

## 嘉实货币市场基金

## [2012] 第四季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2013年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2013年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内的财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实货币
基金主代码	070008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年3月18日
报告期末基金份额总额	24,973,361,023.47份

投资目标 力求资产的安全性和流动性，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

根据宏观经济指标决定债券组合的剩余期限和比例分布；根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例；根据债券的信用等级及担保状况决定组合的风险级别。

业绩比较基准 税后活期存款利率

本基金具有较高的风险、流动性的特征

基金管理人 嘉实基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

下属两级基金简称 嘉实货币A 嘉实货币B

下属两级基金代码 070008 070008

下属两级基金报告期末份额总额 10,065,789,464.12份 14,907,571,559.35份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日) 报告期(2012年12月17日 - 2012年12月31日)

嘉实货币A 嘉实货币B

1.本期已实现收益 168,610,459.91 19,321,193.43

2.本期利润 168,610,459.91 19,321,193.43

3.期末基金资产净值 10,065,789,464.12 14,907,571,559.35

4.27 财务指标

单利:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日) - 124

报告期末基金资产净值 134

报告期末基金资产净值 103

注:1.报告期内每日交易量及平均剩余期限均未超过180天。

5.3.2 报告期末基金资产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(%)

1 30天以内 21.99 8.41

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债 -

2 30天(含)-60天 9.12 -

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债 -

3 60天(含)-90天 22.44 -

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债 6.46 -

4 90天(含)-180天 29.25 -

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债 1.62 -

5 180天(含)-397天(含) 25.11 -

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债 -

6 397天以上 2,308,063,745.21 9.24

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债 -

合计 107.91 8.41

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 99,713,008.37 0.40

2 行业票据 - -

3 金融债券 3,085,468,822.01 12.36

其中:政策性金融债 3,085,468,822.01 12.36

4 企业债券 403,355,735.95 1.62

5 企业短期融资券 6,906,198,178.14 27.65

6 长城CPO01 3,106,000 1.24

7 其他债券 6,902,013,23 1.17

8 国开行CPO03 292,432,365.94 1.17

9 央行票据 2,800,000 1.12

10 央行票据 2,600,000 1.04

11 央行票据 2,500,000 1.00

12 央行票据 2,400,000 0.96

5.5 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

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100236 10国开36 1,612,275,349.92 6.46

2 120245 12国开45 4,700,000 1.88

3 04125103 12国银CPO01 4,100,000 140,000,124.46 1.64

4 058031 05中信债 4,060,000 403,355,735.95 1.62

5 04125401 12长城CPO02 3,100,000 310,156,256.01 1.24

6 090213 10国债13 2,900,000 292,432,365.94 1.17

7 04126003 12央债融 2,800,000 280,171,434.80 1.12

8 04125304 12国开CPO01 2,600,000 260,590,842.39 1.04

9 04125501 12央行票据 2,500,000 250,002,977.35 1.00

10 04127000 12国开票据 CPO03 2,400,000 240,366,308.34 0.96

5.6 影响“定价”与“摊余成本”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

报告期末偏离度的最高值 0.0092%

报告期内偏离度的最低值 -0.0878%

报告期内每个交易日偏离度的简单平均值 0.0323%

注:1.表中列示的是基金的成分债券的净值和折溢价,体现的是债券投资成本和在应收利息。

5.7 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资产支持证券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 00国开债 99,713,008.37 0.40

2 000002 00农发债 - -

3 000003 00中行票据 - -

4 000004 00国开行票据 - -

5 000005 00央行票据 - -

6 000006 00中行票据 - -

7 000007 00国开行票据 - -

8 000008 00农发债 - -

9 000009 00中行票据 - -

10 000010 00国开行票据 - -

5.8 报告期内基金资产净值的偏离情况

报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日) 嘉实货币A 嘉实货币B

5.9 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 年限

魏莉 基金经理 2009年1月16日 - 9年

本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

4.2 报告期内基金的销售情况

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部公平交易制度,各投资组合在投资决策及买卖时机选择上完全独立运作,并由风险管理部对各投资组合间的交易行为进行监控和分析,对各投资组合间的交易行为进行必要的限制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内涉及本基金的诉讼情况

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.6 报告期内基金绩效评价情况

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.8 管理人对估值方法的说明

4.9 其他需要说明的事项

注:1.报告期内本基金无其他重大影响的事项。

2.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

3.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

4.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

5.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

6.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

7.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

8.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

9.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

10.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

11.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

12.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

13.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

14.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

15.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

16.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

17.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

18.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

19.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

20.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

21.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

22.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

23.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

24.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

25.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

26.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

27.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

28.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

29.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

30.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

31.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

32.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

33.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

34.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。

35.本基金基金经理,深证证券从业资格,通过了基金从业人员资格考试。&lt;/