

嘉合磐石混合型证券投资基金2017年半年度报告

2017年06月30日

基金管理人：嘉合基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2017年08月26日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月24日复核了本报告中的财务指标、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。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

§1	重要提示及目录	2
§2	基金简介	5
	2.1 基金基本情况	5
	2.2 基金产品说明	5
	2.3 基金管理人和基金托管人	6
	2.4 信息披露方式	6
	2.5 其他相关资料	6
§3	主要财务指标和基金净值表现	7
	3.1 主要会计数据和财务指标	7
	3.2 基金净值表现	7
§4	管理人报告	9
	4.1 基金管理人及基金经理情况	9
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
	4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
§5	托管人报告	12
	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
	5.2 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
	5.3 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
	6.1 资产负债表	12
	6.2 利润表	14
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
	6.4 报表附注	17
§7	投资组合报告	40
	7.1 期末基金资产组合情况	40
	7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
	7.6 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	42
	7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
	7.8 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贵金属投资明细	42
	7.9 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	42
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
	7.12 投资组合报告附注	43
§8	基金份额持有人信息	44
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	45
	8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	45
§9	开放式基金份额变动	45
§10	重大事件揭示	45
	10.1 基金份额持有人大会决议	45
	10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
	10.4 基金投资策略的改变	46
	10.5 基金改聘会计师事务所情况	46
	10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	46
	10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46

10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合磐石混合型证券投资基金	
基金简称	嘉合磐石	
基金主代码	001571	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月03日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	56,213,767.52	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	嘉合磐石A	嘉合磐石C
下属两级基金的交易代码	001571	001572
报告期末下属两级基金的份额总额	248,170.65	55,965,596.87

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险、保持组合流动性的前提下，本基金通过大类资产配置，优选投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，对宏观经济形势与资本市场环境深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略。（一）债券投资策略 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。（二）股票投资策略 通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判。（三）权证投资策略 通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，进行限量、趋势投资。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率（税后）+3%

风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。	
下属两级基金的风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

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	嘉合基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蔡奕
	联系电话	021-60168353
	电子邮箱	cai yi@haoamc.com
客户服务电话	400-0603-299	95511-3
传真	021-65015077	0755-82080387
注册地址	上海市虹口区广纪路738号1幢329室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼1-2层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码	200082	518001
法定代表人	徐岱	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼 1-2层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	嘉合磐石A	嘉合磐石C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）	
本期已实现收益	1,007,238.10	18,411.68
本期利润	745,205.27	11,414.51
加权平均基金份额本期利润	0.0186	0.0043
本期基金加权平均净值利润率	1.67%	0.39%
本期基金份额净值增长率	0.64%	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	26,687.65	5,210,953.96
期末可供分配基金份额利润	0.1075	0.0931
期末基金资产净值	274,858.30	61,176,550.83
期末基金份额净值	1.1080	1.0930
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.80%	9.30%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

