

# 嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2019 年第 1 号)

基金管理人：嘉合基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一九年七月

## 【重要提示】

一、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金（“本基金”）经 2018 年 8 月 21 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1357 号）注册，进行募集，本基金的基金合同于 2018 年 11 月 22 日正式生效。

二、嘉合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益或市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

三、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的市场风险、管理风险、职业道德风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、合规性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的投资管理风险、其他风险等。

四、本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低预期风险、预期收益的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并自行承担投资风险。

五、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

七、本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 22 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 3 月 31 日（本招募说明书中的财务资料未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：嘉合基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 楼

法定代表人：郝艳芬

成立日期：2014 年 7 月 30 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监许可[2014]621 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 30,000 万元

存续期间：永久存续

联系人：商林华

电话：021-60168300

股权结构：中航信托股份有限公司占 27.27%、上海慧弘实业集团有限公司占 27.27%、广东万和集团有限公司占 22.73%、福建圣农控股集团有限公司占 18.18%、北京智勇仁信投资咨询有限公司占 4.55%。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

郝艳芬女士，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士。曾就职于中国农业银行青岛分行、上海慧弘实业集团有限公司等单位，现任嘉合基金管理有限公司董事长。

刘燕女士，江西省教育学院学士。曾就职于中国农业银行、江南证券有限责任公司、江西江南信托投资股份有限公司等单位，现任中航信托股份有限公司计划财务部总经理兼工会副主席，兼任嘉合基金管理有限公司董事。

朱秋燕女士，江西财经大学硕士。曾担任中航信托股份有限公司投资管理部投资经理助理、投资经理，现任中航信托股份有限公司投资管理部高级投资经理，兼任嘉合基金管理有限公司董事。

卢础其先生，现任广东万和集团有限公司董事、广东顺德农村商业银行股份有限公司董事、广东揭东农村商业银行股份有限公司董事、佛山市顺德万和电气配件有限公司监事、万和国际（香港）有限公司董事及广东万和新电气股份有限公司董事长，兼任嘉合基金管理有限公司董事。

陈剑华先生，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士。曾就职于福建华兴证券公司、福建省资信评估公司、华泰证券有限责任公司等多家金融企业单位，负责多家上市公司的股份制改制、股票发行上市和企业收购兼并工作。现任福建圣农发展股份有限公司副总经理、董事会秘书，兼任嘉合基金管理有限公司董事。

蔡奕先生，厦门大学法学博士。曾在深圳证券交易所博士后工作站工作，先后任深圳证券交易所综合研究所副所长、深圳证券交易所市场监察部副总监，现任嘉合基金管理有限公司总经理、董事。

曹凤岐先生，北京大学经济学院毕业。现为北京大学光华管理学院荣休教授、博士生导师，北京大学金融与证券研究中心主任，并任教育部社会科学委员会委员，中国金融学会常务理事，中国投资学会常务理事，北京市金融学会副会长等职，兼任嘉合基金管理有限公司独立董事。

姚长辉先生，北京大学金融学博士。现为北京大学光华管理学院教授、博士生导师，北京大学金融与证券研究中心副主任，北京大学创业投资研究中心副主任，北京大学保险与社会保障研究生中心副主任，中国金融学会理事，北京市金融学会理事，北京市投资学会理事，兼任嘉合基金管理有限公司独立董事。

刘振亚先生，中国人民大学经济学博士。曾担任国际货币基金总部华盛顿亚洲局经济学家、中国人民大学金融与证券研究所所长助理兼研究总部主任、中国人民大学世界经济研究所所长等职务，现为中国人民大学财政金融学院教授、博士生导师，英国伯明翰大学国际金融与跨国银行项目教授，兼任嘉合基金管理有限公司独立董事。

### 2、监事会成员

单兵先生，监事会主席，上海财经大学硕士，上海交通大学学士。曾就职于南通机床股份有限公司、国信证券有限责任公司、兴安证券有限责任公司、上海源吉投资有限公司、江苏瑞华投资控股集团有限公司、上海凯石益正资产管理有限公司、上海贝元投资管理有限公司等单位，现任嘉合基金管理有限公司监事会主席。

