

# 嘉实 1 个月理财债券型证券投资基金更新招募说明书

## 摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

### 重要提示

嘉实 1 个月理财债券型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会 2013 年 12 月 13 日证监许可[2013]1589 号文核准募集。本基金基金合同于 2013 年 12 月 24 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 24 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（未经审计）。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人基本情况

##### 1、基本信息

名称 嘉实基金管理有限公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元

办公地址 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人 邓红国

总经理 赵学军

成立日期 1999 年 3 月 25 日

注册资本 1.5 亿元

股权结构 中诚信托有限责任公司 40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%，立信投资有限责任公司 30%。

存续期间 持续经营

电话 （010）65215588

传真 （010）65185678

联系人 胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士，中共党员，1983年3月至1992年2月任物资部研究室、政策体制法规司副处长，1992年3月至2003年4月任中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员，2003年5月至2010年3月任中国银监会银行监管三部副主任、四部主任，2010年4月至2014年10月任中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人，2014年12月2日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士，董事，硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。2010年11月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。2016年8月至今任中诚宝捷思货币经纪有限公司董事长。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问，JPMorgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JPMorgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团中国商法丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫

局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

张文玥女士，硕士，具有基金从业资格，9年证券从业经历。曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014年4月加入嘉实基金管理有限公司。2015年7月14日至今任嘉实快线货币基金经理，2016年1月28日至今任嘉实宝、嘉实货币基金经理，2016年12月22日至今任嘉实现金宝货币基金经理，2017年3月23日至今任嘉实定期宝6个月理财债券基金经理。2014年8月13日至今担任嘉实理财宝7天债券、嘉实3个月理财债券、嘉实安心货币及本基金基金经理。

李金灿先生，硕士研究生，具有基金从业资格，7年证券从业经历。曾任 FutexTradingLtd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司担任债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。2015年6月9日至今任嘉实超短债债券和嘉实宝基金经理，2016年1月28日至今任嘉实薪金宝货币基金经理，2016年2月5日至今任嘉实机构快线货币基金经理，2016年7月23日至今任嘉实安心货币和嘉实理财宝7天债券基金经理，2016年12月27日任嘉实增益宝货币基金经理，2017年5月25日任嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券及嘉实现金添利货币基金经理。2017年5月24日至今任本基金基金经理。

### (2) 历任基金经理

魏莉女士，2013年12月14日至2017年5月24日任本基金基金经理。

## 3、投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼股票投资业务联席 CIO 邵健先生，公司总经理赵学军先生，股票投资业务联席 CIO 兼研究总监陈少平女士，助理 CIO 兼股票投资部总监邵秋涛先生，人工智能投资部负责人张自力先生，资深基金经理邹唯先生、胡涛先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称中国银行）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客

户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2017 年 03 月 31 日，中国银行已托管 576 只证券投资基金，其中境内基金 541 只，QDII 基金 35 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址 北京市东城区建国门南大街 7 号北京万豪中心 D 座 12 层

电话 （010）65215588 传真 （010）65215577

联系人 赵佳

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元

电话 （021）38789658 传真 （021）68880023

联系人 邵琦

##### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址 成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元

电话 （028）86202100 传真 （028）86202100

联系人 王启明

##### （4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址 深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层

电话 （0755）84362200 传真 （0755）25870663

联系人 陈寒梦

##### （5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址 青岛市市南区山东路 6 号华润大厦 3101 室

电话 （0532）66777997 传真 （0532）66777676

联系人 胡洪峰

##### （6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址 杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城 2 幢 1001A 室

电话 （0571）88061392 传真 （0571）88021391

联系人 王振

##### （7）嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址 福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元  
电话 (0591) 88013673 传真 (0591) 88013670  
联系人 吴志锋

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司  
办公地址 南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室  
电话 (025) 66671118 传真 (025) 66671100  
联系人 徐莉莉

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司  
办公地址 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元  
电话 (020) 88832125 传真 (020) 81552120  
联系人 周炜

## 2、代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司  
住所、办公地址 北京市东城区建国门内大街 69 号  
法定代表人 周慕冰  
电话 (010)85108227 传真 (010)85109219  
网址 [www.abchina.com](http://www.abchina.com) 客服电话 95599

(2) 中国银行股份有限公司  
办公地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼  
注册地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号  
法定代表人 田国立  
电话 (010) 66596688 传真 (010) 66594946  
网址 [www.boc.cn](http://www.boc.cn) 客服电话 95566