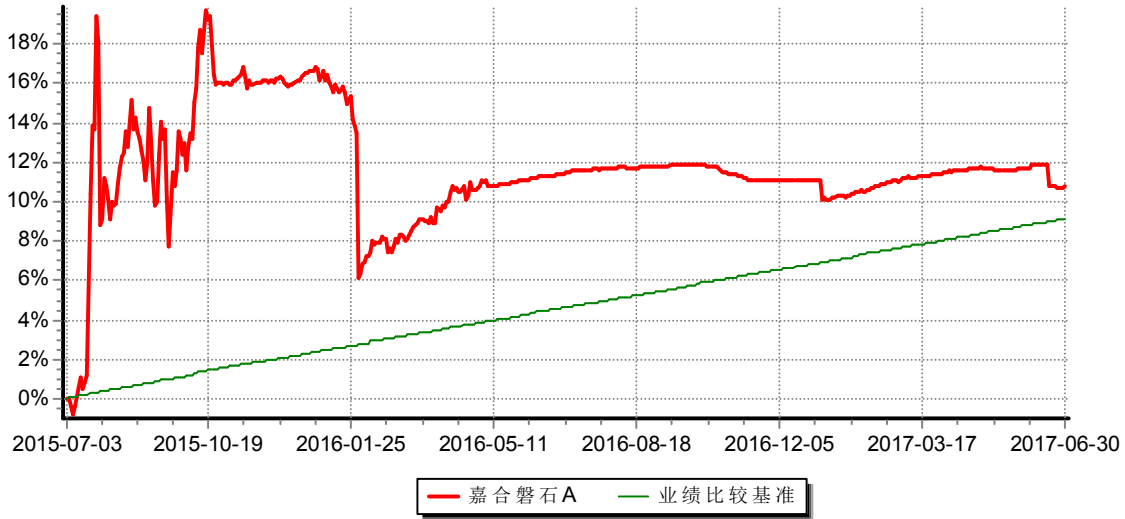
3.2 基金净值表现

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

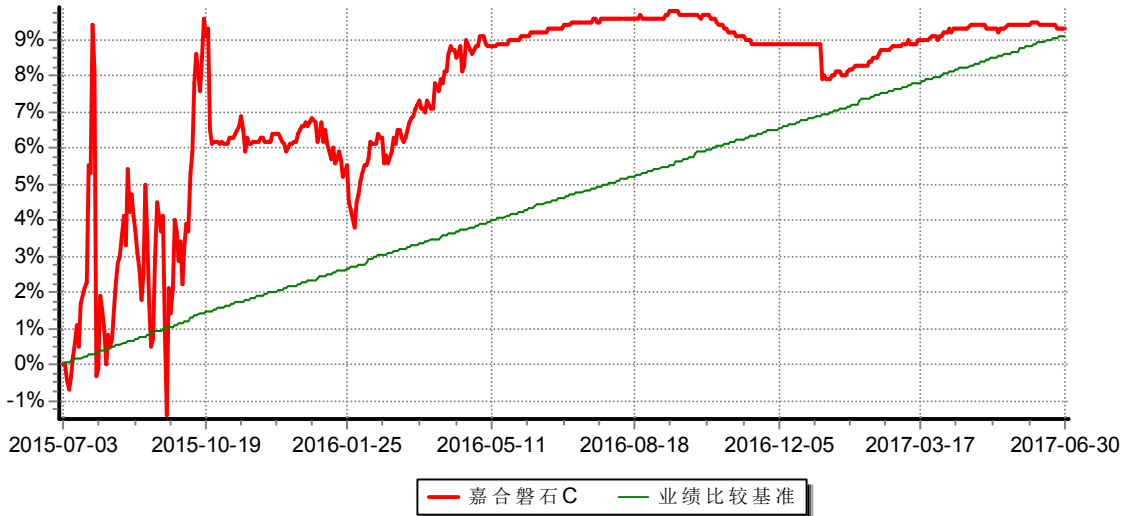
阶段	份额净	份额净	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

(嘉合磐石A)	值增长率①	值增长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去一个月	-0.81%	0.22%	0.37%	0.00%	-1.18%	0.22%
过去三个月	-0.54%	0.14%	1.12%	0.00%	-1.66%	0.14%
过去六个月	0.64%	0.10%	2.23%	0.00%	-1.59%	0.10%
过去一年	-0.54%	0.10%	4.50%	0.00%	-5.04%	0.10%
自基金合同生效日起至今(2015年07月03日-2017年06月30日)	10.80%	0.82%	9.10%	0.00%	1.70%	0.82%
阶段 (嘉合磐石C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.09%	0.03%	0.37%	0.00%	-0.46%	0.03%
过去三个月	0.18%	0.04%	1.12%	0.00%	-0.94%	0.04%
过去六个月	1.30%	0.05%	2.23%	0.00%	-0.93%	0.05%
过去一年	0.00%	0.09%	4.50%	0.00%	-4.50%	0.09%
自基金合同生效日起至今(2015年07月03日-2017年06月30日)	9.30%	0.62%	9.10%	0.00%	0.20%	0.62%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注：按基金合同规定，截至报告日本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。



