嘉合货币市场基金招募说明书（更新）摘要

（2015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

二零一五年十二月

【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 2015 年 11月 6 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2015 年 9 月 30 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副总经理，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。

卢磴其先生，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。

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总监助理。

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投资经理。

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长办公室秘书。

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，简历同上。
李永梅女士，博士研究生，历任陕西省证监局稽查处主任科员、办公室副主任、稽查二处副处长，证监会上海专员办案件调查二处副处长，上海申乐实业控股集团有限公司副总经理。现任嘉合基金管理有限公司督察长。
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。

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4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。

李慧姻女士，同济大学经济学学士，上海财经大学金融学硕士，拥有7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。

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。
李永梅女士，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。

曹成生先，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总监助理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人情况

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9月末，中国工商银行资产托管部共有员工205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9月，中国工商银行共托管证券投资基金496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》、英国《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：陆凯杰
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：张婉婧
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：徐映绯
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

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2015年11月30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2015年9月30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	7,970,088,949.38	61.22
	其中：债券	7,970,088,949.38	61.22
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	—	—
	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	4,918,670,404.24	37.78
4	其他资产	129,898,200.58	1.00
5	合计	13,018,657,554.20	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	12.25
	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	2,079,995,320.00	19.02
	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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

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	12.43	19.02
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	14.01	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	40.89	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.37	—
4	90天(含)—180天	37.91	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.47	—
5	180天(含)—397天（含）	12.63	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		117.87	19.02

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	1,641,436,041.21	15.01
	其中：政策性金融债	1,641,436,041.21	15.01
4	企业债券	51,684,634.41	0.47
5	企业短期融资券	5,741,491,231.39	52.51
6	中期票据	535,477,042.37	4.90
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	7,970,088,949.38	72.89
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	92,078,086.24	0.84

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	110221	11国开21	7,000,000	699,499,117.55	6.40
2	011599192	15包钢集SCP003	3,000,000	302,303,980.91	2.76
3	011543003	15中核建SCP003	3,000,000	299,889,034.00	2.74
4	041566002	15淮南矿业CP001	2,800,000	282,849,118.97	2.59
5	090205	09国开05	2,600,000	260,976,772.68	2.39
6	130233	13国开33	2,600,000	260,342,147.61	2.38
7	011599280	15中普天SCP002	2,500,000	251,035,660.58	2.30
8	041566018	15淮南矿业CP003	2,500,000	249,829,846.21	2.28
9	041554008	15河钢CP001	2,000,000	202,531,696.54	1.85
10	011599124	15包钢集SCP002	2,000,000	201,507,787.53	1.84

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	0.1383%
报告期内偏离度的最低值	0.0059%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0918%

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	—
3	应收利息	129,898,200.58
4	应收申购款	
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	129,898,200.58

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2015年9月30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9月30日	1.1248%	0.0054%	0.5474%	0.0000%	0.5774%	0.0054%

2、嘉合货币B

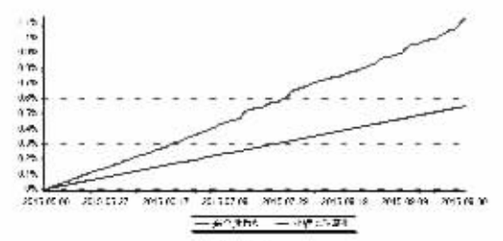
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年9月30日	1.2300%	0.0053%	0.5474%	0.0000%	0.6826%	0.0053%

（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

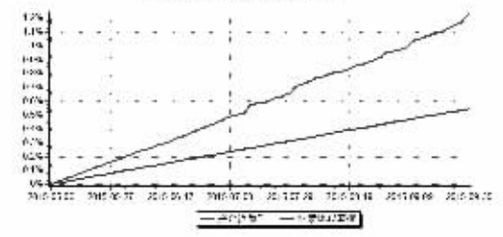
（2015年05月06日-2015年09月30日）



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-2015年09月30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个工作日向从基金财产中一次性支取。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付。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，增加了本基金合同的生效日期、招募说明书内容的截止日期以及相关财务数据的截止日期。
2、“第二部分 释义”根据法规进行了相应更新。
3、“第三部分 基金管理人”，“二、主要人员情况”根据实际情况进行了更新。
4、“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。
5、“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。
6、“第七部分 基金的募集”，更新了基金的募集时间。
7、“第八部分 基金合同的生效”，增加了有关基金合同正式生效及基金管理人正式开始管理本基金之时间的说明；删除了有关于基金备案的条件、基金合同不能生效时募集资金的处理方式的内容。
8、“第九部分 基金份额的申购与赎回”，更新申购、赎回开始日及业务办理时间。
9、“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2015年9月30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。
10、新增“第十一部分 基金的业绩”，对基金成立以来至2015年9月30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。
11、“第十四部分（原第十三部分） 基金的收益与分配”，收益分配方案更改为“本基金按日计算并分配收益，基金管理人不另行公告基金收益分配方案。”
12、新增“第二十三节 其他应披露事项”，其中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上披露的临时报告。

嘉合基金管理有限公司
二〇一五年十二月

证券代码：002726　证券简称：龙大肉食　公告编号：2015-066

山东龙大肉食品股份有限公司
关于使用自有闲置资金购买保本型理财产品进展的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

山东龙大肉食品股份有限公司（以下简称"公司"）于2015年8月17日召开的第二届董事会第十四次会议审议通过了《关于使用自有闲置资金购买保本型理财产品的议案》，同意公司及其子公司拟利用合计不超过人民币3亿元额度的自有闲置资金进行委托理财，购买保本型理财产品，在上述额度内资金可以循环滚动使用，有效期为董事会审议通过之日起12个月内。同时，授权公司财务部负责具体实施委托理财工作，授权宫明杰先生全权代表公司签署上述委托理财业务的有关合同及文件。独立董事、保荐机构对上述议案发表了独立意见、保荐意见。根据上述决议，公司于2015年12月15日使用自有资金人民币140,000,000元购买中国银行股份有限公司莱阳支行（以下简称"中国银行莱阳支行"）"中银保本理财-人民币按期开放"理财产品，现将有关情况公告如下：

一、委托理财投资的实施情况

1、产品名称："中银保本理财-人民币按期开放"理财产品
2、产品类型：保证收益型
3、产品代码：CNYAQKF
4、币种：人民币
5、投资范围：本理财产品募集资金由中国银行统一运作管理，投资对象包括：国债、中央银行票据、金融债；银行存款、大额可转让定期存单（NCD）、债券回购、同业拆借；高信用级别的企业债券、公司债券（含证券公司短期公司债券）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、非公开定向债务融资工具；投资范围为上述金融资产的券商资产管理计划、基金公司资产管理计划和信托计划；以及法律、法规、监管规定允许范围内的其他低风险高流动性的金融资产。其中债券资产投资比例为0-80%；同业拆借、债券回购、银行存款、大额可转让定期存单、券商资产管理计划、基金公司资产管理计划和信托计划等金融资产投资比例为10%-90%。中国银行可根据自行商业判断，独立对上述投资比例进行向上或向下浮动不超过十个百分点的调整。
6、购买理财产品金额：人民币140,000,000元
7、收益率：3.70%（扣除理财产品费用后可获得