嘉合货币市场基金招募说明书(更新)摘要

(2016年第1号)

基金管理人:嘉合基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二零一六年六月

【重要提示】

一、本次基金募集的准予注册文件名称为:《关于准予嘉合货币市场基金注册的批复》(证监许可[2015]571号),注册日期为:2015年4月7日。本基金的《基金合同》于2015年5月6日正式生效。

二、基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

三、投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、操作或技术风险、合规性风险和其他风险等。

四、基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

五、本基金为货币市场基金,属证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。但投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

六、证券投资基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

七、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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

八、本招募说明书所载内容截止日为2016年5月6日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2016年3月31日。(本招募说明书中的财务资料未经审计)本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:嘉合基金管理有限公司
住所:上海市虹口区广纪路738号1幢329室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼
邮政编码:200082
法定代表人:徐岱
成立日期:2014年7月30日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监许可[2014]621号
经营范围:基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其它业务。
组织形式:有限责任公司
注册资本:10000万元
联系人:翁海虹
电话:021-60168300
存续期间:永久存续

股权结构:中航信托股份有限公司占30%、广东万和集团有限公司占25%、上海慧弘国际贸易有限公司占25%、福建省圣农实业有限公司占20%。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

余萌先生,厦门大学硕士学位。曾任江西省农行国际业务部副总经理,江西江南信托投资股份有限公司副总裁、常务副总裁,现任中航信托股份有限公司党委书记及总经理,兼任嘉合基金管理有限公司董事长。

郝艳芬女士,北京大学EMBA。曾任中国农业银行青岛分行国际业务部科员,现任上海慧弘国际贸易有限公司董事长,兼任嘉合基金管理有限公司副董事长。

周建儿先生,江西农业大学硕士研究生。曾任江西江南信托投资股份有限公司发展研究部副总经理,江南证券有限责任公司投资银行部副总经理,现任中航信托股份有限公司投资管理部总经理,兼任嘉合基金管理有限公司董事。

卢础其先生,现任广东万和集团有限公司董事、广东鸿特精密技术(台山)有限公司董事、广东顺德农村商业银行股份有限公司董事、广东揭东农村商业银行股份有限公司董事、佛山市顺德万和电气配件有限公司监事、万和国际(香港)有限公司董事及广东万和新电气股份有限公司董事长,兼任嘉合基金管理有限公司董事。

陈剑华先生,北京大学光华管理学院EMBA硕士毕业。曾就职于福建华兴证券公司、福建省资信评估公司、华泰证券有限责任公司等多家金融企业单位,负责多家上市公司的股份制改制、股票发行上市和企业收购兼并工作。现任福建圣农发展股份有限公司副总经理、董事会秘书,兼任嘉合基金管理有限公司董事。

徐岱先生,南京大学工商管理专业硕士学位。曾任南京力信杰科技贸易有限公司副总经理,中信银行股份有限公司上海分行公司业务部副总经理及浦东分行行长助理,江苏瑞华投资控股集团有限公司董事总经理,现任嘉合基金管理有限公司法定代表人、总经理及董事,代任督察长。

曹凤岐先生,北京大学经济学院毕业。现为北京大学光华管理学院教授、博士生导师,北京大学金融与证券研究中心主任,并任教育部社会科学委员会委员,中国金融学会常务理事,中国投资学会常务理事,北京市金融学会副会长等职,兼任嘉合基金管理有限公司独立董事。

姚长辉先生,北京大学金融学博士学位。现为北京大学光华管理学院教授、博士生导师,北京大学金融与证券研究中心副主任,北京大学创业投资研究中心副主任,北京大学保险与社会保障研究生中心副主任,中国金融学会理事,北京市金融学会理事,北京市投资学会理事,兼任嘉合基金管理有限公司独立董事。

程卫东先生,武汉大学法学博士学位。曾在长沙理工大学任教,现任中国社会科学院欧洲研究所副所长,中国欧洲学会常务理事,中国欧洲法律研究会秘书长,中国国际私法研究会理事等职,兼任嘉合基金管理有限公司独立董事。

