债券型证券投资基金

报告截止日: 2018年3月14日

单位: 人民币元

最后运作日

2018年3月14日

资 产:

银行存款 202,946.85

结算备付金 174,635.74

存出保证金 2,704.38

交易性金融资产 24,568,542.90

其中: 债券投资 24,568,542.90

应收证券清算款 206,189.99

应收利息 803,392.66

资产总计 25,958,412.52

负 债:

应付赎回款 48347.68

应付管理人报酬 3,010.88

应付托管费 1,003.63

应付销售服务费 19.16

应付交易费用 175.00

其他负债 53,000.00

负债合计 105,556.35

所有者权益:

实收基金 25,479,455.97

未分配利润 373,400.20

所有者权益合计 25,852,856.17

负债和所有者权益总计 25,958,412.52

注：①报告截止日 2018 年 3 月 14 日（本基金最后运作日），华夏鼎实债券 A 基金份额净值为 1.0147 元，华夏鼎实债券 C 基金份额净值为 1.0125 元；华夏鼎实债券基金份额总额为 25,479,455.97 份（其中 A 类 25,145,691.23 份，C 类 333,764.74 份）。

②本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。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。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

#### 四、清算情况

自 2018 年 3 月 15 日至 2018 年 3 月 23 日止为本基金清算报告期，基金财产清算组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

##### （一）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，清算费用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。

##### （二）最后运作日资产清算情况

截至清算报告期结束日（2018 年 3 月 23 日），本基金结算备付金、存出保证金尚未收回，根据基金管理人 2018 年 2 月 8 日发布的《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏鼎实债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》及决议生效公告，为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，

基金管理人以自有资金对上述最后运作日资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

1、本基金最后运作日结算备付金为 174,635.74 元，已由基金管理人于 2018 年 3 月 23 日以自有资金垫付至托管账户。

2、本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,704.38 元，已由基金管理人于 2018 年 3 月 23 日以自有资金垫付至托管账户。

3、本基金最后运作日交易性金融资产为债券投资，金额为人民币 24,568,542.90 元（最后运作日估值金额），已于 2018 年 3 月 15 日卖出，卖出债券总金额共计人民币 25,337,741.23 元（含应收利息人民币 771,058.15 元及债券交易费用 443.70 元），证券清算款已于 2018 年 3 月 16 日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户，债券交易费用由基金管理人承担。

4、本基金最后运作日应收证券清算款为 206,189.99 元，已于 2018 年 3 月 15 日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

5、本基金最后运作日应收利息为人民币 803,392.66 元，其中 34,656.95 元已于 2018 年 3 月 21 日、2018 年 3 月 22 日结息收回并划入托管账户，剩余 768,735.71 元为卖出债券应冲销的截至 2018 年 3 月 14 日的应收利息，已于 2018 年 3 月 15 日进行会计冲销。

### （三）最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 48,347.68 元，该款项已于 2018 年 3 月 15 日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,010.88 元，该款项已于 2018 年 3 月 15 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,003.63 元，该款项已于 2018 年 3 月 15 日支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 19.16 元，该款项已于 2018 年 3 月 16 日支付。

5、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 175.00 元，其中 150.00 元已于 2018 年 3 月 19 日支付，另外 25.00 元为外汇交易手续费，将于 2018 年 4 月支付。

6、本基金最后运作日其他负债为预提审计费和预提银行间账户维护费，共计人民币 53,000.00 元，该款项已于 2018 年 3 月 19 日、2018 年 3 月 20 日支付。

#### （四）最后运作日赎回申请及赎回款支付情况

本基金管理人于 2018 年 3 月 15 日确认的最后运作日本基金赎回申请共计 31,174.79 份，对应应付赎回款金额为人民币 31,617.42 元，该赎回款已于 2018 年 3 月 16 日支付。

#### （五）本次清算报告期间的清算损益情况

单位：人民币元

##### 项目

自 2018 年 3 月 15 日

至 2018 年 3 月 23 日

止清算报告期间

##### 一、清算收益

1、利息收入 6,510.79

其中：存款利息收入（注 1） 4,188.35

债券利息收入（注 2） 2,322.44

2、投资收益 -1,859.82

其中：债券投资收益（注 3） -1,859.82

清算收入小计 4,650.97

##### 二、清算费用

清算费用小计（注 4） -

三、清算净收益 4,650.97

表中相关项目具体说明如下：

1、利息收入系自 2018 年 3 月 15 日至 2018 年 3 月 23 日止清算报告期间的银行存款利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）及结算备付金、存出保证金利息，其中 2018 年 3 月 15 日至 3 月 20 日的利息已于 2018 年 3 月 21 日结息收回，剩余利息以当前适用的利率预估计提，由基金管理人以自有资金垫付。

2、债券利息收入系 2018 年 3 月 15 日（债券卖出当日）债券投资产生的利息收入，该利息已于 2018 年 3 月 15 日进行会计冲销。

3、债券投资收益=卖出债券总金额-债券最后运作日估值金额-应冲销利息金额。其中应冲销利息金额共计 771,058.15 元，包括截至 2018 年 3 月 14 日的利息 768,735.71 元和 2018 年 3 月 15 日当日利息 2,322.44 元。

4、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。

（五）截至本次清算报告期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 3 月 14 日基金净资产 25,852,856.17

减：最后运作日有效赎回申请对应赎回款 31,617.42

加：清算报告期间净收益 4,650.97

二、2018 年 3 月 23 日基金净资产 25,825,889.72

截至本基金清算报告期结束日 2018 年 3 月 23 日，本基金剩余财产为人民币 25,825,889.72 元。自清算报告期结束日次日 2018 年 3 月 24 日至本次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）亦归基金份额持有人所有。

## （六）基金清算报告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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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。

## 五、备查文件

### （一）备查文件目录

1、《华夏鼎实债券型证券投资基金清算审计报告》

2、《北京市天元律师事务所关于华夏鼎实债券型证券投资基金清算的法律意见》

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

华夏鼎实债券型证券投资基金基金财产清算组

二〇一八年三月二十三日