

嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第1号)

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示
嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2016年11月30日证监许可【2016】2922号《关于准予嘉实稳熙纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金基金合同于2017年3月16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,投资者申购本基金前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承认基金合同的真实和接受,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。

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。
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2019年3月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日(未经审计),特别事项注明除外。

一、基金管理人

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	北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人	魏星
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中国诚通控股有限责任公司40%、德意志资产管理(亚洲)有限公司30%、立信投资有限公司30%
存续期间	持续经营
电话	(010) 66215688
传真	(010) 66186678
联系人	胡碧秋

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]6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、北京、长春、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金资产管理人、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
牛成立先生,联席董事长,经济学硕士,中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副司长,处长;中国银行厦门分行党委委员、副行长(挂职);中国银行银行监督管理委员会(下称银监会)非银行金融机构监管部处长;银监会新疆监管局党委书记、副局长;银监会银行监管四部副主任;银监会黑龙江监管局党委书记、局长;银监会融资产部业务二工作部(融资性担保业务监管部联席办公室)主任;中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长,兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事长。

赵学军先生,董事长,党委书记,经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所,外贸部中国仪器进出口总公司,北京商品交易所,天津纺织原料交易所,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2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理,2017年12月卸任公司董事长。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任证监会财富部资金运用处主任科员,都都证券有限责任公司研究部高级经理;中欧基金管理有限公司董事兼发展策略部,现任中诚信托有限责任公司副总经理兼资产管理部高级经理,兼任中国诚通资产管理有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、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市场部副总裁。自1996年加入德意志银行后,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)有限公司中国区总经理,2017年11月至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家荣先生,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月任海南证券投资有限公司副总经理;1994年至今,任北京德恒律师事务所主任,2001年11月至今,任立信投资有限公司董事长。

经雷先生,董事、总经理,金融学、会计学专业本科学历,工商管理学士学位,特许金融分析师(CFA)。1998年至2008年在国际集团(AIG)国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年至2013年历任友邦保险中国区资产管理部副总裁,首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司,历任董事总经理(MD)、机构投资和固定收益业务首席投资官;2018年3月起任公司副总经理。

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硕士。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,美国花旗银行分析师,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。

刘欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授,清华大学法学院研究中心副主任,《清华法学》主编,汤姆森路透集团“中国法律”编辑组咨询委员会委员。曾兼任中国证券投资基金业协会第一届、二届并购重组审核委员会成员,现兼任上海证券交易所上市公司委员会、中国上市公司协会独立董事委员会前任主任。

王瑞华先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,注册会计师,中共党员。曾任中央财经大学会计学院教授主任、研究生中心主任,2012年12月起担任中央财经大学商学院院长MBA教育中心主任。

张树忠先生,监事长,经济学博士,高级经济师,中共党员。曾任华夏证券证券投资银行部总经理,研究发展部总经理,光大证券公司总助理,北方证券总经理,资产管理部总监;光大保德信资产管理公司董事、副总经理;大通证券股份有限公司副总经理、总经理、大成基金管理有限公司董事长、中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官;中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁,兼任中诚信实管理(北京)有限公司董事长。

鞠群先生,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总监。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

袁庚先生,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,历任人力资源部副经理、副总监、总监。
曾宪广先生,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,为国信证券集团(北京)事务所证券事务部。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。

宋振娟女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外管理部任副处长,1998年7月至1999年3月任中诚基金管理有限公司助理,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。

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。

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,北京市普智律师事务所,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。

办公地址	北京市东城区建国门内大街7号北京东方广场C座11层
电话	(010) 66215688 传真 (010) 66215677
联系人	赵佳
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) 36799658 传真 (021) 68909023
联系人	邵琦
办公地址	成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座22楼521单元04-06单元
电话	(028) 186202100 传真 (028) 186202100
联系人	王昭明
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
办公地址	青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室
电话	(0532) 66779797 传真 (0532) 66777676
联系人	胡碧秋
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单元
电话	(0571) 88061392 传真 (0571) 88021291
联系人	王薇
办公地址	福州市鼓楼区五四路137号信和广场6楼01A单元
电话	(0591) 88013670 传真 (0591) 88013670
联系人	吴志辉
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) 66671016
联系人	徐莉娟
办公地址	广州市天河区珠江东路6号广州国际金融中心50层06-06A单元
电话	(020) 188832125 传真 (020) 81562120
联系人	陆锋

2. 代销机构
(一) 登记机构
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:北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人:魏星
联系人:彭鑫
电话:(010) 66215688
传真:(010) 66186678
(二) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海嘉泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51169298-826
经办律师:廖海、刘凯

(二) 登记机构
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:北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人:魏星
联系人:彭鑫
电话:(010) 66215688
传真:(010) 66186678
(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海嘉泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51169298-826
经办律师:廖海、刘凯

(二) 基金托管人
(一) 基金托管人情况
1. 基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
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
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制银行,总部设在北京。本行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.66亿元,增幅6.08%。
2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”、美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、“《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最佳社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位;在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场部、证券保险资产管理处、理财信托股权市场部、OTF托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部先后增设多个会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常态化的内控工作手段。