注：按基金合同规定，截至报告日本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉合基金管理有限公司（以下简称“嘉合基金”）是经中国证监会【2014】621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，注册资本金1.1亿元人民币，经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、广东万和集

团有限公司、福建省圣农实业有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司，股权比例为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而，以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。

截至2017年6月30日，本基金管理人旗下共管理2只开放式基金，包括嘉合货币市场基金和嘉合磐石混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季慧娟	基金经理	2015年07月08日	—	10年	上海财经大学经济学硕士,同济大学经济学学士,拥有10年金融行业从业经验。历任华宝信托有限责任公司交易员,德邦基金管理有限责任公司债券交易员兼研究员,中欧基金管理有限责任公司债券交易员。2014年12月加入嘉合基金管理有限公司。
于启明	基金经理	2016年01月22日	—	10年	上海财经大学经济学硕士,厦门大学经济学学士,拥有10年证券从业经历。历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。

注：1、季慧娟和于启明的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运

用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，2017年1-5月，债券市场经历两轮深度调整，第一轮由于1月、3月央行两次上调公开市场利率，第二次轮由于四月监管升级，金融机构超调导致收益率快速上升。资金面在央行紧调控，强监管的去杠杆压力下也一度呈现紧张局面，短端收益率上行幅度更大，收益率曲线呈现明显“熊平”特征。六月随着监管放缓和资金面的改善，债券市场迎来强劲反弹，收益率重回陡峭。

权益市场，上半年市场在3000-3300区间内弱势箱体震荡，再融资和减持新规缓解了市场失血状况，但增量资金不足，成交量维持低位，少数白龙马头享受了确定性溢价，走出结构性行情。

本基金在报告期以持有高流动性短期利率债为主，审慎操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类基金份额净值收益率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为2.23%；C类基金份额净值收益率为1.30%，同期业绩比较基准收益率为2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2017年，债券市场的持续调整带动了实际利率上行并且逐渐扩散到实体经济的各个方面，权益市场、商品市场、房地产市场先后展开调整，前期涨幅较大的创业板股票，焦煤铁矿石以及一线城市租金价格调整尤为明显。展望2017年下半年，我们认为六月债券市场的收益率水平已经较为充分地反映了监管调整和经济预期带来的压力。下半年，货币政策有望回归真正的稳健中性，预计资金紧张局面将在一定程度上有所缓解。

对于权益市场，前期价值股出现显著上升，而创业板代表的多数股票出现了显著的回落，结构分化十分明显。未来阶段博弈焦点或将继续在于经济增长、通胀回升带来的利润增长与债券收益率上行导致机会成本上升之间的对比关系。权益市场的高估值预计仍需时间消化，未来阶段行情仍将以调整为主，可耐心等到更好的入场时点捕捉个股性、结构性机会。

本基金将仍以绝对收益为目标，实施灵活的大类资产配置策略，顺势而为，控制回撤，力争为投资者获取稳定增长的收益。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉合磐石混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2017年06月30日	2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	1,069,391.17	1,740,306.90
结算备付金		337,000.00	—
存出保证金		17,676.14	327.08
交易性金融资产	6.4.6.2	59,952,000.00	49,451,000.00
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		59,952,000.00	49,451,000.00
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.6.5	338,789.95	411,925.62
应收股利		—	—
应收申购款		1,000.00	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		61,715,857.26	51,603,559.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		2,077.93	974.53
应付管理人报酬		13,285.51	27,516.01
应付托管费		2,214.26	8,598.76

应付销售服务费		2,857.12	1,160.12
应付交易费用	6.4.6.7	1,025.00	25,734.01
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.8	242,988.31	490,000.00
负债合计		264,448.13	553,983.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	56,213,767.52	46,386,268.55
未分配利润	6.4.6.10	5,237,641.61	4,663,307.62
所有者权益合计		61,451,409.13	51,049,576.17
负债和所有者权益总计		61,715,857.26	51,603,559.60