2、监事会成员

蔡荣忠先生,监事会主席,同济大学工商管理硕士学位。曾任江苏汇鸿国际集团有限公司财务部经理、南京鸿意地产开发有限公司财务总监,福记食品服务控股有限公司中央财务及计划管理部总经理,南京市白下区高新技术产业园区科技小额贷款有限公司副总经理,现任上海星怡投资控股有限公司总裁,上海慧弘国际贸易有限公司总经理。

卢宇阳先生,监事,美国约翰韦尔斯大学硕士学位,曾任广东鸿特精密技术股份有限公司董事会秘书助理,现任广东万和股份有限公司副总裁兼董事会秘书。

廖俊杰先生,监事,同济大学毕业。现就职于福建圣农发展股份有限公司证券部,参与了公司首次公开发行股票并上市的相关工作。

杨军先生,职工监事,英国雷丁大学硕士研究生。曾在上海德勤华永会计师事务所全球金融服务组,银河基金管理有限公司监察稽核部任职,现任嘉合基金管理有限公司监察稽核部副总监。

付祥先生,职工监事,南京大学硕士研究生,曾任华泰证券投资股份有限公司投资经理助理,现任嘉合基金管理有限公司量化投资部主管。

张文炜先生,职工监事,武汉大学金融学硕士研究生,曾任马应龙药业集团项目投资部投资经理,广东盈峰创业投资管理有限公司投资经理,现任嘉合基金管理有限公司董事会秘书。

3、高级管理人员

余萌先生,现任公司董事长,简历同上。

徐岱先生,现任公司总经理,代任督察长,简历同上。

高明先生,英国诺丁汉大学商学院硕士研究生。曾任中国石化集团市场开发部经理、财务部经理,加拿大贝祥投资集团高级投资经理,中非发展基金有限公司投资二部总经理助理,现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

李宇龙先生,上海交通大学管理科学与工程博士研究生,美国佐治亚理工学院商学院MBA、金融工程硕士研究生。曾任美国Wilmington Trust Investment Management基金经理,上海证券交易所执行经理,美国Balentine投资公司合伙人、全球投资研究主管,合众资产管理股份有限公司总经理助理,现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

邵若昊先生,复旦大学硕士研究生。曾任长信基金管理有限公司市场部副总监,富国基金管理有限公司机构部总监助理,诺安基金管理有限公司机构业务总监,融通基金管理有限公司机构业务总监,现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

崔为中先生,武汉大学法学院硕士研究生。曾任中创投资公司海南代表处系统管理员资金主管,中诚信证券评估公司海南分公司电脑部经理、办公室副主任,长城证券公司信息技术部总助,英大证券公司IT技术总监,现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

李辉女士,上海交通大学/法国马赛学院财务管理硕士研究生。曾任三九企业集团(深圳南方制药厂)出纳兼财务部长助理,三九高科技有限公司财务经理,上海三九科技发展股份有限公司人力资源部总监兼公司监事,上海九天橡胶制品有限公司董事兼副总经理,上海易淘达网络科技有限公司综合管理部总监,北京温馨天使科技有限公司董事会秘书兼人事行政总监,现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

韩光华先生,中央财经大学硕士研究生。曾任中央财经大学保险学院讲师、华夏基金机构产品部副总裁、诺安基金产品研发中心副总裁,现任嘉合基金管理有限公司副总经理。

4、基金经理

薛思乔先生,南京大学金融学学士,美国市立纽约大学应用数学硕士,法国巴黎综合理工学院金融数学硕士,拥有5年金融行业从业经验,2011年进入法国巴黎银行(BNP),担任数量分析师,先后在香港和新加坡分行工作,负责固定收益以及股票等各类衍生产品的定价建模及风险控制系统维护,2013年转入法国巴黎银行上海分行资金部,负责流动性风险建模及监控,于2014年9月加入嘉合基金管理有限公司。

季慧娟女士,同济大学经济学学士,上海财经大学金融学硕士,拥有8年金融行业从业经验,曾任华宝信托有限责任公司交易员,德邦基金管理有限公司债券交易员,中欧基金管理有限公司债券交易员,2014年12月加入嘉合基金管理有限公司,曾任嘉合基金管理有限公司债券交易员。