(3) 中国建设银行股份有限公司  
住所 北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心  
法定代表人 王洪章  
网址 [www.ccb.com](http://www.ccb.com) 客服电话 95533

(4) 兴业银行股份有限公司  
住所 福州市湖东路 154  
办公地址 上海市江宁路 168  
法定代表人 高建平 联系人 卞晔煜  
电话 (021) 52629999 传真 (021) 62569070  
网址 [www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn) 客服电话 95561

(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司  
办公地址 北京市西城区金融大街 3 号  
注册地址 北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人 李国华 联系人 王硕

传真 (010) 68858117

网址 [www.psbc.com](http://www.psbc.com) 客服电话 95580

(6) 上海银行股份有限公司

住所、办公地址 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人 金煜 联系人 汤征程

电话 021-68475888 传真 021-68476111

网址 [www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com) 客服电话 95594

(7) 上海农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址 上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20、22-27 层

法定代表人 冀光恒 联系人 施传荣

电话 021-38523692 传真 021-50105124

网址 [www.srcb.com](http://www.srcb.com) 客服电话 (021)962999

(8) 北京农村商业银行股份有限公司

办公地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦

注册地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦

法定代表人 王金山 联系人 王薇娜

电话 (010)85605006 传真 (010)85605345

网址 [www.bjrcb.com](http://www.bjrcb.com) 客服电话 96198

(9) 青岛银行股份有限公司

住所、办公地址 青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

法定代表人 郭少泉 联系人 叶旻

电话 0532-68602127 传真 0532-68629939

网址 [www.qdccb.com](http://www.qdccb.com) 客服电话 96588(青岛)、4006696588(全国)

(10) 江苏银行股份有限公司

住所、办公地址 南京市中华路 26 号江苏银行总部大厦

法定代表人 夏平 联系人 张洪玮

电话 (025)58587036 传真 (025)58587820

网址 [www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn) 客服电话 95319

(11) 深圳农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦

法定代表人 李光安 联系人 常志勇

电话 0755-25188781 传真 0755-25188785

网址 [www.4001961200.com](http://www.4001961200.com) 客服电话 961200(深圳)

(12) 乌鲁木齐商业银行股份有限公司

住所 乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址 乌鲁木齐市新华北路 8 号商业银行大厦

法定代表人 农惠臣 联系人 何佳  
电话 (0991)8824667 传真 (0991)8824667  
网址 [www.uccb.com.cn](http://www.uccb.com.cn) 客服电话 (0991)96518

(13) 烟台银行股份有限公司  
住所、办公地址 山东省烟台市芝罘区海港路 25 号  
法定代表人 叶文君 联系人 王淑华  
电话 0535-6699660 传真 0535-6699884  
网址 [www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net) 客服电话 4008-311-777

(14) 江苏江南农村商业银行股份有限公司  
办公地址 常州市和平中路 413 号  
注册地址 常州市和平中路 413 号  
法定代表人 陆向阳 联系人 包静  
电话 13951229068 传真 0519-89995170  
网址 [www.jnbank.com.cn](http://www.jnbank.com.cn) 客服电话 96005

(15) 包商银行股份有限公司  
住所、办公地址 内蒙古包头市钢铁大街 6 号  
法定代表人 李镇西 联系人 张建鑫  
电话 010-64816038 传真 010-84596546  
网址 <http://www.bsb.com.cn> 客服电话 95352

(16) 广州农村商业银行股份有限公司  
办公地址 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号  
注册地址 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号  
法定代表人 王继康 联系人 戴一挥  
电话 020-22389188 传真 020-22389031  
网址 [www.grcbank.com](http://www.grcbank.com) 客服电话 020-961111

(17) 成都农村商业银行股份有限公司  
办公地址 四川省成都市武侯区科华中路 88 号  
注册地址 四川省成都市武侯区科华中路 88 号  
法定代表人 陈萍 联系人 杨琪  
电话 028-85315412 传真 028-85190961  
网址 <http://www.cdrcb.com/> 客服电话 95392

(18) 苏州银行股份有限公司  
办公地址 江苏省苏州市钟园路 728 号  
注册地址 江苏省苏州市东吴北路 143 号  
法定代表人 王兰凤 联系人 熊志强  
电话 0512-69868390 传真 0512-69868370  
网址 [www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com) 客服电话 0512-96067