卢宇凡先生，监事，英国伯恩茅斯大学硕士。曾就职于格兰仕集团、佛山市宏图中宝电缆有限公司等单位，现任广东万和新电气股份有限公司副总裁、董事会秘书。

廖俊杰先生，监事，同济大学硕士。现任福建圣农控股集团有限公司副总经理、董事会秘书。

付祥先生，职工监事，南京大学硕士、学士。曾就职于华泰证券股份有限公司，现任嘉合基金管理有限公司量化衍生品投资部副总监。

刘歆茹女士，职工监事，武汉大学硕士、学士。现任嘉合基金管理有限公司投研体系风控合规高级专员。  
王奕人先生，职工监事，美国德雷塞尔大学硕士，山东大学学士。现任嘉合基金管理有限公司量化衍生品投资部投资经理。

### 3、高级管理人员

郝艳芬女士，简历同上，现任嘉合基金管理有限公司董事长。

蔡奕先生，简历同上，现任嘉合基金管理有限公司总经理。

崔为中先生，武汉大学法学院硕士。曾任中创投资公司海南代表处系统管理员资金主管，中诚信证券评估公司海南分公司电脑部经理、办公室副主任，长城证券公司信息技术部总助，英大证券公司IT技术总监，嘉合基金管理有限公司副总经理，现任嘉合基金管理有限公司督察长。

高明先生，英国诺丁汉大学商学院硕士。曾任中国石化集团市场开发部经理、财务部经理，加拿大贝祥投资集团高级投资经理，中非发展基金有限公司投资二部总经理助理，现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

张文炜先生，武汉大学金融学硕士。曾在马应龙药业集团股份有限公司、广东盈峰创业投资管理有限公司等单位任职，曾任嘉合基金管理有限公司董事会秘书、总经理助理，现任嘉合基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

沈珂先生，南京大学信息学学士。曾任交银施罗德基金管理有限公司信息技术部高级工程师，国联安基金管理有限公司信息技术部总监助理，嘉合基金管理有限公司信息技术部总监、总经理助理等职务，现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

### 4、基金经理

季慧娟女士，上海财经大学经济学硕士，同济大学经济学学士，拥有12年金融从业经验。曾任华宝信托有限责任公司交易员，德邦基金管理有限公司债券交易员兼研究员，中欧基金管理有限公司债券交易员。2014年12月加入嘉合基金管理有限公司。季慧娟女士于2015年7月8日起管理嘉合货币市场基金和嘉合磐石混合型证券投资基金，嘉合货币市场基金历任基金经理分别为薛思乔（任职时间为2015.5.6-2016.7.28）、季慧娟、于启明（任职时间为2016.1.22至今）；嘉合磐石混合型证券投资基金的历任基金经理分别为薛思乔（任职时间为2015.7.3-2016.7.28）、季慧娟、于启明（任职时间为2016.1.22至今）、骆海涛（任职时间为2017.12.12至今）；季慧娟女士曾于2018年1月24日至2019年6月4日期间管理嘉合磐通债券型证券投资基金，该基金的历任基金经理分别为季慧娟、李国林（任职时间为2019.1.25至今）、于启明（任职时间为2019.3.13至今）；季慧娟女士于2018年11月22日起管理嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金，该基金的历任基金经理为季慧娟、于启明（任职时间为2018.11.22至今）。

于启明先生，上海财经大学经济学硕士，厦门大学经济学学士，拥有12年金融从业经历。曾任宝盈货币市场证券投资基金基金经理和宝盈祥瑞养老证券投资基金基金经理。2015年6月加入嘉合基金管理有限公司。于启明先生在嘉合基金期间，于2016年1月22日起管理嘉合货币市场基金和嘉合磐石混合型证券投资基金，嘉合货币市场基金历任基金经理分别为薛思乔（任职时间为2015.5.6-2016.7.28）、季慧娟（任职时间为2015.7.8至今）、于启明；嘉合磐石混合型证券投资基金的历任基金经理分别为薛思乔（任职时间为2015.7.3-2016.7.28）、季慧娟（任职时间为2015.7.8至今）、于启明、骆海涛（任职时间为2017.12.12至今）；于启明先生于2018年11月22日起管理嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金，该基金的历任基金经理为季慧娟（任职时间为2018.11.22至今）、于启明；于2019年3月13日起管理嘉合磐通债券型证券投资基金，该基金的历任基金经理分别为季慧娟（任职时间为2018.1.24-2019.6.4）、李国林（任职时间为2019.1.25至今）、于启明。现于启明先生拟担任处于募集期的嘉合磐泰短债债券型证券投资基金的基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