注：1.报告截止日2017年06月30日，基金份额净值1.093元，A类基金份额净值1.108元，C类基金份额净值1.093元，基金份额总额56,213,767.52份，其中A类基金份额248,170.65份，C类基金份额55,965,596.87份。

6.2 利润表

会计主体：嘉合磐石混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间2016 年01月01日-2016年06 月30日
一、收入		1,115,379.16	-19,704,554.88
1.利息收入		810,701.54	8,287,481.14
其中：存款利息收入	6.4.6.11	20,664.70	274,508.76
债券利息收入		689,942.95	7,630,386.35
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		100,093.89	382,586.03

其他利息收入		—	—
2.投资收益		572,141.81	-13,347,803.10
其中：股票投资收益	6.4.6.12	—	-16,523,782.79
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.13	572,141.81	3,175,979.69
资产支持证券投资 收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.14	—	—
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益	6.4.6.15	-269,030.00	-14,645,469.10
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.6.16	1,565.81	1,236.18
减：二、费用		358,759.38	5,042,991.14
1. 管理人报酬		152,369.31	2,287,715.98
2. 托管费		31,776.48	714,911.30
3. 销售服务费		4,778.15	1,100,868.97
4. 交易费用	6.4.6.17	2,559.12	595,592.72
5. 利息支出		15,684.25	61,551.61
其中：卖出回购金融资产 支出		15,684.25	61,551.61
6. 其他费用	6.4.6.18	151,592.07	282,350.56
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		756,619.78	-24,747,546.02
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		756,619.78	-24,747,546.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合磐石混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	46,386,268.55	4,663,307.62	51,049,576.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	756,619.78	756,619.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	9,827,498.97	-182,285.79	9,645,213.18
其中：1.基金申购款	55,462,521.77	5,166,903.18	60,629,424.95
2.基金赎回款	-45,635,022.80	-5,349,188.97	-50,984,211.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	56,213,767.52	5,237,641.61	61,451,409.13
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,806,683,191.88	200,777,911.48	3,007,461,103.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-24,747,546.02	-24,747,546.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,748,267,026.91	-170,576,864.35	-2,918,843,891.26

其中：1.基金申购款	500,856.29	51,160.11	552,016.40
2.基金赎回款	-2,748,767,883.20	-170,628,024.46	-2,919,395,907.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	58,416,164.97	5,453,501.11	63,869,666.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

蔡奕

蔡奕

杨薇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉合磐石混合型证券投资基金(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")《关于准予嘉合磐石混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1243号文)批准,由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《嘉合磐石混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年7月3日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币2,380,564,724.89元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合磐石混合型证券投资基金基金合同》和《嘉合磐石混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-40%;现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证不超

过基金资产净值的3%；资产支持证券不超过基金资产净值的20%。本基金的业绩比较基准为一年期人民币定期存款利率(税后)+3%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况、2017年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与2016年年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴

息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股

票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准")，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助

服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品（含公开募集证券投资基金）过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为（以下称其他业务），继续按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额，未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至2017年6月30日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	1,069,391.17
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	1,069,391.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	—	—	—	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	59,951,580.00	59,952,000.00	420.00
	合计	59,951,580.00	59,952,000.00	420.00

资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	59,951,580.00	59,952,000.00	420.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2017年06月30日
应收活期存款利息	2,202.85
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	151.70
应收债券利息	336,427.40
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	8.00
合计	338,789.95

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	1,025.00
合计	1,025.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1.24
预提费用	242,987.07
合计	242,988.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (嘉合磐石A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	45,410,001.01	45,410,001.01
本期申购	86,437.46	86,437.46
本期赎回	-45,248,267.82	-45,248,267.82
期末数	248,170.65	248,170.65
项目 (嘉合磐石C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	976,267.54	976,267.54
本期申购	55,376,084.31	55,376,084.31
本期赎回	-386,754.98	-386,754.98
期末数	55,965,596.87	55,965,596.87

