

# 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1月7日)

## 【本基金不向个人投资者销售】

产规模7959.6亿元。

(五)基金托管人的内部控制制度说明

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,严格监督,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,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.内部控制组织架构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督;资产托管部内设独立、专职的稽核监察处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有及时行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部控制控制原则

(1)全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则:资产托管部设立独立的稽核监察处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和可操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分开。

(6)有效性原则:内部控制体系同所处的环境相适应,以合理的成本实现内控目标,内部制度的制订应当具有前瞻性,并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要,适时进行相应修改和完善;内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正;

(7)审慎性原则:内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设;

(8)责任追究原则:各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

(六)内部控制制度及措施

1.制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2.建立完善的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

3.风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

4.相对独立的业务操作空间,业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

5.人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

6.应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

(七)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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作进行监督稽核的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,基金托管人对基金管理人的投资对象和投资比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回及其他有关基金投资运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有关违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人拒不纠正或有重大违规行为在限期内未纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人违法违规,或违反基金合同的,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。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规,行政法规和基金合同约定,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

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内大街7号北京万豪中心D座12层

电话 (010) 65215588 传真 (010) 65215577

联系人 黄娜

2.代销机构

基金管理人可根据有关法律法规、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并在基金管理人网站公示。

(二)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27楼09-14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 经雷

联系人 彭鑫

电话 (010) 65215588

传真 (010) 65185678

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称 上海市锦泰律师事务所

住所 办公地址 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) 15610298-827 传真 (021) 51150388

经办律师 刘佳、陆佳雯

(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 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

法定代表人 李丹

电话 (021) 23223888 传真 (021) 23223800

经办注册会计师 薛竞、周伟

## 四、基金名称

本基金名称-嘉实致兴定期开放纯债券型发起式证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型、以定期开放的方式运作。

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,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。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券,以及资产支持证券、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)、可交换债券。

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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%(开放期开始前10个工作日至开放期结束后10个工作日内,本基金不受此比例限制);在开放期内,基金投资的现金或到期日在一年以内的政府债券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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

1.封闭期投资策略

(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、收益率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特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,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。

1)利率策略

本基金将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判调整组合久期,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涨带来的收益;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,在信用类固定收益金融工具中进行个债的精选,结合适度分散的行业配置策略,构造和优化组合。

通过分析“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、管理层素质与公司治理分析、运营与财务状况分析、债券契约分析,特殊事项风险分析等,依靠嘉实信用分析团队及嘉实中央研究平台的其他资源,深入挖掘发债主体经营、财务状况、现金流、发展趋势等情况,严格遵守嘉实信用分析流程,执行嘉实信用投资策略,并将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%(开放期开始前10个工作日至开放期结束后10个工作日内,本基金不受此比例限制);在开放期内,基金投资的现金或到期日在一年以内的政府债券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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

九、基金的风险管理

1.封闭期投资策略

(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、收益率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特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,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。

1)利率策略

本基金将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判调整组合久期,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涨带来的收益;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,在信用类固定收益金融工具中进行个债的精选,结合适度分散的行业配置策略,构造和优化组合。

通过分析“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、管理层素质与公司治理分析、运营与财务状况分析、债券契约分析,特殊事项风险分析等,依靠嘉实信用分析团队及嘉实中央研究平台的其他资源,深入挖掘发债主体经营、财务状况、现金流、发展趋势等情况,严格遵守嘉实信用分析流程,执行嘉实信用投资策略,并将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%(开放期开始前10个工作日至开放期结束后10个工作日内,本基金不受此比例限制);在开放期内,基金投资的现金或到期日在一年以内的政府债券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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

十、基金的费用

1.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27楼09-14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 经雷

成立日期 1999年3月25日

注册资本 15亿元

股权结构 中诚信托有限责任公司40%,DWS Investments Singapore Limited30%,立信投资有限公司30%。

存续期间 持续经营

电话 (010) 65215588

传真 (010) 65185678

联系人 胡玥欣

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[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、北京、武汉、重庆分公司。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

牛成文先生,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处长、处长;中国人民银行分行党委委员、副行长(挂职);中国人民银行监督管理委员会(下称银保监会)非银行金融机构监管部处长;银保监会新疆监管局党委书记、副局长;银保监会银行监管四部副主任;银保监会黑龙江监管局党委书记、局长;银保监会资产托管业务工作部(资产托管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。