蔡奕先生，简历同上。

姚春雷先生，上海大学产业经济学硕士，西安交通大学工学学士，曾任天一证券有限公司高级研究员、国元证券股份有限公司资产管理部研究总监、睿谷投资有限公司权益投资部投资总监，2017年加入嘉合基

金管理有限公司。

付祥先生，简历同上。

姚文辉先生，西安交通大学应用经济学硕士。曾任金元证券股份有限公司固定收益总部债券投资经理、中欧基金管理有限公司中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧货币市场基金基金经理、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理，2015年加入嘉合基金管理有限公司。

骆海涛先生，美国密歇根大学金融工程硕士，亚利桑那大学光学博士，上海交通大学应用物理学学士和凝聚态物理硕士。曾任美国普氏能源（Platts）公司量化分析师，平安资产管理公司和平安投管中心任战略资产配置团队负责人，2015年加入嘉合基金管理有限公司。

管仁贤先生，西安交通大学管理科学与工程硕士，西安理工大学管理工程学士。曾任上海远东资信评估有限公司分析师、万银国际投资基金（中国）有限公司投资经理、信泰人寿保险股份有限公司投资经理、建信人寿保险有限公司投资经理，2016年加入嘉合基金管理有限公司。

李国林先生，浙江工商大学经济学硕士，曾任上银基金管理有限公司专户投资部总监兼研究总监、上海凯石益正资产管理有限公司投资总监、凯石基金管理有限公司投资事业部总监，2018年加入嘉合基金管理有限公司。

梁凯先生，复旦大学金融工程管理硕士，曾任上海凯石益正资产管理有限公司另类投资部研究员，珠海盈米财富管理有限公司 FOF 研究院研究员，2017年加入嘉合基金管理有限公司。

王玉英女士，厦门大学金融学博士，曾任上海凯石投资管理有限公司研究员、上海凯石益正资产管理有限公司投资经理、上海贝元投资管理有限公司研究部总监兼基金经理，2018年加入嘉合基金管理有限公司。

朱萍女士，上海大学工商管理学士，曾任诺德基金管理有限公司投资研究部投研助理、上海朴石投资管理合伙企业（有限合伙）交易主管，2014年加入嘉合基金管理有限公司。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经

营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准

(ISAE3402) 认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 440 只。

### (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

#### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

#### 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、直销机构

###### (1) 嘉合基金管理有限公司直销中心

名称：嘉合基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 楼

法定代表人：郝艳芬

电话：021-60168270

传真：021-65015087

联系人：商林华

客户服务电话：400-060-3299

网址：[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)

###### (2) 嘉合基金管理有限公司网上交易平台

网址：<https://trade.haoamc.com/etrading/>

###### (3) 嘉合基金管理有限公司微信交易平台

微信公众号：嘉合基金

##### 2、其他销售机构

###### (1) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客服电话：95511

联系人：赵杨

网址：<http://bank.pingan.com>

###### (2) 江西银行股份有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区金融大街 699 号

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区金融大街 699 号

法定代表人：陈晓明

客服电话：400-78-96266

联系人：万俊

网址：[www.jx-bank.com](http://www.jx-bank.com)

###### (3) 江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市秦淮区中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市秦淮区中华路 26 号

法定代表人：夏平

客服电话：95319

联系人：展海军

网址：[www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn)

###### (4) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523

联系人：陈飙

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(5) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李琦

客服电话：4008-000-562

联系人：王怀春

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(6) 联讯证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

客服电话：95564

联系人：彭莲

网址：[www.lxsec.com](http://www.lxsec.com)