(19) 福建海峡银行股份有限公司

办公地址 福建省福州市国货西路 188 号  
注册地址 福建省福州市六一北路 158 号  
法定代表人 郭运濂 联系人 吴白玫  
电话 0591-87838759 传真 0591-87388016  
网址 [www.fjhxbank.com](http://www.fjhxbank.com) 客服电话 4008939999

(20) 泉州银行股份有限公司

办公地址 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号  
注册地址 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号  
法定代表人 傅子能 联系人 董培姗、王燕玲  
电话 0595-22551071 传真 0595-22578871  
网址 <http://www.qzccb.com> 客服电话 4008896312

(21) 上海天天基金销售有限责任公司

办公地址 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼  
注册地址 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层  
法定代表人 其实 联系人 潘世友  
电话 021-54509998 传真 021-64385308  
网址 <http://www.1234567.com.cn/> 客服电话 95021

(22) 上海好买基金销售有限公司

办公地址 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室  
注册地址 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号  
法定代表人 杨文斌 联系人 张茹  
电话 021-20613999 传真 021-68596916  
网址 [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com) 客服电话 4007009665

(23) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼  
注册地址 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室  
法定代表人 凌顺平 联系人 林海明  
传真 0571-86800423  
网址 [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com) 客服电话 4008-773-772

(24) 上海利得基金销售有限公司

办公地址 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼  
注册地址 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室  
法定代表人 李兴春 联系人 曹怡晨  
电话 021-50583533 传真 021-50583633  
网址 [www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn) 客服电话 400-921-7755

(25) 嘉实财富管理有限公司

住所 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元



办公地址 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人 赵学军 联系人 景琪

电话 021-20289890 传真 021-20280110

网址 [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn) 客服电话 400-021-8850

(26) 上海大智慧财富管理有限公司

办公地址 上海市杨高南路 428 号 1 号楼 11 楼

注册地址 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人 申健 联系人 宋楠

电话 021-20219988-37492 传真 021-20219988

网址 <http://8.gw.com.cn> 客服电话 021-20292031

(27) 上海基煜基金销售有限公司

办公地址 上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

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(上海泰和经济功能区)

法定代表人 王翔 联系人 蓝杰

电话 021-65370077 传真 021-55085991

网址 [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn) 客服电话 4008-205-369

(28) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

注册地址 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人 郭坚 联系人 宁博宇

电话 021-20665952 传真 021-22066653

网址 [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com) 客服电话 4008219031

(29) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人 薛峰 联系人 刘晨、李芳芳

电话 (021) 22169999 传真 (021) 22169134

网址 [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com) 客服电话 4008888788、10108998

(30) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

注册地址 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人 陈柏青 联系人 韩爱彬

电话 021-60897840 传真 0571-26697013

网址 <http://www.fund123.cn/> 客服电话 4000-766-123

(31) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

注册地址 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人 江卉 联系人 江卉

电话 4000988511 传真 010-89188000  
网址 fund.jd.com 客服电话 400-088-8816

(32) 北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区望京 SOHO  
注册地址 北京市朝阳区望京 SOHO  
法定代表人 钟斐斐 联系人 袁永姣  
电话 010-61840688 传真 010-61840699  
网址 <https://danjuanapp.com/> 客服电话 4000-618-518

(二) 注册登记机构

名称 嘉实基金管理有限公司  
住所 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元  
办公地址 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层  
法定代表人 邓红国  
联系人 彭鑫  
电话 (010) 6521558  
传真 (010) 65185678

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称 上海市源泰律师事务所  
住所、办公地址 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼  
负责人 廖海 联系人 刘佳  
电话 (021) 51150298-855 传真 (021) 51150398  
经办律师 刘佳、廖海

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼  
办公地址 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼  
法定代表人 李丹 联系人 张勇  
电话 (021) 23238888 传真 (021) 23238800  
经办注册会计师 单峰、张勇

四、基金的名称

本基金名称：嘉实 1 个月理财债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金，契约型开放式，以定期开放方式运作。

六、基金的投资目标

在力求本金安全的基础上，追求稳定收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的固定收益类工具，具体包括现金，协议存款、通知存款、银行定期存款、大额存单，债券回购，短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、央行票据、金

融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、中期票据等债券，资产支持证券，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，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金不投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。

本基金将采用买入并持有策略，主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余运作期的固定收益类工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

## 八、基金的投资策略

在运作期内，本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要，在运作期之间的短暂开放期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。

本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具，如：银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等）等。在运作期，根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，主要采取持有到期的投资策略。