于启明先生,厦门大学金融工程学士,拥有8年金融行业从业经验,曾任宝盈基金管理有限公司固定收益部基金经理,2015年6月加入嘉合基金管理有限公司,担任固定收益部副总监职位。

5、投资决策委员会成员

徐岱先生,简历同上。

李宇龙先生,简历同上。

邵若昊先生,简历同上。

姚文辉先生,西安交通大学应用经济学专业硕士。曾任金元证券股份有限公司固定收益总部债券投资经理、中欧基金管理有限公司中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧货币市场基金基金经理、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理,现任嘉合基金管理有限公司固定收益部总监。

曹成先生,海牙大学金融与会计专业硕士研究生。曾任富通私人银行(荷兰)数据分析师,富安达基金管理有限公司交易部交易员,光大保德信基金管理有限公司交易部交易员,现任嘉合基金管理有限公司中央交易室总监助理。

王俊先生,河海大学国民经济学硕士研究生。曾任南通新福达电子采购经理,江苏瑞华投资控股集团基金经理,现任嘉合基金管理有限公司研究部副总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:洪渊

2、主要人员情况

截至2015年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工198人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年12月,中国工商银行共托管证券投资基金522只。自2003年以来,本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的49项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

(1)嘉合基金管理有限公司直销中心
名称:嘉合基金管理有限公司
住所:上海市虹口区广纪路738号1幢329室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼
法定代表人:徐岱
电话:021-60168270
传真:021-65015087
联系人:商林华
客户服务电话:400-060-3299
网址:www.haoamc.com

(2)其它基金销售机构

1)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
法定代表人:燕斌
客服电话:4000-466-788
联系人:张巍婧
传真:021-62990063
网址:http://www.91fund.com.cn/

2)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人:杨懿
客服电话:400-166-1188
联系人:张燕
传真:010-58325300
网址:http://www.jrj.com.cn/

3)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客服电话:400-0766-123
联系人:徐昳绯
网址:http://www.fund123.cn/

4)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
客服电话:400-6411-999
联系人:张晓辉
网址:www.taichengcaifu.com

5)中泰证券有限公司(原齐鲁证券)
注册地址:济南市经七路86号
办公地址:济南市经七路86号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
联系人:马晓男
网址:www.qlzq.com.cn

6)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
客服电话:?95521
联系人:朱雅崴
网址:www.gtja.com

7)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
客服电话:95523
联系人:黄莹
网址:www.swhysc.com

8)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:李季
客服电话:4008-000-562
联系人:李巍
网址:www.hysec.com

9)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12F
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
联系人:张裕
网址:www.noah-fund.com

10)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-96326、400-88-96326
联系人:郭相兴
网址:www.hfzq.com.cn

11)大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:南京市建邺区江东中路222号奥体中心文体创业园
法定代表人:袁顾明
客服电话:400-928-2266
联系人:朱真卿
网址:www.dtfunds.com

12)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座7楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818188
联系人:朱玉
网址:www.1234567.com.cn

13)北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO1008-1012
法定代表人:赵荣春
客服电话:400-893-6885
联系人:高静
网址:www.qianjing.com

14)联讯证券
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
客服电话:95564
联系人:周复
网址:www.lxsec.com

15)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:冯修敏
客服电话:400-820-2819
联系人:李栋
网址:www.chinapnr.com

16)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人:俞洋
客服电话:400-109-9918
联系人:王逍
网址:www.cfsc.com.cn

17)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号院5号楼702室
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
客服电话:400-001-1566
联系人:徐越
网址:www.yilucaifu.com

18)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东大道555号裕景国际B座16楼
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-820-2899
联系人:唐诗洋
网址:www.erichfund.com

19)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦15F
法定代表人:郭坚
客服电话:4008219031
联系人:何雪
网址:www.lufunds.com

20)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:陆敏
网址:www.ehowbuy.com

21)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市黄浦区龙华东路647号电科滨江中心16楼
法定代表人:王莉
客服电话:400-920-0022
联系人:刘英
网址:http://licaike.hexun.com