(7) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511

联系人：周一涵

网址：<http://stock.pingan.com>

(8) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层-18 层

法定代表人：冯鹤年

客户服务电话：95376

联系人：韩秀萍

公司网址：[www.msyzq.com](http://www.msyzq.com)

(9) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼

法定代表人：孙树明

客户服务电话：95575

联系人：马梦洁

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(10) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座

法定代表人：蔡咏

客户服务电话：95578

联系人：米硕

公司网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

（11）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：95329

联系人：罗艺琳

公司网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

（12）国融证券股份有限公司

注册地址：北京西城区宣武门西大街 129 号金隅大厦 16 层

办公地址：北京西城区宣武门西大街 129 号金隅大厦 16 层

法定代表人：张智河

客服电话：95385

联系人：叶密林

网址：[www.grzq.com](http://www.grzq.com)

（13）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜味军

客服电话：400-8323-000

联系人：王雯

网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

（14）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

客服电话：95351

联系人：江恩前

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

（15）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

办公地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

法定代表人：庞介民

客服电话：4001966188

联系人：熊丽

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

（16）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦



A 栋 41 层

法定代表人：王晓峰

客服电话：95335

联系人：王紫雯

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(17) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 楼

法定代表人：曹宏

客服电话：400-6666-888

联系人：金夏

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(18) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888

联系人：辛国政

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(19) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 16 楼

法定代表人：陈宏

客服电话：95357

联系人：付佳

网址：[www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

(20) 首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

客服电话：400-620-0620

联系人：李淑敏

公司网址：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

(21) 中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

客服电话：400-620-8888

联系人：许慧琳

网址：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

(22) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

联系人：范超

公司网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(23) 联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层

法定代表人：吕春卫

客服电话：400-620-6868

联系人：丁倩云

公司网址：[www.lczq.com](http://www.lczq.com)

(24) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦

法定代表人：李科

客服电话：95510

联系人：杨超

网址：[fund.sinosig.com](http://fund.sinosig.com)

(25) 方德保险代理有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711

办公地址：北京市东城区东直门外大街 46 号

法定代表人：林柏均

客服电话：010-64068617

联系人：刘亚慧

网址：[www.fundsure.cn](http://www.fundsure.cn)

(26) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-0766-123

联系人：韩爱彬

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(27) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

联系人：陈孜明

网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

(28) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：400-1818188

联系人：朱玉

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(29) 一路财富(北京)基金销售股份有限公司

注册地址: 北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址: 北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人: 吴雪秀

客服电话: 400-001-1566

联系人: 吕晓歌

网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(30) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦15F

法定代表人: 王之光

客服电话: 4008219031

联系人: 程晨

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(31) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人: 杨文斌

客服电话: 400-700-9665

联系人: 高源

网址: [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(32) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人: 王翔

客服电话: 400-820-5369

联系人: 吴鸿飞

网址: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(33) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-9059

联系人: 李瑞真

网址: [www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(34) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

联系人: 梁文燕

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(35) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室  
法定代表人：TEO WEE HOWE  
客服电话：400-684-0500  
联系人：叶健  
网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(36) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室  
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场15楼  
法定代表人：陈洪生  
客服电话：400-918-0808  
联系人：吕君  
网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

(37) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼  
法定代表人：陈继武  
客服电话：4006-433-389  
联系人：高皓辉  
网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(38) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  
法定代表人：黄欣  
客服电话：400-6767-523  
联系人：戴珉微  
网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

(39) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67  
办公地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼  
法定代表人：于龙  
客服电话：4006-802-123  
联系人：吴鹏  
网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(40) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室  
办公地址：北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层  
法定代表人：钱昊旻  
客服电话：4008-909-998  
联系人：沈晨  
网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(41) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室  
办公地址：杭州市文二西路1号903室

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

联系人：费超超

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(42) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客服电话：021-50810673

联系人：孙琦

网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

(43) 大河财富基金销售有限公司

注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

客户服务电话：0851-88235678

联系人：胡越

公司网址：[www.urainf.com](http://www.urainf.com)

