**嘉实稳泰债券型**

**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：交通银行股份有限公司**

**报告出具日期：二〇一八年一月二十二日**

**报告公告日期：二〇一八年四月十日**

**目录**

[1、重要提示 2](#_Toc497915516)

[2、基金概况 3](#_Toc497915517)

[3、基金运作情况说明 4](#_Toc497915518)

[4、财务报告 5](#_Toc497915519)

[5、清算事项说明 7](#_Toc497915520)

[6、备查文件目录 11](#_Toc497915521)

# 1、重要提示

嘉实稳泰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]448号予以核准注册，于2016年4月18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》、《嘉实稳泰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，本基金管理人于2017年11月17日发布了《嘉实基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉实稳泰债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于2017年12月18日以通讯方式召开基金份额持有人大会，基金份额持有人大会审议并表决通过了《关于嘉实稳泰债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》，基金自2017年12月19日起进入清算程序。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见刊登在2017年12月19日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上的《嘉实基金管理有限公司关于嘉实稳泰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的公告》。

本基金从2017年12月19日起进入清算期，由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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 | 嘉实稳泰债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实稳泰债券 |
| 基金主代码 | 002551 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年4月18日 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 基金最后运作日（2017年12月18日）基金份额总额 | 5,099,148.10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.大类资产配置策略2. 债券投资策略3. 股票投资策略4. 国债期货投资策略5. 资产支持证券投资策略6. 权证投资策略 |
| 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]448号《关于准予嘉实稳泰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2016年4月12日至2016年4月13日向社会公开发行募集，基金合同于2016年4月18日正式生效，募集规模为1,000,378,200.17份基金份额。

自2016年4月18日至2017年12月18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》、《嘉实稳泰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，嘉实稳泰债券型证券投资基金于2017年12月18日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于嘉实稳泰债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》，本基金自2017年12月19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：嘉实稳泰债券型证券投资基金

报告截止日：2017年12月18日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| **资产** | **最后运作日****2017年12月18日** |
| **资产：** |  |
| 银行存款 | 840,820.82 |
| 结算备付金 | 246,254.97 |
| 存出保证金 | 114,091.32 |
| 交易性金融资产 | 4,342,056.00 |
| 其中：债券投资 | 4,342,056.00 |
| 应收利息 | 240,365.16 |
| 资产总计 | 5,783,588.27 |
| **负债和所有者权益** | **最后运作日****2017年12月18日** |
| **负债：** |  |
| 应付管理人报酬 | 6,130.94 |
| 应付托管费 | 1,021.83 |
| 应付交易费用 | 178,582.64 |
| 其他负债 | 85,100.00 |
| 负债合计 | 270,835.41 |
| **所有者权益：** |  |
| 实收基金 | 5,099,148.10 |
| 未分配利润 | 413,604.76 |
| 所有者权益合计 | 5,512,752.86 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,783,588.27 |

注1：报告截止日 2017年12月18日（基金最后运作日），基金份额净值1.081元，基金份额总额5,099,148.10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》、《嘉实稳泰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12月18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12月19日至2018年1月22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。

**5.2 资产处置情况**

本基金最后运作日结算备付金金额246,254.97元。为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金，中国证券登记结算有限责任公司每月初第2个工作日对最低结算备付金进行调整，本基金清算期间收回结算备付金237,308.06元，已于2018年1月3日划入托管账户，最新余额8,946.91元将由基金管理人垫付，供清盘分配使用。

本基金最后运作日存出保证金金额114,091.32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2018年1月3日全部收回并划入托管账户。

本基金最后运作日交易性金融资产市值为4,342,056.00元，其中包括：

2017年12月18日（基金最后运作日），本基金持有非停牌债券4,219,056.00元，该资产已于2017年12月20日处置完毕，变现净亏损（含债券利息收入）426.26元。

2017年12月18日（基金最后运作日），本基金持有未上市债券123,000.00元，该资产已于2017年12月28日处置完毕，变现净亏损（含债券利息收入）7,329.45元。

本基金最后运作日应收利息为240,365.16元，其中应收活期存款利息为103,433.36元，应收备付金利息为37,834.57元（其中包含应收期货备付金21,684.70元），应收结算保证金利息933.32元，应收直销户申购款利息1.20元，应收债券利息金额为98,162.71元。上述活期存款利息、结算备付金利息、结算保证金利息已于2017年12月21日结息并划入托管账户，期货备付金利息已于2017年12月27日结息并划入托管账户，直销账户申购款利息已于2017年12月19日结息并划入托管账户。应收债券利息已于卖出债券时收回。

**5.3 负债清偿情况**

本基金最后运作日应付管理人报酬为6,130.94元，该款项已于2017年12月21日支付。

本基金最后运作日应付托管费为1,021.83元，该款项已于2017年12月21日支付。

本基金最后运作日应付交易费用为178,582.64元，其中，应付席位佣金170,692.82元，该款项已于2018年1月4日支付；应付中央国债登记结算有限责任公司交易手续费3,220.00元，该款项已于2018年1月15日支付；应付上海清算所交易手续费2,550.00元，该款项已于2018年1月12日支付；应付外汇交易中心交易手续费2,119.82元，该款项已于2018年1月15日支付。

本基金最后运作日其他负债为85,100.00元，为预提持有人大会费用、预提清算律师费、预提清算审计费、预提银行间账户维护费。预提持有人大会费用37,500.00元，其中，公证费7,500.00元，该款项已于2017年12月26日支付，律师费30,000.00元,该款项已于2017年12月27日支付；预提清算律师费10,000.00元，该款项已于2017年12月27日支付；预提清算审计费25,000.00元，该款项已于2017年12月29日支付；预提银行间账户维护费12,600.00元，其中，预提中央国债登记结算有限责任公司账户维护费为6,000.00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4,500.00元，该款项已于2018年1月15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6,600.00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4,500.00元，该款项已于2018年1月12日支付，故将差额部分冲回，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12月18日基金净资产 | 5,512,752.86 |
| 加：清算期间（2017年12月19日至2018年1月22日）收益 |  |
| 1、利息收入（注1） | 3,788.48 |
| 2、债券变现收益（注2） |  -7,755.71 |
| 3、其他收入（注3） | 3,600.00 |
| 减：清算期间（2017年12月19日至2018年1月22日）费用 |  |
| 4、交易费用（注4） | 498.11 |
| 5、银行划款手续费（注5） | 30.00 |
| 二、2018年1月22日（清算报告出具日）基金净资产 | 5,511,857.52 |

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2017年12月19日至2018年1月22日止清算期间的银行存款利息及结算备付金和存出保证金利息。

 2、债券变现损益为本次清算期间债券资产变现金额，与最后运作日估值金额相减的差额。

 3、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。

 4、交易费用为本次清算期间债券变现所产生的交易费用。

 5、银行划款手续费为本次清算期间银行账户划款产生的手续费。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2018年1月22日,本基金剩余财产为5,511,857.52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2018年1月23日至清算款项支付日的银行划款手续费由基金份额持有人承担。

自本次清算期结束日次日2018年1月23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 嘉实稳泰债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 嘉实稳泰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

**嘉实稳泰债券型证券投资基金基金财产清算小组**

**二〇一八年一月二十二日**