其它基金销售机构情况详见基金管理人发布的相关公告,基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。

(二)登记机构
名称:嘉合基金管理有限公司
住所:上海市虹口区广纪路738号1幢329室
法定代表人:徐岱
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼
电话:021-60168300
传真:021-65015080
联系人:邓若轶
网址:www.haoamc.com

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:吕红、安冬
联系人:安冬

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)上海分所
住所:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼
合伙人:边卓群
电话:021-22284252
传真:021-22280314
联系人:濮晓达
经办注册会计师:边卓群 濮晓达

四、基金的名称

嘉合货币市场基金

五、基金的类型

基金类型:货币市场基金

六、基金的运作方式

契约型开放式基金

七、基金的投资目标

在保持基金资产的低风险和高流动性前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

八、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括:现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,短期融资券,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,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。

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。

九、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济发展态势、金融监管政策、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析,形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上,本基金将根据不同类别资产的收益率水平(不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性),结合各类资产的流动性特征(日均成交量、交易方式、市场流量)和风险特征(信用等级、波动性),决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。

2、债券筛选策略

本基金将优先考虑安全性因素,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种进行投资以规避风险。在基金投资中对个券进行选择时,首先本基金将针对各券种的信用等级、剩余期限和流动性进行初步筛选;第二步,本基金将评估其投资价值,进行再次筛选,这一步主要针对各券种的收益率与剩余期限的结构合理性进行筛选;最后,在前两步筛选的基础上,再评估各券种的到期收益率波动性与可投资量(流通量、日均成交量与冲击成本估算),从而综合决定具体各个券种的投资比例。

3、现金流管理策略

作为现金管理工具,本基金具有较高的流动性要求。本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。具体操作中,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等量配置等手段,从而争取在保持充分流动性的基础上取得较高收益。

4、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许本类基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险,谨慎投资。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,在履行相应程序后,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

5、基金的决策依据、决策程序

(1)投资决策依据
1)有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2)经济运行态势和证券市场走势。
3)投资对象的风险收益配比。

(2)投资决策程序

1)投资决策支持:研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究方案,向投资决策委员会提出宏观经济分析方案和投资策略方案等决策支持。

2)投资原则的制定:投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的前提下,根据研究人员和基金经理的有关方案,决定基金投资的主要原则,对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

3)研究支持:研究分析人员根据投资决策委员会的决议,为基金经理提供各类分析方案和投资建议;也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

4)制定投资决策:基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则,根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。

5)风险控制与评估:风险管理委员会定期召开会议,听取投资研究部、基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估,并提出风险控制意见。

6)组合的调整:基金经理有权根据环境的变化和实际的需要,在其权限范围内对组合进行调整,超出其权限的调整,需报投资决策委员会审批。

十、基金的业绩比较基准

七天通知存款税后利率

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

十二、基金投资组合报告

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。基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2016年5月25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止至2016年3月31日(“报告期末”)。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	11,892,533,874.27	68.64
	其中:债券	11,892,533,874.27	68.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,000,180.00	0.23
	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	5,107,886,672.59	29.48
4	其他资产	285,478,947.15	1.65
5	合计	17,325,899,674.01	100.00

2、报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目		占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		8.31
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,807,603,898.58	19.35
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

3.1 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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天。本报告期内,本基金未发生超标情况。

3.2 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	26.12	19.35
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	40.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	14.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.35	-
5	180天(含)—397天(含)	18.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	118.12	19.35

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,080,318,629.81	7.45
	其中:政策性金融债	1,080,318,629.81	7.45
4	企业债券	110,993,201.85	0.76
5	企业短期融资券	8,860,369,114.36	61.06
6	中期票据	1,143,500,125.35	7.88
7	同业存单	697,352,802.90	4.81
8	其他	-	-
9	合计	11,892,533,874.27	81.96
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	50,664,533.87	0.35

