嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第1号）

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

重要提示

嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证监会2016年10月9日《关于准予嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可 [2016] 2287号)注册募集。本基金基金合同于2016年12月29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,投资者申购本基金时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对基金合同的承认和接受,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2018年6月29日 (特别事项注明除外), 有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日 (未经审计)。

一、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53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	赵学军
成立日期	1999 年3 月25 日
注册资本	1.5 亿元人民币
股权结构	中诚信托有限责任公司40%,德意志资产管理(亚洲)有限公司30%,立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[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、北京怀柔、武汉分公司。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处长、处长;中国银行厦门分行党委委员、副行长(挂职);中国银行业监督管理委员会(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委员、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;银监会融资性担保业务工作部(融资性担保业务监管部际联席会议办公室)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、天津纺织原材料交易所、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。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员;国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秘兼发展战略官;现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理;兼任中诚国际资本有限公司总经理、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结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来,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)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

Jonathan Paul Eilbeck先生, 董事, 英国籍, 南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问,JP Morgan固定收益亚太区CFO、COO,JP Morgan Chase固定收益亚太区CFO、COO,德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生,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月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今, 任北京德恒有限责任公司总经理;2001年11月至今,任立信投资有限责任公司董事长。

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博士。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,美国化学银行分析师,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至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编,汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员,现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

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。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。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。

张树忠先生,监事长,经济学博士,高级经济师,中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理;光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监;光大保德信基金管理公司董事、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,兼任中诚资本管理(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主管。2001年11月至今任立信投资有限责任公司财务总监。

龚康先生,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,历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生,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,为国浩律师集团(北京)事务所证券部律师。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。

经雷先生,总经理,金融学、会计学专业本科学历,工商管理学学士学位,特许金融分析师(CFA)。1998年到2008在美国国际集团(AIG)国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到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)、机构投资和固定收益业务首席投资官,现兼任公司固定收益业务首席投资官。

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。

邵健先生,副总经理,硕士研究生。历任国泰证券行业研究员,国泰君安证券行业研究部副经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

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。

2、基金经理

(1)现任基金经理

王亚洲先生,6年证券从业经验, 曾任国泰基金管理有限公司债券研究员,2014 年6月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部。具有基金从业资格,中国国籍。2017年3月28日至2018年4月10日任嘉实稳泰债券型证券投资基金基金经理。2017年6月13日至2018年1月11日任嘉实稳康纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年7月12日至2018年4月10日任嘉实稳愉债券型证券投资基金基金经理。2015年7月9日起任嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金、嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金经理。2016年9月20日起任嘉实稳盛债券型证券投资基金基金经理。2016年11月4日起任嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月14日至今任嘉实稳华纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年10月17日至今任嘉实稳怡债券基金经理。2016年12月29日任本基金基金经理。

(2)历任基金经理

无。

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、万晓西先生、胡永青先生、以及养老金固收投资组长王怀震先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

本基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司,基本信息如下:

名称:中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人:李国华

成立时间: 2007年3月6日

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑和贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 810.31亿元人民币

存续期间: 持续经营

批准设立机关及批准设立文号:中国银监会银监复〔2006〕484号

基金托管资格批文及文号:证监许可[2009]673号

联系人:马强

联系电话:010－68857221

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准, 中国邮政储蓄银行有限责任公司于2012 年1 月21 日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员, 依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务,以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位,发挥邮政网络优势,强化内部控制,合规稳健经营,为广大城乡居民及企业提供优质金融服务,实现股东价值最大化,支持国民经济发展和社会进步。

(二)主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部,下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工22人, 全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格,90%员工具有三年以上基金从业经历,具备丰富的托管服务经验。

(三)基金托管业务经营情况

2009 年7 月23 日,中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准,获得证券投资基金托管资格,是我国第16 家托管银行。2012 年7 月19 日,中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准,获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念,依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务,并获得了合作伙伴一致好评。

截至2018年6月30日,中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共80只。至今,中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品(本外币)、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系,托管规模达41789.05亿元。

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	北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心D座12层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65215577
联系人	赵佳		

(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心

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)38789658	传真	(021)68880023
联系人	邵琦		

(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座2单元21层04-05单元		
电话	(028)86202100	传真	(028)86202100
联系人	王启明		

(4)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6001号太平金融大厦16层		
电话	0755-84362200	传真	(0755)25870663
联系人	陈寒梦		