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、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津渤阳原料材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限责任公司、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月起任公司董事长。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任证监会财富管理部运用处主任科员;银保监会银行监管四部副主任;银保监会黑龙江监管局党委书记、局长;银保监会资产托管业务工作部(资产托管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。

韩家庆先生,董事,公司总经理,经济学博士。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、天津渤阳原料材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限责任公司、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月起任公司董事长。

王瑞华先生,董事,管理学博士,会计学教授,注册会计师,中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生院副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼MBA教育中心主任。

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(CFP)。1998年至2008年在美国国际集团(AIG)国际投资公司美国纽约总部担任研究工作。2008年至2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监,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)、机构投资者固定收益业务首席投资官;2018年3月起任公司总经理。

张树忠先生,监事长,经济学博士,高级经济师,中共党员。曾任华夏证券资产管理部总经理,研究发展部总经理;光大证券公司北京总部总经理,北方总部总经理、资产管理总监;光大保德信基金管理有限公司董事、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。

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总监。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

罗苑芬女士,监事,经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表,2004年9月至2006年1月任泰人寿保险股份有限公司(筹)法律事务主管,2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法律经理,2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司,曾任稽核部执行总监,现任基金运营总监。

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月任博时基金管理有限公司总经理助理。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。

王屹女士,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。

2.基金经理

(1)现任基金经理

尹庚先生,硕士学历,11年证券从业经历,具有基金从业资格。曾任英大证券咨询分析师、投资交易员;金属基金债券交易员;2014年4月加入嘉实基金管理有限公司,历任债券交易员、投资经理,现任职于固定收益业务体系配置策略组。2018年9月22日至今任嘉实致兴定期开放纯债券型发起式证券投资基金基金经理,2019年7月20日至今任嘉实新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2019年12月11日至今任嘉实致兴3个月定期开放纯债券型发起式证券投资基金基金经理。

(2)历任基金经理

王茜女士,管理时间为2018年6月8日至2020年1月3日。

3.债券投资决策委员会

债券投资决策委员会的成员包括:公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系策略组组长王茜女士、胡永青先生、王怀震先生。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

(二)基金托管人

(一)基金托管人概况

名称:兴业银行股份有限公司

注册地址:福建省福州市湖东路154号

成立时间:1989年8月22日

法定代表人:高建平

注册资本:2,077,400万元人民币

联系电话:(021)52622999

联系人:吴玉婷

(二)发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本207.74亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2017年12月31日,兴业银行资产总额26,427亿元,实现营业收入1,399.75亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润572,002万元。根据2017年英国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名,兴业银行按一级资本排名第28位,按总资产排名第30位,跻身全球银行30强。按照美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单,兴业银行以426.216亿美元总资产排名第230位。同时,过去一年在国内外权威性组织的各项评比中,先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

(三)托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合处、运营管理处、稽核监察市场处、委托资产管理处、科技支持处、市场稽核监察处、下设托管处、资产管理及产品研发处、企业养老金管理中心等处室,共有员工100余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(四)基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[74]号。截至2018年6月30日,兴业银行已托管开放式基金239只,托管基金财

产规模7959.6亿元。

(五)基金托管人的内部控制制度说明

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,严格监督,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,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.内部控制组织架构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督;资产托管部内设独立、专职的稽核监察处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有及时行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部控制控制原则

(1)全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则:资产托管部设立独立的稽核监察处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和可操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分开。

(6)有效性原则:内部控制体系同所处的环境相适应,以合理的成本实现内控目标,内部制度的制订应当具有前瞻性,并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要,适时进行相应修改和完善;内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正;

(7)审慎性原则:内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设;

(8)责任追究原则:各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

(六)内部控制制度及措施

1.制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2.建立完善的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

3.风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

4.相对独立的业务操作空间,业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

5.人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

6.应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

(七)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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作进行监督稽核的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,基金托管人对基金管理人的投资对象和投资比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回及其他有关基金投资运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有关违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人拒不纠正或有重大违规行为在限期内未纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人违法违规,或违反基金合同的,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。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规,行政法规和基金合同约定,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。

十、基金的费用

1.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27楼09-14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 经雷

成立日期 1999年3月25日

注册资本 15亿元

股权结构 中诚信托有限责任公司40%,DWS Investments Singapore Limited30%,立信投资有限公司30%。

存续期间 持续经营

电话 (010) 65215588

传真 (010) 65185678

联系人 胡玥欣

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[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、北京、武汉、重庆分公司。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