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1382159	13鞍钢MTN1	5,000,000	500,987,264.83	3.45
2	160201	16国开01	5,000,000	499,148,458.77	3.44
3	111614016	16江苏银行CD016	5,000,000	498,125,204.49	3.43
4	150413	15农发13	3,300,000	330,123,506.84	2.28
5	011574006	15陕煤化SCP006	3,000,000	300,616,431.41	2.07
6	011599724	15酒钢SCP002	3,000,000	299,996,381.77	2.07
7	011599884	15陕煤化SCP009	2,800,000	280,570,735.47	1.93
8	011699315	16陕煤化SCP001	2,300,000	229,901,091.21	1.58
9	041560036	15渝江北嘴CP001	2,000,000	201,715,654.44	1.39
10	011599612	15陕煤化SCP007	2,000,000	200,436,992.07	1.38

6、“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	0.2215%
报告期内偏离度的最低值	0.1063%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1739%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注

8.1 基金计价方法说明

2007年7月1日基金实施新会计准则后,本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,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,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	99,571,140.00
3	应收利息	185,680,407.15
4	应收申购款	227,400.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	285,478,947.15

8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为2016年3月31日。

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。

(一)本基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

1、嘉合货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日	1.9243%	0.0063%	0.8877%	0.0000%	1.0366%	0.0063%
2016年1月1日(基金合同生效日)至2016年3月31日	0.7156%	0.0059%	0.3366%	0.0000%	0.3790%	0.0059%

2、嘉合货币B

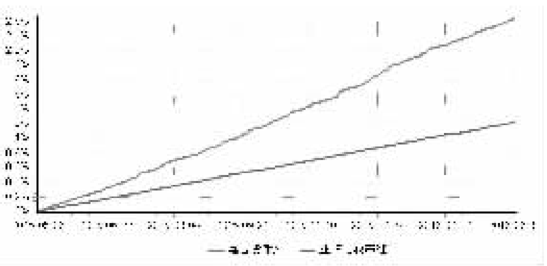
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日	2.0913%	0.0063%	0.8877%	0.0000%	1.2036%	0.0063%
2016年1月1日(基金合同生效日)至2016年3月31日	0.7757%	0.0059%	0.3366%	0.0000%	0.4391%	0.0059%

(二)本基金份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:

嘉合货币A

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

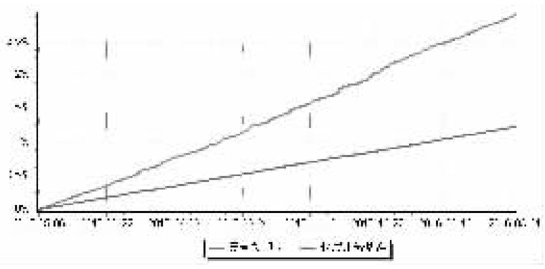
(2015年05月06日-2016年03月31日)



嘉合货币B

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年05月06日-2016年03月31日)



十四、基金的费用和税收

(一)基金费用的种类

一、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、证券账户开户费用、账户维护费用;
10、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。

二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,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次月前2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、公休假等,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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,对于由B类基金份额降级为A类基金份额的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%,对于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人,年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付基金管理人,由基金管理人支付给销售机构。

上述“一、基金费用的种类中第4-10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。

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纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

嘉合货币市场基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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》等有关法规及《嘉合货币市场基金基金合同》进行更新编写,更新的内容主要包括以下几部分:

1、在“重要提示”部分,更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。本招募说明书所载内容截止日为2016年5月6日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2016年3月31日(财务数据未经审计)。

2、第三部分“基金管理人”,更新了基金管理人的相关信息。

3、第四部分“基金托管人”,根据最新资料对相关内容作了相应更新。

4、第五部分“相关服务机构”,增加了相关代销机构,对原有销售机构进行了更新,相关事宜均已公告。

5、第九部分“基金份额的申购与赎回”,更新为“基金份额的申购、赎回与转换”。其中,申购和赎回的数量限制中增加“各代销机构对上述首次申购及追加申购的最低金额有其他规定的,以各代销机构的业务规定为准。”基金转换业务中增加“基金转换开始日及时间、基金转换业务规则、基金转换费及份额计算方法、暂停基金转换的情形及处理”等内容。

6、第十部分“基金的投资”,“基金投资组合报告”更新为数据截止日为2016年3月31日的报告,该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核,但未经审计。

