

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
基金合同生效日:2015年03月29日
1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,勤勉尽责,诚实信用,公平对待投资者,不损害基金份额持有人的合法权益,不从事任何内幕交易、操纵市场和证券欺诈行为,并承担相应法律责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:嘉合磐石
基金代码: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

2.2 基金主要指标
截至2015年12月31日,本基金资产净值为1,167.00亿元人民币,基金份额净值为1.167元。
2.3 基金管理人及基金托管人
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

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人 (Fund Manager). Lists key personnel like 姓名 (Name), 姓名 (Name), 姓名 (Name).

3.1 主要财务指标和利润分配情况
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准

嘉合磐石混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

本报告期,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均得到公平对待。

4.3 异常交易行为的专项说明
本报告期未发现本基金存在异常交易行为。
4.4 报告期内基金投资运作及业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年对资本市场来说精彩纷呈,债券市场由于宏观经济增长低迷、通胀低徘徊和央行五次降准,五至六月份利率下行,长期国债受到利率下行影响有所波动,但整体收益率仍然呈现了显著下行态势。中期国债、国债利率平开,1年期AAA、AA+短期票据从年初的4.72%左右下行至3.8%左右。

权益市场是精彩纷呈,在“改革”和“稳增长”的刺激下,上半年的A股市场迎来了一拨非常强烈的牛市,上证指数大上高潮达到600%,并于11月19日创下历史新高。但随后外盘市场的震荡和人民币升值等因素,使得A股市场在11月之后出现回调,并在12月进入四季度调整期。

本基金在报告期内,秉承稳健投资理念,在报告期内保持相对稳定的组合仓位,追求长期稳健增值。本基金在报告期内,秉承稳健投资理念,在报告期内保持相对稳定的组合仓位,追求长期稳健增值。

4.6 报告期内基金管理人履行职责情况
4.6.1 基金管理人履行职责情况
4.6.2 基金管理人履行职责情况

4.7 基金管理人履行职责情况
4.7.1 基金管理人履行职责情况
4.7.2 基金管理人履行职责情况

4.8 基金管理人履行职责情况
4.8.1 基金管理人履行职责情况
4.8.2 基金管理人履行职责情况

4.9 基金管理人履行职责情况
4.9.1 基金管理人履行职责情况
4.9.2 基金管理人履行职责情况

5 托管人报告
5.1 托管人报告
5.2 托管人报告

6 审计报告
6.1 审计报告
6.2 审计报告

7 基金投资组合报告
7.1 基金投资组合报告
7.2 基金投资组合报告

7.3 基金投资组合报告
7.3.1 基金投资组合报告
7.3.2 基金投资组合报告

7.4 基金投资组合报告
7.4.1 基金投资组合报告
7.4.2 基金投资组合报告

7.5 基金投资组合报告
7.5.1 基金投资组合报告
7.5.2 基金投资组合报告

7.6 基金投资组合报告
7.6.1 基金投资组合报告
7.6.2 基金投资组合报告

7.7 基金投资组合报告
7.7.1 基金投资组合报告
7.7.2 基金投资组合报告

7.8 基金投资组合报告
7.8.1 基金投资组合报告
7.8.2 基金投资组合报告

7.9 基金投资组合报告
7.9.1 基金投资组合报告
7.9.2 基金投资组合报告

7.10 基金投资组合报告
7.10.1 基金投资组合报告
7.10.2 基金投资组合报告

7.11 基金投资组合报告
7.11.1 基金投资组合报告
7.11.2 基金投资组合报告

7.12 基金投资组合报告
7.12.1 基金投资组合报告
7.12.2 基金投资组合报告

8.4.1 累计买入金额前期末基金资产净值20%前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (This Period Cumulative Buy Amount), 占期末基金资产净值比例 (%) (Percentage of End Period Net Asset Value).

8.4.2 累计卖出金额前期末基金资产净值20%前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计卖出金额 (This Period Cumulative Sell Amount), 占期末基金资产净值比例 (%) (Percentage of End Period Net Asset Value).

8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本 (Buy Stock Cost), 卖出股票收入 (Sell Stock Income).

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

8.7 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.18 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.19 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.21 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.22 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.23 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.24 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.25 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.26 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.27 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.28 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.29 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.30 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.31 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细