2. 主要人员情况
纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。具有十八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚鑫,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行计财部,长期从事托管业务运营管理工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3. 基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行各项职责和各项义务,切实落实持有人利益保护原则,为资产委托人提供持续高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QDII、RODII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管687只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获评“全球托管人”“中国最佳托管银行”4次获得《财资》“中国最佳托管银行”、连续5年获得中债登“优秀托管银行”等奖项,并在2016年获评《环球金融》评为“中国市场唯一一家”最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管银行实践奖”。

(二) 基金托管人的内部控制制度
1. 内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行有关管理规定,守法合规、规范运作,严格监,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
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险内控工作进行指导和监督。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。
3. 内部控制制度及措施
资产托管业务部具备系统、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,业务管理严格实行复核、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,账户密码严格管理,履约操作严格管理;业务授权严格实行双人管理,实施前置影像控制;业务信息通过系统直接录入,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
1. 监督流程
依照《基金法》及其他法律法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”,严格按照相关法律法规及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令,基金管理人对各基金业务的提取与支付情况进行检查监督。
2. 监督流程
(1) 每日工作日日终通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常情况及时向中国证监会报告。
(2) 收到基金管理人的划款指令后,对指令要素内容进行核查。
(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。
三、相关服务情况

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国光大银行股份有限公司	办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心 法定代表人:李海鹏 联系人:朱虹 电话:(010) 63691615 传真:(010) 63697028 客服电话:95506 网址: http://www.cebank.com

(二) 登记机构
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:北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人:魏星
联系人:彭鑫
电话:(010) 66215688
传真:(010) 66186678
(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海嘉泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51169298-826
经办律师:廖海、刘凯

(二) 基金托管人
(一) 基金托管人情况
1. 基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
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
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制银行,总部设在北京。本行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.66亿元,增幅6.08%。
2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”、美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、“《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最佳社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位;在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场部、证券保险资产管理处、理财信托股权市场部、OTF托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部先后增设多个会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常态化的内控工作手段。

2. 主要人员情况
纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。具有十八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚鑫,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行计财部,长期从事托管业务运营管理工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3. 基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行各项职责和各项义务,切实落实持有人利益保护原则,为资产委托人提供持续高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QDII、RODII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管687只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获评“全球托管人”“中国最佳托管银行”4次获得《财资》“中国最佳托管银行”、连续5年获得中债登“优秀托管银行”等奖项,并在2016年获评《环球金融》评为“中国市场唯一一家”最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管银行实践奖”。

(二) 基金托管人的内部控制制度
1. 内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行有关管理规定,守法合规、规范运作,严格监,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
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险内控工作进行指导和监督。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。
3. 内部控制制度及措施
资产托管业务部具备系统、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,业务管理严格实行复核、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,账户密码严格管理,履约操作严格管理;业务授权严格实行双人管理,实施前置影像控制;业务信息通过系统直接录入,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
1. 监督流程
依照《基金法》及其他法律法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”,严格按照相关法律法规及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令,基金管理人对各基金业务的提取与支付情况进行检查监督。
2. 监督流程
(1) 每日工作日日终通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常情况及时向中国证监会报告。
(2) 收到基金管理人的划款指令后,对指令要素内容进行核查。
(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。
三、相关服务情况

2. 代销机构
(一) 登记机构
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:北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人:魏星
联系人:彭鑫
电话:(010) 66215688
传真:(010) 66186678
(二) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海嘉泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51169298-826
经办律师:廖海、刘凯

(二) 基金托管人
(一) 基金托管人情况
1. 基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
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
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制银行,总部设在北京。本行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.66亿元,增幅6.08%。
2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”、美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、“《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最佳社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位;在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场部、证券保险资产管理处、理财信托股权市场部、OTF托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部先后增设多个会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常态化的内控工作手段。

2. 主要人员情况
纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。具有十八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚鑫,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行计财部,长期从事托管业务运营管理工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3. 基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行各项职责和各项义务,切实落实持有人利益保护原则,为资产委托人提供持续高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QDII、RODII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管687只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获评“全球托管人”“中国最佳托管银行”4次获得《财资》“中国最佳托管银行”、连续5年获得中债登“优秀托管银行”等奖项,并在2016年获评《环球金融》评为“中国市场唯一一家”最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管银行实践奖”。

(二) 基金托管人的内部控制制度
1. 内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行有关管理规定,守法合规、规范运作,严格监,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
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险内控工作进行指导和监督。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。
3. 内部控制制度及措施
资产托管业务部具备系统、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,业务管理严格实行复核、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,账户密码严格管理,履约操作严格管理;业务授权严格实行双人管理,实施前置影像控制;业务信息通过系统直接录入,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
1. 监督流程
依照《基金法》及其他法律法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”,严格按照相关法律法规及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令,基金管理人对各基金业务的提取与支付情况进行检查监督。
2. 监督流程
(1) 每日工作日日终通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常情况及时向中国证监会报告。
(2) 收到基金管理人的划款指令后,对指令要素内容进行核查。
(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。
三、相关服务情况