7、第十一部分“基金的业绩”,对基金成立以来至2016年3月31日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核,但未经审计。

8、“第二十三节 其他应披露事项”,更新了2015年11月7日至2016年5月6日期间涉及本基金的相关公告。

嘉合基金管理有限公司
二〇一六年六月

股票简称:雅戈尔 股票代码:600177 编号:临2016-045

雅戈尔集团股份有限公司关于将部分募集资金续存为大额存单的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个人及连带责任。

一、部分募集资金续存为大额存单的基本情况

公司于2016年5月17日披露了董事会临2016-039《关于将部分募集资金转为大额存单方式存放的公告》,公司将中国银行宁波市分行营业部的募集资金专户(银行帐号为:39-416001040011427)内的34,500.00万元转为大额存单存放。

2016年6月13日,存期为1个月、存单号分别为CD003160513174613395和CD003160513174610182的两笔大额存单到期,本金95,000,000元及利息121,916.67元已回到了募集资金专户。根据募集资金的实际使用情况,为进一步提高使用效率、合理降低公司财务费用、增加存储收益,公司决定将上述95,000,000元的本金续存为大额存单,具体如下:

单位:元

存单号	存入时间	存入金额	存期	利率	起息日	到期日
CD003160513174620080	2016-05-13	100,000,000	6个月	1.82%	2016-05-13	2016-11-13
CD003160513174618160	2016-05-13	50,000,000	6个月	1.82%	2016-05-13	2016-11-13
CD003160513174616352	2016-05-13	100,000,000	3个月	1.54%	2016-05-13	2016-08-13
CD003160613120129541	2016-06-13	35,000,000	1个月	1.54%	2016-06-13	2016-07-13
CD003160613120131968	2016-06-13	60,000,000	1个月	1.54%	2016-06-13	2016-07-13

二、上述以大额存单方式存放的募集资金的管理

1、公司将95,000,000元募集资金续存为大额存单时,已通知保荐机构。

上述存单到期后,公司将及时将资金转入相应的募集资金专户进行管理,或以存单方式续存,并通知保荐机构。

2、公司不得对上述存单设定质押。

3、公司不得从上述大额存单账户直接支取资金,也不得向本存单对应的募集资金专户之外的其他账户划转资金。公司如需支取资金,必须将上述大额存单转入募集资金专户,并及时通知保荐机构。

4、本大额存单不可转让。

5、公司将在部分募集资金续存为大额存单后及时履行信息披露义务。

特此公告。

雅戈尔集团股份有限公司
董事会
二〇一六年六月十四日

证券代码:002190 证券简称:成飞集成 公告编号:2016-036

四川成飞集成科技股份有限公司关于筹划非公开发行股票事项继续停牌公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

四川成飞集成科技股份有限公司(以下简称"公司"、"本公司")因筹划重大事项,经申请,公司股票自2016年4月21日开市起停牌,公司于同日发布了《重大事项停牌公告》(公告编号:2016-024),并分别于2016年4月28日、2016年5月6日、2016年5月13日发布了《重大事项继续停牌公告》(公告编号:2016-028、2016-029、2016-030);2016年5月20日,公司将筹划的重大事项方式确定为非公开发行股票,发布了《关于重大事项进展暨筹划非公开发行股票事项继续停牌的公告》(公告编号2016-032),并于2016年5月27日、6月3日分别发布了《关于筹划非公开发行股票事项继续停牌公告》(公告编号2016-033、2016-035)。详细内容请见公司指定信息披露媒体《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

目前,有关各方正在紧张、有序地推进公司非公开发行股票事项。根据相关规定,上述事项须提交国家有权部门履行相关审查程序。鉴于公司本次非公开发行股票事项尚存在不确定性,为维护广大投资者的利益,保证公平信息披露,避免对公司股价造成重大影响,根据深圳证券交易所的相关规定,经公司申请,公司股票自2016年6月14日开市起继续停牌。

停牌期间,公司将根据相关事项的进展情况,严格按照有关法律法规的要求及时履行信息披露义务。待相关事项确定后,公司将及时发布相关公告并申请公司股票复牌。请广大投资者理性投资,注意风险。