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (嘉合磐石A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,951,901.32	-3,365,851.57	4,586,049.75
本期利润	1,007,238.10	-262,032.83	745,205.27
本期基金份额交易产生的变动数	-8,912,784.96	3,608,217.59	-5,304,567.37
其中：基金申购款	15,354.25	-6,392.76	8,961.49
基金赎回款	-8,928,139.21	3,614,610.35	-5,313,528.86
本期已分配利润	—	—	—
本期末	46,354.46	-19,666.81	26,687.65

单位：人民币元

项目 (嘉合磐石C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	147,584.12	-70,326.25	77,257.87
本期利润	18,411.68	-6,997.17	11,414.51
本期基金份额交易产生的变动数	9,391,652.88	-4,269,371.30	5,122,281.58
其中：基金申购款	9,454,284.75	-4,296,343.06	5,157,941.69
基金赎回款	-62,631.87	26,971.76	-35,660.11
本期已分配利润	—	—	—
本期末	9,557,648.68	-4,346,694.72	5,210,953.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	19,664.39
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	671.16
其他	329.15

合计	20,664.70
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
卖出股票成交总额	—
减：卖出股票成本总额	—
买卖股票差价收入	—

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
债券投资收益——买卖债券、债转股及债券到期兑付差价收入	572,141.81
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	572,141.81

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交总额	111,909,854.13
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	110,166,954.01

减：应收利息总额	1,170,758.31
买卖债券差价收入	572,141.81

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
1.交易性金融资产	-269,030.00
——股票投资	—
——债券投资	-269,030.00
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-269,030.00

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
基金赎回费收入	1,565.81
合计	1,565.81

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	1.62

银行间市场交易费用	2,557.50
合计	2,559.12

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	108,191.88
其他费用	600.00
中债登	9,000.00
汇划手续费	5.00
上清所	9,000.00
合计	151,592.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东

上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建省圣农实业有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	152,369.31	2,287,715.98
其中：支付销售机构的客户维护费	1,657.34	6,588.62

注：2017年2月9日基金份额持有人大会通过了《关于嘉合磐石混合型证券投资基金降低基金管理费率和托管费率的有关事项的议案》，自该日起本基金管理费由0.8%年费率下降至0.6%年费率。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,776.48	714,911.30

注：2017年2月9日基金份额持有人大会通过了《关于嘉合磐石混合型证券投资基金降低基金管理费和托管费率的有关事项的议案》，自该日起本基金托管费由0.25%年费率下降至0.1%年费率。

基金托管费按前一日的基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合磐石A	嘉合磐石C	合计
嘉合基金管理有限公司	—	2,673.64	2,673.64
平安银行股份有限公司	—	1,593.42	1,593.42
合计	—	4,267.06	4,267.06
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合磐石A	嘉合磐石C	合计
嘉合基金管理有限公司	—	1,094,325.65	1,094,325.65

平安银行股份有限公司	—	4,040.87	4,040.87
合计	—	1,098,366.52	1,098,366.52

注：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按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$

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，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行活期存款	1,069,391.17	19,664.39	11,939,012.55	265,572.49

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）总经理领导下的监察稽核部的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和风险管理委员会的控制和指导。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进入银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	—	19,621,000.00
合计	—	19,621,000.00

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

2、根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

6.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	—	—
AAA以下	—	—
未评级	—	—
合计	—	—

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

2、根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年06 月30日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,069,391.17	—	—	—	—	—	1,069,391.17
结算备付金	337,000.00	—	—	—	—	—	337,000.00
存出保证金	17,676.14	—	—	—	—	—	17,676.14
交易性金融资产	—	—	59,952,000.00	—	—	—	59,952,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	338,789.95	338,789.95
应收申购	—	—	—	—	—	1,000.00	1,000.00