### 1、资产配置策略

每个运作期初，本基金首先对回购利率与短债收益率、存款利率进行比较，并在对运作期资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类货币市场工具在运作期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类货币市场工具的市场容量，确定配置比例。

### 2、银行定期存款及大额存单投资策略

运作期初，本基金在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的几家银行进行存款投资，注重分散投资，降低交易对手风险。

### 3、债券回购投资策略

首先，基于对运作期内资金面走势的判断，确定回购期限的选择。在组合进行杠杆操作时，若判断资金面趋于宽松，则在运作初期进行短期限正回购操作；反之，则进行长期限正回购操作，锁定融资成本。若期初资产配置有逆回购比例，则在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行长期限逆回购配置；反之，则进行短期限逆回购操作。其次，本基金在运作期内，根据资金头寸，安排相应期限的回购操作。

### 4、短期信用债券投资策略

在运作期，基金管理人根据剩余期限、信用评级进行筛选，形成本基金的债券库；根据各短期信用债的到期收益率、剩余期限与运作期的匹配程度，挑选适当的短期债券进行配置，并持有到期。

### 5、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。

中小企业私募债收益率由基准收益率与信用利差叠加组成，信用风险表现在信用利差的变化上；信用利差主要受两方面影响，一是系统性信用风险，即该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线变化；二是非系统性信用风险，即该信用债本身的信用变化。

针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。针对非系统性信用风险，本基金通过嘉实信用分析系统，分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。针对流动性风险，本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债投资，主要采取分散投资，控制个债持有比例；采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取尽早出售（firstsale,bestsale）策略，控制投资风险。

### 6、投资决策

#### (1) 决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
- 2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；
- 3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

#### (2) 决策程序

- 1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
- 2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。
- 3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。
- 4) 交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。
- 5) 监察稽核部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

#### 九、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

#### 十、基金的投资组合报告

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 18 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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日（报告期末），本报告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 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

2 买入返售金融资产 800,001,120.00 39.93

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

3 银行存款和结算备付金合计 1,200,883,629.38 59.93

4 其他资产 2,845,568.84 0.14

5 合计 2,003,730,318.22 100.00

##### 2. 报告期债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

##### 3. 基金投资组合平均剩余期限

###### (1) 投资组合平均剩余期限基本情况

项目 天数

报告期末投资组合平均剩余期限 21

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 30

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 2

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 120 天。

(2) 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号 平均剩余期限 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) 各期限负债占基金资产净值的比例 (%)

1 30 天以内 100.00 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

2 30 天(含)-60 天 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

3 60 天(含)-90 天 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

4 90 天(含)-120 天 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

5 120 天(含)-397 天(含) --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

合计 100.00 -

4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

6.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 0

报告期内偏离度的最高值 -

报告期内偏离度的最低值 -

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 -

8.报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

9.报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

10.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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

11.投资组合报告附注

(1) 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

(2) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,845,568.84
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,845,568.84

## 十一、基金的业绩

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。

### 1.本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 嘉实1个月理财债券A

阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
2013年12月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日	-----	-----	-----	-----
2014年	-----	-----	-----	-----
2015年	-----	-----	-----	-----
2016年	0.1251%	0.0041%	-----	-----
2017年1月1日至2017年3月31日	0.3980%	0.0052%	-----	-----

#### 嘉实1个月理财债券E

阶段	份额净值收益率	份额净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
2013年12月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日	0.1790%	0.0000%	-----	-----
2014年	0.4669%	0.0053%	-----	-----
2015年	-----	-----	-----	-----
2016年	0.1313%	0.0044%	-----	-----
2017年1月1日至2017年3月31日	0.4186%	0.0052%	-----	-----

注：（1）2013年数据仅统计本基金第一个运作期（2013年12月24日至2014年1月22日），在2013年度的实际有效运作期间（2013年12月24日至2013年12月31日）。其中，嘉实1个月理财债券A份额未运作；（2）2014年数据仅统计本基金第一个运作期（2013年12月24日至2014年1月22日），在2014年度的实际有效运作期间（2014年1月1日至2014年1月22日）。其中，嘉实1个月理财债券A份额未运作；（3）2015年全年嘉实1个月理财债券未运作；（4）2016年数据仅统计本基金第二个运作期（2016年12月22日至2017年1月22日），在2016年度的实际有效运作期间（2016年12月22日至2016年12月31日）；（5）2017年数据仅统计本基金第二个运作期（2016年12月22日至2017年1月22日）及本基金第三个运作期（2017年3月22日至2017年4月21日）中的2017年1月1日至2017年3月31日。