(5)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		
电话	(0532)66777997	传真	(0532)66777676
联系人	胡洪峰		

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司

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 室		
电话	(0571)88061392	传真	(0571)88021391
联系人	王振		

(7)嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路137号信合广场801A单元		
电话	0591-88013670	传真	(0591)88013670
联系人	吴志锋		

(8)嘉实基金管理有限公司南京分公司

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)66671100
联系人	徐莉莉		

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心50层05-06A单元		
电话	(020)88832125	传真	(020)81552120
联系人	周炜		

2、代销机构

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(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53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	赵学军
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	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼		
负责人	廖海	联系人	范佳斐
电话	(021)51150298-827	传真	(021) 51150398
经办律师	刘佳、范佳斐		

(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	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021)23238888	传真	(021)23238800
经办注册会计师	薛竞、张勇		

四、基金的名称

本基金名称:嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型、以定期开放方式运作的债券投资基金

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,具体包括: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、国债期货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、权证等权益类资产,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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%(开放期开始前二十个工作日至开放期结束后二十个工作日内不受此比例限制);开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者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,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例将做相应调整。

八、基金的投资策略

A.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类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,并在此基础之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。在定性与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。

通过采用“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中央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,执行嘉实信用投资纪律。

1)个别债券选择

首先,本基金依据“嘉实信用分析系统”的研究成果,执行“嘉实投资备选库流程”,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,本基金主要从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)、剩余期限、久期、凸性、流动性(发行总量、流通量、上市时间)等指标,结合组合管理层面的要求,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、通过自由现金流增强去杠杆的财务能力、资产估值更利于支持债务、更强大的公司管理、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卖出的指标可以包括但不限于: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财务能力、发债企业覆盖债务的资产减少、发债企业市场竞争地位恶化、发债企业获得资金的途径减少、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度,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”及嘉实中央研究平台,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情况出现恶化时,运用“尽早出售(first sale, best sale)”策略,控制投资风险。

本基金使用各信用级别持仓量、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,还运用VaR、Credit Metrics、Credit Portfolio Views等模型,估计组合在给定置信水平和事件期限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)期限结构配置策略

本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析, 在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下,通过嘉实债券组合优化数量模型,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

本基金将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,也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高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,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即资本利得收入。

(5)息差策略

本基金将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的资金投资于债券,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

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制, 通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估, 并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券, 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。

2.国债期货投资策略

(1)有效控制投资组合杠杆水平,做多利率债品种

本基金将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上, 预判利率债品种的后期表现, 在有效控制组合杠杆水平的基础上, 充分利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。

(2)国债期货的套期保值

本基金在综合分析经济基本面、资金面和政策面的基础上,结合组合内各利率债持仓结构的基础上,按照“利率风险评估——套期保值比例计算——保证金、期现价格变化等风险控制”的流程,构建并实时调整利率债的套期保值组合。

(3)信用利差交易

利率风险是信用债的重要风险组成。本基金将在基于经济形势和信用风险预期的基础上,利用国债期货,对于信用债的利率风险部分进行一定程度的套期保值,实现信用利差交易,即在预期信用利差缩窄的情况下,做空国债期货,做多信用债,在预期信用利差变宽的情况下,做多国债期货,做空信用债。

3.资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究, 对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

B.开放期投资策略

开放期内,为了保证组合具有较高的流动性,方便投资人安排投资,本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下,主要投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。

C.投资决策依据和决策程序

(1)投资决策依据

法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的有关规定。

宏观经济和上市公司的基本面数据。

投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内,选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

(2)投资决策程序

公司研究部通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。

投资决策委员会定期和不定期召开会议, 根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

在既定的投资目标与原则下,根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型,由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

独立的交易执行:本基金管理人通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

动态的组合管理:基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合本基金的现金流量情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态的调整,使之不断得到优化。

风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控, 并授权风险控制小组进行日常跟踪,出具风险分析报告。监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债总全价指数收益率

中债总全价指数是中央国债登记结算公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债,能较好地反映债券市场的整体收益情况。

采用该比较基准主要基于如下考虑:

1、中债总全价指数由中央国债登记结算公司编制并公开发布,具有较强的权威性和市场影响力;