(44) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

客户服务电话：400-8980-618

联系人：侯艳红

公司网址：[www.chtwm.com](http://www.chtwm.com)

(45) 洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室

办公地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室

法定代表人：任淑楨

客服电话：400 8189 598

联系人：李慧慧

网址：[www.hongtaiwealth.com](http://www.hongtaiwealth.com)

(46) 北京恒宇天泽基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 883 室

办公地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 883 室

法定代表人：梁越

客服电话：400-188-8848

联系人：李晨

网址：[www.1314fund.com](http://www.1314fund.com)

(47) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-159-9288

联系人：侯芳芳

网址：danjuanapp.com

网址：danjuanapp.com

(48) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客户服务电话：400-618-0707

联系人：姜颖

公司网址：www.hongdianfund.com

公司网址：www.hongdianfund.com

(49) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海浦东新区银城中路 8 号 4 楼

办公地址：上海浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：刘惠

客户服务电话：400-808-1016

联系人：毛林

公司网址：www.fundhaiyin.com

(50) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

客户服务电话：400-673-7010

联系人：李海燕

公司网址：www.jianfortune.com

(51) 泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层

办公地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号世贸大厦 C 座 5 层

法定代表人：李静

客服电话：400-004-8821

联系人：李丹

网址：www.hxlc.com

(52) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层

5312-15 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层

5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

联系人：李雯

网址：www.harvestwm.cn

(53) 北京富国大通基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区首体南路 9 号 4 楼 3 层 302-01

办公地址：北京市海淀区首体南路 9 号 4 楼 3 层 302-01

法定代表人：宋宝峰

客服电话：400-088-0088

联系人：方芳

网址：[www.fuguowealth.com](http://www.fuguowealth.com)

(54) 北京辉腾汇富基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层

法定代表人：许宁

客服电话：400-829-1218

联系人：彭雪琳

网址：[www.htfund.com](http://www.htfund.com)

(55) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

联系人：魏晨

网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(56) 北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号

法定代表人：季长军

客服电话：400-188-5687

联系人：佟晟

网址：[www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

(二) 登记机构

名称：嘉合基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 楼

法定代表人：郝艳芬

电话：021-60168300

传真：021-65015080

联系人：蔡文婷

网址：[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：安冬、陆奇

联系人：陆奇

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号毕马威大楼八层

办公地址：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场二期25楼

合伙人：邹俊

电话：021-22123075

传真：021-62881889

联系人：张楠

经办注册会计师：张楠、叶凯韵

#### 四、基金的名称

嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金

#### 五、基金的类型

基金类型：债券型证券投资基金

#### 六、基金的运作方式

契约型开放式基金

#### 七、基金的投资目标

本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，在合理充分的定量分析及定性研究基础上，通过参与债券类资产的投资运作，力争获取超越基准的稳健回报。

#### 八、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、现金以及其他货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人可在履行适当程序后，调整上述投资品种的投资比例。

#### 九、基金的投资策略

本基金通过对国内外宏观经济形势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，调整和构建固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。

##### 1、利率预期策略

通过全面研究国内外经济形势、经济增长、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济，预测货币政策、财政政策等宏观经济政策取向，结合金融市场资金供求状况变化趋势及结构，进一步预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线变化趋势。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期，及时调整组合的目标久期。

##### 2、信用债券投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析信用债等发行人所处行业发展前景、业务状况、市场竞争地位、财务状况、债务水平和管理水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用风险级别，确定相关信用债的信用风险利差。并进一步根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。



### 3、资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估算违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。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。

#### 十、基金的投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金的债券投资比例不低于基金资产的 80%；
- (2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (9) 本基金应投资于主体信用评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其评级等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (10) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (11) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- (12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (13) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (14) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述投资限制第(2)、(9)、(12)、(13)项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

##### 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

#### 十一、基金的业绩比较基准

##### 中债综合全价指数收益率

中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合全价指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中债综合全价指数收益率作为业绩比较基准。

如果法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，在取得基金托管人同意并报中国证监会备案后调整本基金的业绩比较基准并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

#### 十二、基金的风险收益特征

本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低预期风险、预期收益的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