款							
资产总计	1,424,067.31	—	59,952,000.00	—	—	339,789.95	61,715,857.26
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,077.93	2,077.93
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	13,285.51	13,285.51
应付托管费	—	—	—	—	—	2,214.26	2,214.26
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,857.12	2,857.12
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,025.00	1,025.00
其他负债	—	—	—	—	—	242,988.31	242,988.31
负债总计	—	—	—	—	—	264,448.13	264,448.13
利率敏感度缺口	1,424,067.31	—	59,952,000.00	—	—	75,341.82	61,451,409.13
上年度末2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,740,306.90	—	—	—	—	—	1,740,306.90
存出保证金	327.08	—	—	—	—	—	327.08
交易性金融资产	10,000,000.00	29,656,000.00	9,795,000.00	—	—	—	49,451,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	411,925.62	411,925.62
资产总计	11,740,633.98	29,656,000.00	9,795,000.00	—	—	411,925.62	51,603,559.60

负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	974.53	974.53
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	27,516.01	27,516.01
应付托管费	—	—	—	—	—	8,598.76	8,598.76
应付销售服务费	—	—	—	—	—	1,160.12	1,160.12
应付交易费用	—	—	—	—	—	25,734.01	25,734.01
其他负债	—	—	—	—	—	490,000.00	490,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	553,983.43	553,983.43
利率敏感度缺口	11,740,633.98	29,656,000.00	9,795,000.00	—	—	-142,057.81	51,049,576.17

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、仅存在公允价值变动对基金净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	1、市场利率平行上升25个基点	-124,010.7100	-106,822.1100
	2、市场利率平行下降25个基点	124,010.7100	106,822.1100

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券。截至本期期末，本基金主要持有固定收益类资产，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响，因此不存在其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	59,952,000.00	97.56	49,451,000.00	96.87
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	59,952,000.00	97.56	49,451,000.00	96.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感度分析基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2017年06月30日	2016年12月31日
	敏感度分析基准上升5%	—	—
	敏感度分析基准下降5%	—	—
	敏感度分析基准上升5%	—	—

注：本基金根据持仓类别情况选用“上证国债指数*60%+沪深300*40%”作为市场价格波动风险的敏感度分析基准。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	59,952,000.00	97.14
	其中：债券	59,952,000.00	97.14
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,406,391.17	2.28
6	其他资产	357,466.09	0.58
7	合计	61,715,857.26	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代	行业类别	公允价值	占基金资产净值比
---	------	------	----------

码			例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	—	—

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	59,952,000.00	97.56
	其中：政策性金融债	59,952,000.00	97.56
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	59,952,000.00	97.56

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170306	17进出06	600,000	59,952,000.00	97.56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,676.14
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—

4	应收利息	338,789.95
5	应收申购款	1,000.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	357,466.09

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
嘉合磐 石A	57	4,353.87	1,794.26	0.72%	246,376.39	99.28%
嘉合磐 石C	147	380,718.35	54,887,347.91	98.07%	1,078,248.96	1.93%
合计	204	275,557.68	54,889,142.17	97.64%	1,324,625.35	2.36%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	嘉合磐石A	6,095.54	2.46%
	嘉合磐石C	29,763.53	0.05%
	合计	35,859.07	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉合磐石A	0~10
	嘉合磐石C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉合磐石A	0
	嘉合磐石C	0~10
	合计	0~10

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间,持有本基金C份额总量在0~10万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理持有本基金C份额总量在0~10万份(含)之间。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合磐石A	嘉合磐石C
基金合同生效日(2015年07月03日)基金份额总额	2,376,035,633.97	4,529,090.92
本报告期期初基金份额总额	45,410,001.01	976,267.54
本报告期基金总申购份额	86,437.46	55,376,084.31
减：本报告期基金总赎回份额	45,248,267.82	386,754.98
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	248,170.65	55,965,596.87

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金于2017年2月9日召开基金份额持有人大会，会议通过了《关于嘉合磐石混合型证券投资基金降低基金管理费率和托管费率的有关事项的议案》，自该日起本基金管理费由0.8%年费率下降至0.6%年费率，托管费由0.25%年费率下降至0.10%年费率。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

