

嘉实致兴定期开放纯债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

(2020年6月18日更新)

法规规定的行为,并及时以书面形式通知基金管理人限期改正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在期限内,基金管理人有权对通知未落实事项进行复查,督促基金管理人改正,并向中国证监会报告。基金管理人发现基金管理人未按期改正的,应当及时向中国证监会报告,同时通知基金管理人限期改正,并将检查结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人的违法违规行为,履行报告和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。基金管理人发现基金管理人依据交易指令已经生效的投资指令违法违规、行政强制措施及其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

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:北京市西城区德胜门外大街1号院1号楼9层

联系人:董芳

电话:010-65185688

传真:010-65185677

(2) 嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1601号30楼

联系人:董芳

电话:021-38786588

传真:021-68820210

(二) 基金销售机构

1、嘉实基金管理有限公司

办公地址:北京市朝阳区望京东园四区10号院1号楼

联系人:李海婧

电话:010-59028100

传真:010-59028100

2、嘉实基金管理有限公司分公司

(1) 嘉实基金管理有限公司北京分公司

办公地址:北京市西城区德胜门外大街1号院1号楼9层

联系人:董芳

电话:010-65185688

传真:010-65185677

(2) 嘉实基金管理有限公司上海分公司

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1601号30楼

联系人:董芳

电话:021-38786588

传真:021-68820210

(3) 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5003号平安金融中心46楼

联系人:李海婧

电话:0755-84362200

传真:0755-25870663

(4) 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

联系人:李海婧

电话:0532-66777907

传真:0532-66777676

(5) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址:广州市天河区珠江新城华夏路10号富力盈信广场西塔10楼

联系人:李海婧

电话:020-62305005

传真:020-62305005

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

办公地址:上海市浦东新区浦东南路299号东汇大厦14楼

联系人:廖海平

电话:021-51150298

传真:021-51150398

(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)

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1518号1502室

联系人:李丹

电话:021-22323888

传真:021-22323800

四、基金名称

基金名称:嘉实致兴定期开放纯债券型发起式证券投资基金

基金类型:契约型、定期开放、纯债

基金募集:契约型、定期开放、纯债

基金投资目标:本基金在严格控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。

五、基金的投资范围

本基金主要投资于国债、金融债、企业债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债、短期融资券、中期票据、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金,以及法律法规和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的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等资产,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)及可交换债券。

六、基金的投资策略

1、宏观投资策略

(1) 债券投资策略

本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种固定收益资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险,在符合本基金相关投资规定的前提下,决定组合的久期、期限结构及类属配置,并在在此基础上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资收益。

七、基金的投资组合

1、报告期末投资组合

(1) 债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	756,153,000.00	12.20
2	央行票据	500,468,000.00	8.08
3	金融债	1,243,914,914.00	20.40
4	企业债	2,379,755,600.00	38.51
5	中期票据	2,266,221,900.00	36.48
6	资产支持证券	2,296,251,900.00	36.84
7	债券回购(含逆回购)	-	-
8	银行存款	797,121,000.00	12.87
9	其他	-	-
10	合计	7,443,166,414.00	120.14

(2) 报告期末前十名持仓的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11191107	2,700,000	4.34
2	11200119	2,700,000	4.34
3	11191078	2,700,000	4.34
4	150208	2,600,000	4.20
5	190206	2,600,000	4.20

(3) 报告期末前十名持仓的股票投资组合

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20
2	招商局港口	142,880,147.66	2.20
3	招商局港口	142,880,147.66	2.20
4	招商局港口	142,880,147.66	2.20
5	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(4) 报告期末前十名持仓的股指期货

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1912	14,993,415.72	0.23

(5) 报告期末前十名持仓的国债期货

序号	国债期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TB1912	14,993,415.72	0.23

(6) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(7) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(8) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(9) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(10) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(11) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(12) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(13) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(14) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(15) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(16) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(17) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(18) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(19) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(20) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(21) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(22) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(23) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(24) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(25) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(26) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(27) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(28) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(29) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(30) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(31) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(32) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(33) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(34) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(35) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(36) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(37) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(38) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(39) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(40) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(41) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(42) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(43) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(44) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(45) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(46) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(47) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(48) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(49) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(50) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(51) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(52) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(53) 报告期末前十名持仓的债券回购

序号	债券回购名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(54) 报告期末前十名持仓的银行存款

序号	银行存款名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(55) 报告期末前十名持仓的其他

序号	其他名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(56) 报告期末前十名持仓的权证

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商局港口	142,880,147.66	2.20

(57) 报告期末前十名持仓的资产支持证券

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	----------	---------	--------------