特此公告。

四川成飞集成科技股份有限公司董事会
2016年6月14日

证券代码:002566 证券简称:益盛药业 公告编号:2016-030

吉林省集安益盛药业股份有限公司关于子公司完成工商变更登记的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

吉林省集安益盛药业股份有限公司(以下称“公司”)于2016年5月27日召开第六届董事会第一次会议,审议通过了《关于子公司变更公司名称、增加经营范围并修订<公司章程>的议案》,同意公司全资子公司吉林省集安益盛汉参中药材种植有限公司(以下简称“汉参种植”)根据其业务发展需求,对公司名称和经营范围等事项进行变更。同时,授权汉参种植董事会根据上述变更事项修改《公司章程》,办理公司工商变更登记相关事宜。内容详见公司于2016年5月28日刊登在指定信息披露媒体《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网上的《第六届董事会第一次会议决议公告》(公告编号:2016-026)。

近日,公司收到汉参种植的通知,汉参种植已办理完成相关工商变更登记手续,并领取了集安市市场监督管理局换发的统一社会信用代码为91220582068638457U的《营业执照》,具体工商登记事项变更如下:

变更事项	变更前	变更后
注册号/统一社会信用代码	220582000014520	91220582068638457U
公司名称	吉林省集安益盛汉参中药材种植有限公司	吉林省益盛汉参生物科技有限公司
经营范围	中药材种植、收购、加工、销售;有机肥加工、销售。	生物制品研发、加工、销售及技术转让、技术服务;农业技术研发、转让;农副产品加工、技术研发、转让;中药材种植、收购、加工、销售;有机肥加工、销售;保健食品、化妆品、预包装食品兼散装食品销售。

除上述信息外,营业执照其他信息未发生变更。

特此公告。

吉林省集安益盛药业股份有限公司
董事会
二〇一六年六月十三日

证券代码:002598 证券简称:山东章鼓 公告编号:2016030

山东省章丘鼓风机股份有限公司关于参加山东辖区上市公司2016年度投资者网上集体接待日活动的公告

本公司及全体董事会人员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

为进一步加强山东省章丘鼓风机股份有限公司(以下简称"公司")与广大投资者尤其是中小投资者之间的沟通交流,提升公司投资者关系管理水平,保护投资者权益,公司将于2016年6月16日(星期四)下午14:30-16:30参加由山东证监局举办的"山东辖区上市公司2016年投资者网上集体接待日活动",现将有关事项公告如下:

本次投资者接待日活动将在深圳证券信息有限责任公司提供的网上平台采取网络远程的方式举行,投资者可以登录全景网(http://www.p5w.net)参与公司本次投资者网上集体接待日活动。

出席本次投资者网上接待日活动的公司人员有:公司副董事长、董事会秘书兼财务总监方树鹏先生;证券事务代表陈超先生。

欢迎广大投资者积极参与!

特此公告。

山东省章丘鼓风机股份有限公司
董事会
2016年6月13日

股票代码:603223 股票简称:恒通股份 公告编号:2016-017

恒通物流股份有限公司关于参加“山东辖区上市公司2016年投资者网上集体接待日活动”的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

为进一步加强恒通物流股份有限公司(以下简称"公司")与投资者尤其是中小投资者的沟通交流,提升公司投资者关系管理水平,保护投资者权益,公司将于2016年6月16日(星期四)下午14:30-16:30参加由山东证监局举办的"山东辖区上市公司2016年投资者网上集体接待日活动",现将有关事项公告如下:

一、本次投资者网上集体接待日活动将在深圳市全景网络有限公司提供的网上平台采取网络远程方式举行,投资者可以登陆全景网(www.p5w.net)参与本次活动;

二、活动时间为2016年6月16日(星期四)14:30-16:30。

三、出席本次网上集体接待日的人员有本公司财务总监张尔言先生;董事会秘书程业先生;证券事务代表李鹏先生。欢迎广大投资者积极参与。

特此公告。

恒通物流股份有限公司董事会
2016年6月13日