### 2.自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图 1: 嘉实 1 个月理财债券 A 基金累计净值收益率的历史走势对比图  
(2016 年 12 月 21 日至 2017 年 3 月 31 日)

图 2: 嘉实 1 个月理财债券 E 基金累计净值收益率的历史走势对比图  
(2013 年 12 月 24 日至 2017 年 3 月 31 日)

注: 按基金合同和招募说明书的约定, 本基金自每个运作期开始后的 10 个工作日内为建仓期, 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)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

## 十二、基金的费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1. 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) 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、仲裁费和诉讼费;
- (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) 基金的开户费用、账户维护费用;
- (10) 基金的注册登记费用;
- (11) 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。

#### 2. 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

本基金的管理费采用浮动费率方式收取, 具体规则如下:

- 1) 本基金不收取固定管理费, 以分档计提方式收取浮动管理费;
  - 2) 本基金 A 类、E 类基金份额年化管理费率上限为 0.30%;
  - 3) 当期运作期期满时, 基金管理人以各类基金份额的运作期年化收益率为基础分别分三档收取管理费;
- 各类基金份额的具体档数、不同档数运作期年化收益率起止点、不同档数管理费率, 具体如下:

档数 A 类或 E 类基金份额运作期年化收益率 RA/E 管理费率

第一档  $RA/E \leq 3\%$  0

第二档  $3\% < RA/E \leq 8\%$  0.20%

第三档  $RA/E > 8\%$  0.30%

对于每一类别基金份额, 在分档模式下, 基金管理人将运作期年化收益率由低到高分档并设定不同等级的管理费率; 运作期年化收益率越大的档, 管理费率越高; 管理费的提取将保证按高档数的管理费计提后计算的运作期实际年化收益率不低于按低档数的管理费计提后计算的运作期实际年化收益率。为保证上述安排, 当运作期年化收益率落在第二档, 且  $3\% < RA/E \leq 3.20\%$  时, 管理费率按  $RA/E - 3\%$  执行(实际执行管理费率  $\leq$  该档位约定管理费率 0.20%); 当运作期年化收益率落在第三档, 且  $8\% < RA/E \leq 8.10\%$  时, 管理费率按  $RA/E - 8.10\% + 0.30\%$  执行(实际执行管理费率  $\leq$  该档位约定管理费率 0.30%)。

各类基金份额的运作期年化收益率、运作期实际年化收益率的计算方式详见本基金合同第十八部分的约定。

基金管理费以每个运作期最后一日各类基金份额的基金资产净值为基数, 按相应类别基金份额运作期年化

收益率对应档数的管理费在运作期最后一日分别计提，当期运作期各类基金份额的管理费计算方法如下：

$HA/E = EA/EFA/E$  当期运作期合计日历日天数 365

HA/E 为 A 类基金份额或 E 类基金份额当期运作期应计提的管理费

EA/E 为当期运作期最后一日 A 类基金份额的基金资产净值或 E 类基金份额的基金资产净值

FA/E 为 A 类基金份额或 E 类基金份额根据基金合同约定适用的当期运作期管理费费率

管理费计提后由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于运作期最后一个工作日后的 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、公休日等，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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.05\% \times \text{当年天数}$

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付给基金托管人。

#### （3）基金销售服务费

本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的该类别基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。

上述一、基金费用的种类中第 4—11 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。

#### （二）与基金销售有关的费用

本基金不收取申购费用和赎回费用。

#### （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。

### 十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1. 在重要提示部分：增加了本基金合同生效日，明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。



- 2.在三、基金管理人部分：更新了基金管理人的相关信息。
- 3.在四、基金托管人部分：更新了基金托管人的相关信息。
- 4.在五、相关服务机构部分：更新了相关代销机构信息。
- 5.在六、基金的募集部分：增加了募集期限。
- 6.在七、基金合同的生效部分：增加了基金合同生效日。
- 7.在八、基金份额的申购、赎回部分：更新了申购赎回的相关内容。
- 8.在九、基金的投资部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
- 9.增加十、基金的业绩：基金业绩更新至 2017 年第一季度末。
- 10.在二十二、其他应披露事项部分：列示了本基金自 2013 年 12 月 18 日首次披露本基金招募说明书至 2017 年 6 月 24 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 5 日