2. 代销机构
(一) 登记机构
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:北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人:魏星
联系人:彭鑫
电话:(010) 66215688
传真:(010) 66186678
(二) 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海嘉泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021) 51169298-826
经办律师:廖海、刘凯

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
2	其中:股票	--	--
3	固定收益投资	4,776,704,000.00	96.96
4	其中:债券	4,727,905,000.00	95.88
5	资产支持证券	48,799,000.00	0.99
6	贵金属投资	--	--
7	金融衍生品投资	--	--
8	买入返售金融资产	--	--
9	其中:买断式回购	--	--
10	其他	76,651,722.99	1.53
11	其他资产	78,964,439.67	1.60
12	合计	4,931,320,162.66	100.00

1. 利率策略
本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,积极主动的预测未来的利率趋势。组合久期是反映利率风险最重要的指标,本基金管理人将根据相关因素的研究判断组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,以减小债券价格下降带来的风险。
2. 信用债券投资策略
本基金通过承担适度的信用风险来获取信用溢价,主要关注个别债券的选择和行业配置两方面。在定性定量分析结合的基础上,通过自下而上的策略,在信用类固定收益类工具中进行个债的精选,通过适度分散的行业配置策略,构建优化组合。
3. 可转债投资策略
通过买入“嘉实信用分析系统”的信用评级和信用分析,包括宏观信用环境分析、行业趋势分析、管理层素质与对公司治理分析、运营与财务状况分析、债务契约分析、特殊事项风险分析等,依靠嘉实信用分析团队及嘉实宏观研究平台的其他资源,深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展态势等情况,严格遵守嘉实信用分析流程,执行嘉实信用投资策略。
4. 资产支持证券投资策略
1) 个债筛选选择
首先,本基金依据“嘉实信用分析系统”的研究成果,执行“嘉实投资备选池流程”,生成或更新买入信用债券备选库,强化投资纪律,保护组合质量。
其次,本基金主要以信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类属、信用评级、收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)、剩余额、久期、流动性、波动性(发行总量、流通量、上市时间)等指标,结合组合管理层面要求,决定是否将个债纳入组合及其投资数量。
再有,因信用改善而支持本基金投资的个债信用指标可以包括但不限于:更稳定或增强的现金流、通过自由现金流增长去杠杆的财务能力、资产估值提升予以支持债券、更强的公司管理、更稳定或更高的市场占有率、更易于获得资金等;个债因信用恶化而支持本基金投资的个债可以包括但不限于:发债企业出现坏于分析师预期的情况、发债企业没有去杠杆的能力、发债企业覆盖债务的资产减少、发债企业市场声誉地位恶化、发债企业获得债务的用途减少、发债企业发生管理层的重大变化、个债已达到本基金对其设定的目标价格,本基金对该个债评估的价格上行空间有限等。
2) 行业配置
宏观信用环境变化,影响同一发债人的违约概率,影响不同发债人间的违约相关性,影响既定信用等级发债人在信用周期不同阶段的违约损失率,影响不同信用等级发债人的违约概率。同时,不同行业对宏观经济的相关性差异显著,不同行业的潜在违约率差异显著。本基金借助“嘉实信用分析系统”和嘉实宏观研究平台,基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面对研究,运用定性定量模型,在自下而上的个债精选策略基础上,采取适度分散的行业配置策略,从组合层面动态优化风险收益。
3) 信用风险控制措施
本基金实施谨慎的信用评估和市场分析,个债和行业层面的分散化投资策略,当发债企业的基本面出现恶化时,运用“尽早出售(first sale, best sale)”策略,控制投资风险。
本基金使用各信用等级持仓量、行业分散度、组合持仓分布、各项重要偿债指标范围等描述性统计指标,还用VaR, Credit Metrics, Credit Portfolio Views等模型,估计组合在给定制度和事件时期内可能遭受的最大损失,以便有效评估和控制组合信用风险暴露。
3. 期限错配策略
本基金对同一类属固定收益类金融资产的投资进行分散,在给定制约下,通过其他信用约束条件的情况下,通过嘉实债券组合优化策略模型,确定最优的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。
4. 骑乘策略
本基金采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对较高的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将缩短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,对应的将是债券价格的走高,而这一期间债券的涨幅将会高于其他期间,这样就可以获得丰厚的价差收益同时资本利得收入。
5. 息差策略
本基金利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。
6. 中小企业私募债券投资策略
本基金通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对发债主体经营状况及财务状况、行业风险、公司治理及信用风险等因素变化进行跟踪,并通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。
7. 定向发行债券投资策略
本基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
(二) 国债期货投资策略
1. 有效利用国债期货工具,降低交易成本
2. 本基金将在深入研究宏观经济形势和利率走势的基础上,结合国债期货的期限结构、流动性、波动性、相关性等特征,制定国债期货投资策略,并充分运用国债期货保证金交易特点,灵活调整组合国债期货多头仓位。
3. 国债期货的套期保值
本基金在综合分析经济基本面、资金面