#### 十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年6月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日。所列财务数据未经审计。

##### 1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 权益投资 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 584,812,000.00 92.32

其中：债券 584,812,000.00 92.32

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 39,744,000.00 6.27

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 1,654,173.42 0.26

8 其他资产 7,263,831.44 1.15

9 合计 633,474,004.86 100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 --

2 央行票据 --

3 金融债券 483,997,000.00 105.17

其中：政策性金融债 483,997,000.00 105.17

4 企业债券 70,650,000.00 15.35

5 企业短期融资券 30,165,000.00 6.55

6 中期票据 --

7 可转债（可交换债） --

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 584,812,000.00 127.08

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 170402 17 农发 02 2,900,000 292,233,000.00 63.50

2 190203 19 国开 03 1,100,000 109,560,000.00 23.81

3 180204 18 国开 04 500,000 52,375,000.00 11.38

4 143587 18 航集 02 300,000 30,384,000.00 6.60

5 011801955 18 西安高新 SCP009 300,000 30,165,000.00 6.55

## 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 71,270.44

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 5,603,857.03

5 应收申购款 1,588,703.97

6 其他应收款 -

7 其他 -

8 合计 7,263,831.44

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 十四、基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 年 3 月 31 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

#### 1、嘉合磐稳 A

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

2018 年 11 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日 0.28% 0.05% 0.71% 0.06% -0.43% -0.01%

基金合同生效日至

2019 年 3 月 31 日 1.66% 0.04% 1.19% 0.05% 0.47% -0.01%

#### 2、嘉合磐稳 C

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

2018 年 11 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日 0.26% 0.05% 0.71% 0.06% -0.45% -0.01%

基金合同生效日至

2019 年 3 月 31 日 1.58% 0.04% 1.19% 0.05% 0.39% -0.01%

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、本基金合同 2018 年 11 月 22 日生效，截至 2019 年 3 月 31 日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效起 6 个月内为建仓期，截至 2019 年 3 月 31 日本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

1、本基金合同 2018 年 11 月 22 日生效，截至 2019 年 3 月 31 日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效起6个月内为建仓期，截至2019年3月31日本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

## 十五、基金的费用和税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.2%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

4、上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 十六、对招募说明书更新部分的说明

嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规及《嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：

- 1、在“重要提示”部分，增加基金合同生效日期，更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。本基金的基金合同于 2018 年 11 月 22 日正式生效。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 22 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 3 月 31 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）
- 2、“第三部分 基金管理人”，根据实际情况更新了基金管理人的相关信息。
- 3、“第四部分 基金托管人”，根据实际情况更新了基金托管人的相关信息。
- 4、“第五部分 相关服务机构”，对其他销售机构进行了更新，相关事宜均已公告，更新了审计基金财产的会计师事务所相关信息。
- 5、“第六部分 基金的募集”，进行了精简，增加了基金募集情况说明。删除了与基金募集相关内容，只保留募集依据、基金类型、存续期间、募集期限、募集对象等内容，并增加了基金募集情况说明。
- 6、“第七部分 基金合同的生效”，增加了基金合同生效的相关信息。本基金的基金合同于 2018 年 11 月 22 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金
- 7、“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”，根据本基金基金合同和管理人相关公告进行了更新。对申购和赎回的数量限制等内容进行了修订。
- 8、“第九部分 基金的投资”，新增基金投资组合报告，并注明托管人复核时间，所载财务数据的截止时间为 2019 年 3 月 31 日。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计。
- 9、“第十部分 基金的业绩”，新增“第十部分 基金的业绩”，基金业绩的截止时间为 2019 年 3 月 31 日。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计。
- 10、“第二十分 基金托管协议的内容摘要”，根据实际情况进行了更新。
- 11、“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”，更新了部分表述。
- 12、“第二十二部分 其他应披露事项”，新增“第二十二部分 其他应披露事项”，根据实际情况列举了 2018 年 9 月 27 日（基金发售日的次日）至 2019 年 5 月 22 日期间涉及本基金的相关公告。

嘉合基金管理有限公司

二〇一九年七月