2、在中债指数体系中,中债总全价指数所代表的债券市场的风险收益特征与本基金较为贴近。因此,中债总全价指数比较适合作为本基金的比较基准。

如果中央国债登记结算公司停止计算编制该指数或更改指数名称、相关法律法规发生变化,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,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,而无须召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基金、混合型基金。

十一、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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年4月18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至2018年3月31日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,988,242,800.00	98.36
	其中:债券	1,988,242,800.00	98.36
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,058,587.48	0.05
8	其他资产	32,154,352.98	1.59
9	合计	2,021,455,740.46	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末,本基金未持有股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	166,156,000.00	10.85
	其中:政策性金融债	166,156,000.00	10.85
4	企业债券	443,938,400.00	29.00
5	企业短期融资券	70,374,000.00	4.60
6	中期票据	710,718,400.00	46.43
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	597,056,000.00	39.00
9	其他	-	-
10	合计	1,988,242,800.00	129.89

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160206	16国开06	800,000	76,840,000.00	5.02
2	111893685	18广州农村商业银行CD012	600,000	57,948,000.00	3.79
3	101456023	14鄂交投MTN001(5年期)	500,000	51,250,000.00	3.35
4	101454003	14中航工MTN001	500,000	50,490,000.00	3.30
5	136151	16保利01	500,000	49,275,000.00	3.22

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1)

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

(2)

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,951.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,124,401.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,154,352.98

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

十二、基金的业绩

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。

1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
2016年12月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	0.01%	0.01%	0.47%	0.13%	−0.46%	−0.12%
2017年	1.97%	0.04%	−4.26%	0.09%	6.23%	−0.05%

2.自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

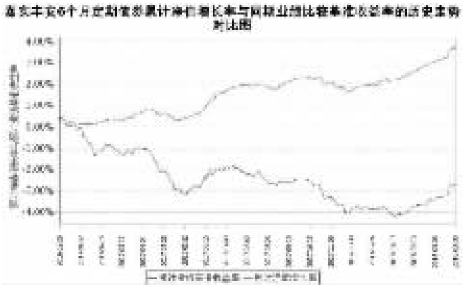

图:嘉实丰安6个月定期债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年12月29日至2018年3月31日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、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)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金的证券、期货交易费用;

(7)基金的银行汇划费用;

(8)基金的开户费用、账户维护费用;

(9)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。

2、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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.3 %÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对无误后,由基金托管人根据基金管理人出具的资金划拨指令于次月前3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.1%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对无误后,由基金托管人根据基金管理人出具的资金划拨指令于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述“1、基金费用的种类中第(3)－(9)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或摊入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M〈100万元	0.8%
100万元≤M<300万元	0.5%
300万元≤M<500万元	0.3%
M≥500万元	按笔收取,单笔1000元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%,但中国银行长城借记卡、中国农业银行借记卡持卡人,申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行;机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金,其申购费率不按申购金额分档,统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%,则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时,按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的,前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注:2014年9月2日,本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》,自2017年6月29日起,增加开通本基金在本公司基金网上直销系统(含电话交易)的后端收费模式(包括申购、定期定额投资、基金转换等业务)、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠,本基金优惠后的费率见下表:

持有期限(T)	基金网上直销后端申购优惠费率
0〈T〈1年	0.10%
1年≤T〈3年	0.05%
T≥3年	0.00%

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费

本基金对基金份额收取赎回费,在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,赎回费100%计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限(T)	赎回费率
T<7天	1.5%
T≥7天,且在同一开放期内申购又赎回	0.1%
持有期限大于等于一个封闭期	0%

基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。

(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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况, 对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:

1.在“重要提示”部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在“三、基金管理人”部分:更新了基金管理人的相关信息。

3.在“四、基金托管人”部分:更新了基金托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分:更新会计师事务所办公地址信息。

5.在“九、基金的投资”部分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

6.在“十、基金的业绩”:基金业绩更新至2018年第一季度末。

7.在“二十二、其他应披露事项”部分:列示了本基金自2017年12月29日至2018年6月29日相关临时公告事项。

8.根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金管理人2018年3月22日发布的《关于修改嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同及托管协议的公告》,更新了“基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露、风险揭示”等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司
2018年8月11日

诺德基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售有限公司为旗下诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告

一、基金代销

根据诺德基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与上海万得基金销售有限公司(以下简称“万得基金”)签署的代销协议,自2018年8月13日起,万得基金将代销本公司旗下诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金。具体基金信息如下:

序号	基金代码	基金名称
1	A类:003561 C类:003562	诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金

二、定投业务

基金定期定额投资业务(以下简称“基金定投”)是指投资者可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请,约定每月扣款时间、扣款金额,由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款,并提交基金申购申请的一种长期投资方式。

自上述代销之日起, 上述代销机构将新开通本公司旗下开放式基金诺德成长精选混合型基金的定投业务。目前,投资者申请办理基金定投业务,每期最低申购金额为人民币1元(含)。具体办理的业务规则和程序请遵循上述代销机构的有关规定。

三、转换业务

基金转换是指投资者在持有本公司发行和管理的任一开放式基金后,可将其持有的基金份额直接转换成本由公司管理且由同一注册登记机构办理注册登记业务的其它开放式基金的基金份额的一种业务模式。

自上述代销之日起, 上述代销机构将新开通本公司旗下开放式基金诺德价值优势混合型基金、诺德主题灵活配置混合型基金、诺德增强收益债券型基金、诺德成长优势混合型基金、诺德中小盘混合型基金、诺德优选30混合型基金、诺德周期策略混合型基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选混合型基金、诺德消费升级混合型基金的相互转换业务。基金转换业务的规则、费用及计算方法请参见各基金最新的招募说明书及本公司已刊登的各基金办理转换业务的相关公告。

四、费率优惠

自代销开始之日起,投资者申购以上指定基金享受申购费率优惠:

(一)投资者通过万得基金申购(含定期定额申购)本公司上述基金的(限前端收费模式),其申购费率享受不超过90%的折扣幅度,具体优惠折扣费率以万得基金安排为准。

(二)基金原费率请详见本公司发布的基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

(三)该费率优惠结束时间以万得基金公告为准。

上述费率优惠活动的解释权归万得基金所有。有关优惠活动的具体规定如有变化,以万得基金的最新公告为准,敬请投资者关注。

五、重要提示

1、上述业务仅适用于处于正常申(认)购赎回期的基金。基金封闭期等特殊期间的有关规定详见对应基金的基金合同和招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

2、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、上海万得基金销售有限公司

客服电话:400-821-0203

公司网址:www.520fund.com.cn

2、诺德基金管理有限公司

客服电话:400-888-0009

公司网站:www.nuodefund.com

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

诺德基金管理有限公司
2018年8月11日

诺德基金管理有限公司关于新增山西证券股份有限公司为旗下诺德新享灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告

一、基金代销

根据诺德基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与山西证券股份有限公司(以下简称“山西证券”)签署的代销协议,自2018年8月13日起,山西证券将新增代销本公司旗下诺德新享灵活配置混合型证券投资基金。具体基金信息如下:

序号	基金代码	基金名称
1	004987	诺德新享灵活配置混合型证券投资基金

二、定投业务

基金定期定额投资业务(以下简称“基金定投”)是指投资者可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请,约定每月扣款时间、扣款金额,由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款,并提交基金申购申请的一种长期投资方式。

自代销之日起, 上述代销机构将新开通本公司旗下诺德新享混合型基金的定投业务。目前,投资者申请办理基金定投业务,每期最低申购金额为人民币1元(含)。具体办理的业务规则和程序请遵循上述代销机构的有关规定。

三、转换业务

基金转换是指投资者在持有本公司发行和管理的任一开放式基金后, 可将其持有的基金份额直接转换成本由公司管理且由同一注册登记机构办理注册登记业务的其它开放式基金基金份额的一种业务模式。

自代销之日起,上述代销机构将新开通本公司旗下诺德价值优势混合型基金、诺德主题灵活配置混合型基金、诺德增强收益债券型基金、诺德成长优势混合型基金、诺德中小盘混合型基金、诺德优选30混合型基金、诺德周期策略混合型基金、诺德货币基金、诺德成长精选混合型基金、诺德消费升级混合型基金、诺德新享混合型基金的相互转换业务。基金转换业务的规则、费用及计算方法请参见各基金最新的招募说明书及本公司已刊登的各基金办理转换业务的相关公告。

四、重要提示

1、上述业务仅适用于处于正常申(认)购赎回期的基金。基金封闭期等特殊期间的有关规定详见对应基金的基金合同和招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