1、基金管理人于2017年6月10日发布了《嘉合基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（副总经理）变更的公告》，新任蔡奕先生为公司副总经理。上述变更事项经公司第一届董事会第二十八次会议审议通过，并按照规定备案。

2、基金管理人于2017年6月22日发布了《嘉合基金管理有限公司关于总经理离任及副总经理代行总经理职务的公告》，总经理徐岱先生离任，由蔡奕先生代行总经理职务。上述变更事项经公司第一届董事会第三十次会议审议通过，并按照规定备案。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
长城证券	2	—	—	—	—	
国元证券	2	—	—	—	—	
中信建投	2	—	—	—	—	
中信证券	2	—	—	—	—	
中泰证券	2	—	—	—	—	

注：1、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

2、本基金本报告期内新增中泰证券为其券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
长城证券	1,614,233.9	100%	147,400,000	100%	—	—
国元证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	嘉合基金管理有限公司旗下基金2016年年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-03
2	嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合磐石混合型证券	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、	2017-01-09

	投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券日报》、基金管理人网站	
3	嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合磐石混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-10
4	嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合磐石混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-11
5	嘉合基金关于调整旗下开放式基金在盈米财富的最低持有份额的数额限制的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-13
6	嘉合磐石混合型证券投资基金2016年第4季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-19
7	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加金百临为销售机构并开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-20
8	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险销售、奕丰金融为销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-01-24
9	关于嘉合磐石混合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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-02-10
10	嘉合磐石混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2017年第1号)	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-02-11

11	嘉合磐石混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2017年第1号)	基金管理人网站	2017-02-11
12	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加伯嘉基金为销售机构并开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-03-01
13	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加金斧子、鑫鼎盛为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-03-03
14	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加海通证券为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-03-10
15	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加麟龙投顾为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-03-15
16	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加凯石财富、中正达广为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-03-24
17	嘉合磐石混合型证券投资基金2016年年度报告	基金管理人网站	2017-03-29
18	嘉合磐石混合型证券投资基金2016年年度报告摘要	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-03-29
19	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加盈信基金、苏宁基金为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-04-21
20	嘉合磐石混合型证券投资基金	《上海证券报》、《中国	2017-04-24

	2017年第1季度报告	证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	
21	嘉合基金管理有限公司关于参加伯嘉基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-04-26
22	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加成都万华源、植信基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-05-10
23	嘉合基金关于调整旗下开放式基金在盈米财富的申购金额下限的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-05-13
24	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加开源证券、众禄基金为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-05-17
25	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加肯特瑞财富为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-05-19
26	嘉合基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-06-06
27	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加中期资管为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-06-06
28	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券、凤凰金信为销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、基金管理人网站	2017-06-09

		人网站	
29	嘉合基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（副总经理）变更的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2017-06-10
30	嘉合基金管理有限公司关于旗下基金增加中证金牛为销售机构并开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2016-06-13
31	嘉合基金管理有限公司关于总经理离任及副总经理代行总经理职务的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-04-01至2017-06-19	45125451.26	0.00	45125451.26	0.00	—
机构	2	2017-06-20至2017-06-27	0.00	9140767.82	0.00	9140767.82	16.26%
机构	3	2017-06-27至2017-06-30	0.00	22872827.08	0.00	22872827.08	40.69%
机构	4	2017-06-28至2017-06-30	0.00	22872827.08	0.00	22872827.08	40.69%

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于2017年2月9日召开基金份额持有人大会，会议通过了《关于嘉合磐石混合型证券投资基金降低基金管理费率和托管费率的有关事项的议案》，自该日起本基金管理费由0.8%年费率下降至0.6%年费率，托管费由0.25%年费率下降至0.10%年费率。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予嘉合磐石混合型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合磐石混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合磐石混合型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站(www.haoamc.com)进行查阅。

嘉合基金管理有限公司
二〇一七年八月二十六日