

嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金

2017年年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
送出日期:2018年03月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月23日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资有风险，投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金
基金简称	嘉实稳瑞纯债债券
基金代码	002548
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月18日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	1,397,417,866.99
基金合同存续期	不长期

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制组合风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定持续回报。

投资策略 本基金通过对宏观经济、货币政策及资金面的综合分析，把握市场投资机会，通过资产配置、行业配置、个券选择等多方面，确保在保证流动性的基础上，为基金份额持有人谋求最大投资回报。

业绩比较基准 一揽子货币市场基金收益×1%

风险收益特征 本基金为货币市场基金，具有收益稳定、风险较低的特征，适合于追求稳定收益的投资者。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
姓名	胡明锐	沈伟
信息披露负责人	胡明锐	021-68475888
电子邮箱	service@fund.cn	sheyu@shanghang.com
客户服务电话	400-800-8800	95594
传真	01065215588	021-68476935

2.4 信息披露方

基金管理人/基金托管人/互联网网址 <http://www.jfnd.cn>
基金年度报告备置地 北京市建国门北大街8号华润大厦嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要会计数据、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 期初数据和指标	2017年	2016年
本期实现收益	-18,261,305.53	7,936,350.77
本期利润	3,779,057.21	-24,584,082.72
加权平均基金份额本期利润	0.0028	-0.0048
本期末可供分配利润	0.02%	-0.02%
本期平均净值增长率	-0.27%	-0.02%
本期基金份额净值增长率为	0.008%	0.58%
3.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	37,752,076.52	53,339,091.17
期末可供分配利润	0.0270	0.0578
期末基金资产净值	1,435,169,943.51	975,583,223.55
期末基金资产净值	1.027	1.058
3.3 期末数据和指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率为	5.86%	5.80%

注: 1) 本期已实现收益指本基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益);扣除非费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2) 上述基金业绩比较基准不包括所有以认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字;3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.10%	0.05%	0.63%	0.01%	-0.73%	0.04%
过去六个月	0.28%	0.05%	1.27%	0.01%	-0.98%	0.04%
过去一年	0.03%	0.05%	2.53%	0.01%	-2.47%	0.00%
自基金成立以来至今	5.86%	0.28%	4.58%	0.01%	1.28%	0.27%

注:本基金业绩比较基准为:“一年期银行定期存款收益(税后)+1%”

上述“一年期银行定期存款收益率”是指中国人民银行公布的执行的金融机构一年期存款基准利率。

本基金的业绩基准数据按约定由基金管理人计算,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同、(十二)、(二)、(三)、(四)投资限制的有关规定。

2017年7月6日,本基金管理人发函(关于增聘嘉实稳瑞纯债债券基金经理的公告),增聘崔维维女士担任本基金基金经理职务,与基金经理携手共同管理本基金。

3.2.2 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效日为2016年3月18日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2016年3月18日至2017年12月31日。

注:1)按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同、(十二)、(二)、(三)、(四)投资限制的有关规定。

2017年7月6日,本基金管理人发函(关于增聘嘉实稳瑞纯债债券基金经理的公告),增聘崔维维女士担任本基金基金经理职务,与基金经理携手共同管理本基金。

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效日为2016年3月18日,2016年相关的数据根据当年实际数据,2016年3月18日至2016年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:1)按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同、(十二)、(二)、(三)、(四)投资限制的有关规定。

2017年3月18日至2017年12月31日)。

注:本基金管理人对本年度报告中财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告内容,认为复核报告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

5.3 管理人对年度报告中财务数据、净值表现、利润分配情况的说明

5.4 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

5.5 管理人对报告期内基金投资策略的说明

5.6 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

5.7 管理人对报告期内基金费用的说明

5.8 管理人对报告期内基金收益的说明

5.9 管理人对报告期内基金费用的说明

5.10 管理人对报告期内基金费用的说明

5.11 管理人对报告期内基金费用的说明

5.12 管理人对报告期内基金费用的说明

5.13 管理人对报告期内基金费用的说明

5.14 管理人对报告期内基金费用的说明

5.15 管理人对报告期内基金费用的说明

5.16 管理人对报告期内基金费用的说明

5.17 管理人对报告期内基金费用的说明

5.18 管理人对报告期内基金费用的说明

5.19 管理人对报告期内基金费用的说明

5.20 管理人对报告期内基金费用的说明

5.21 管理人对报告期内基金费用的说明

5.22 管理人对报告期内基金费用的说明

5.23 管理人对报告期内基金费用的说明

5.24 管理人对报告期内基金费用的说明

5.25 管理人对报告期内基金费用的说明

5.26 管理人对报告期内基金费用的说明

5.27 管理人对报告期内基金费用的说明

5.28 管理人对报告期内基金费用的说明

5.29 管理人对报告期内基金费用的说明

5.30 管理人对报告期内基金费用的说明

5.31 管理人对报告期内基金费用的说明

5.32 管理人对报告期内基金费用的说明

5.33 管理人对报告期内基金费用的说明

5.34 管理人对报告期内基金费用的说明

5.35 管理人对报告期内基金费用的说明

5.36 管理人对报告期内基金费用的说明

5.37 管理人对报告期内基金费用的说明

5.38 管理人对报告期内基金费用的说明

5.39 管理人对报告期内基金费用的说明

5.40 管理人对报告期内基金费用的说明

5.41 管理人对报告期内基金费用的说明

5.42 管理人对报告期内基金费用的说明

5.43 管理人对报告期内基金费用的说明

5.44 管理人对报告期内基金费用的说明

5.45 管理人对报告期内基金费用的说明

5.46 管理人对报告期内基金费用的说明

5.47 管理人对报告期内基金费用的说明

5.48 管理人对报告期内基金费用的说明

5.49 管理人对报告期内基金费用的说明

5.50 管理人对报告期内基金费用的说明

5.51 管理人对报告期内基金费用的说明

5.52 管理人对报告期内基金费用的说明

5.53 管理人对报告期内基金费用的说明

5.54 管理人对报告期内基金费用的说明

5.55 管理人对报告期内基金费用的说明

5.56 管理人对报告期内基金费用的说明

5.57 管理人对报告期内基金费用的说明

5.58 管理人对报告期内基金费用的说明

5.59 管理人对报告期内基金费用的说明

5