2、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、山西证券股份有限公司

客服电话:400-666-1618、95573

网址:www.i618.com.cn

2、诺德基金管理有限公司

客服电话:400-888-0009

公司网站:www.nuodefund.com

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

诺德基金管理有限公司
2018年8月11日

富兰克林国海安享货币市场基金暂停大额申购以及转换转入业务的公告

公告送出日期:2018年8月11日

1.公告基本信息

基金名称	富兰克林国海安享货币市场基金	
基金简称	国富安享货币	
基金主代码	004120	
基金管理人名称	国海富兰克林基金管理有限公司	
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《富兰克林国海安享货币市场基金基金合同》、《富兰克林国海安享货币市场基金招募说明书》的有关规定	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停大额申购起始日	2018年8月13日
	暂停大额转换转入起始日	2018年8月13日
	限制申购金额(单位:元)	10,000,000.00
	限制转换转入金额(单位:元)	10,000,000.00
	暂停大额申购、转换转入的原因说明	为保护基金份额持有人的利益,加强基金投资运作的稳定性

2.其他需要提示的事项

(1)在暂停本基金大额交易业务期间,单日每个基金账户的累计申购、转换转入业务的金额不应超过1,000万元,如单日每个基金账户的累计申购、转换转入业务的金额超过1,000万元(不含1,000万元),本公司将有权确认失败。

(2)本基金暂未开通定期定额投资业务。

(3)本基金暂停上述相关业务期间,本基金的转换转出、赎回等业务和本公司管理的其他开放式基金的各项交易业务照常办理。

(4)本基金取消或调整上述大额申购、转换转入业务限制的具体时间将另行公告。

(5)根据中国证监会《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字[2005]41 号)第十款的规定,当日申购的基金份额自下一工作日起享有基金的分配权益,当日赎回的基金份额自下一工作日起不享有基金的分配权益。

(6)本公司再次提示投资者合理安排投资计划,由此给投资带来的不便,敬请谅解!

(7)投资者可通过以下途径了解或咨询详请:

本公司网址:www.ftsfund.com

本公司客户服务电话:400-700-4518,95105680,021-38789555

本公司客户服务邮箱:service@ftsfund.com

(8)风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。购买货币市场基金不等于资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理公司不保证一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金前应认真阅读相关的基金合同和招募说明书等文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国海富兰克林基金管理有限公司
2018年8月11日

证券代码:002850　　证券简称:科达利　　公告编号:2018-045

深圳市科达利实业股份有限公司关于控股股东部分股权质押及解除部分股权质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市科达利实业股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)近日接到控股股东励建立先生、励建炬先生函告,获悉其对所持有的本公司部分股份进行了质押及解除了部分股权质押,具体事项如下:

一、股东股份质押的基本情况

公司控股股东励建立先生、励建炬先生因个人资金需求于2018年8月9日分别将其持有的公司股份200万股、211万股在华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)进行了股票质押式回购交易。本次质押情况如下:

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数(万股)	质押开始日期	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
励建立	是	200	2018-8-9	2020-6-5	华泰资管	2.49%	融资
励建炬	是	211	2018-8-9	2020-6-5	华泰资管	8.45%	融资

二、股东解除股份质押的基本情况

公司控股股东励建立先生、励建炬先生于2018年8月10日将其在万和证券股份有限公司(以下简称“万和证券”)质押的部分股份进行了解除质押。本次解除质押情况如下:

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	解除质押股数(万股)	质押开始日期	质押解除日	质权人	本次解除质押占其所持股份比例
励建立	是	273	2017-8-7	2018-8-10	万和证券	3.40%
励建炬	是	138	2017-8-7	2018-8-10	万和证券	5.53%

三、股东股份累计被质押的情况

截至公告披露日,励建立先生直接持有本公司股份 80,293,118股,占公司股份总数的38.23%;励建立先生累计质押公司股份7,624,098股,占其所持公司股份总数的9.50%,占公司股份总数的3.63%。

截至公告披露日,励建炬先生直接持有本公司股份24,964,401股,占公司股份总数的11.89%;励建炬先生累计质押公司股份6,069,470股,占其所持公司股份总数的24.31%,占公司股份总数的2.89%。

四、备查文件

1、股份质押登记证明;

2、其他文件。

特此公告。

深圳市科达利实业股份有限公司
董　事　会
2018年8月11日