

嘉实安心货币市场基金

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。
 基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。
 基金管理人承诺以诚实信用、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,基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,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。

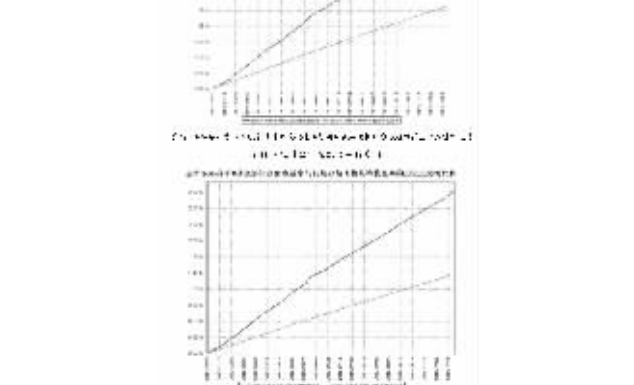
本报告期中的财务资料未经审计。
 本报告自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	嘉实安心货币
基金代码	070028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月28日
报告期末基金份额总额	2,394,420,733.03份
投资目标	通过对短期债券投资和保持较高流动性为优先目标,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金以确保资产安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。根据宏观经济指标和法定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敞口。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
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。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属二级交易代码	070028
下属二级基金报告期末份额总额	271,904,548.60份
	2,122,516,184.43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)
1. 本期已实现收益	306,291.44
2. 本期利润	306,291.44
3. 期末基金净值	271,904,548.60
注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本基金采用摊余成本法计价,公允价值变动收益为零。本期已实现收益和期末基金净值中的金额相等。2)嘉实安心货币A与嘉实安心货币B采用不同的估值费率。3)本基金及持有A类认购和交易基金的各项费用;4)本基金收益分配按结转份额。	
3.2 基金净值表现	
3.2.1 报告期末基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	0.6209%	0.0013%	0.4030%	0.0009%	0.2806%
过去一年	0.6811%	0.0013%	0.3403%	0.0009%	0.0013%
过去三年	0.6811%	0.0013%	0.3403%	0.0009%	0.0013%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较
 本基金投资于证券市场,基金净值增长率始终高于业绩比较基准,表现良好。



注:按基金合同约定,本基金基金合同生效日起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“四、投资组合范围”和“八、投资组合比例限制”的有关规定。

§4 基金经理	
姓名	职务
桑迎	基金基金经理、嘉实债券基金基金经理
任本基金的基金经理期限	2011年12月28日
任本基金的基金经理年限	8年
说明	曾任交通银行外汇交易员、华夏银行总行交易员。2008年1月加入嘉实基金管理有限公司,历任交易部债券交易员、固定收益部基金基金经理助理。银行与金融专业硕士,具有基金从业资格、中国国籍。

注:1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
 4.2 管理人对报告期内本基金基金运作遵规守信情况的说明
 报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

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,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

2012年四季度,本基金管理人严格执行了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 4.3.2 异常交易行为的专项说明
 报告期内,本基金不存在异常交易行为。
 4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 2012年四季度,央行延续了前期中性货币政策,以保持货币市场稳定为目标,以固定价格通过逆回购向市场释放流动性。4季度央行累计通过逆回购向市场投放31,790亿资金,票据到期2,590亿,但是由于逆回购为短期流动性调节,不停的到期再续,4季度不开市场实际净投放只有1,070亿。4季度由于央行在4月大力投放和央行在4月5日降准,而前期回购到期,因此前期流动性紧张,4季度流动性紧张上波动,均能稳定在4%左右。银行间市场短期利率方面,9个月央票利率在整个季度均维持在2.80-2.97%区间内小幅波动,信用产品方面,应债资金需求较大,但也是由于新增发行量较大,较大的供给量使短期融资利率一路上升。1年期AA级别短期融资利率10月份估值为4.2%,12月该级别短期融资利率上行至4.5%附近,1行幅度较大。总体而言,政府出于维护经济稳定的考虑,4季度货币政策实际保持中性,货币市场流动性紧张缓解。

作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和资本市场面情况,继续保持较高的流动性资产配置,谨慎控制组合的信用敞口,以应对利率上行和流动性紧张波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

§5 投资组合报告	
5.1 基金资产组合情况	
序号	项目
1	固定收益投资
其中:债券	249,784,699.01
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	其他资产
合计	2,965,465,566.60

5.2 报告期末债券回购融资情况
 报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。
 5.3 期末基金组合剩余期限
 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过75天。			
5.3.2 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	79.28	23.80
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.42	-
3	60天(含)-90天	0.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	7.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	1.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	91.18	23.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	
序号	债券品种
1	国债券种
2	央行票据
3	金融债
其中:政策性金融债	29,986,271.34
4	企业债
5	企业短期融资券
6	中期票
7	其他
合计	249,784,699.01
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10,023,266.57

注:上表中,国债债券的成本包括债券面值和折溢价,中期债券的成本包括债券投资成本和在应计利息。

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
1	1001042
2	1001037
3	129908
4	1001032
5	120238
6	110206
7	041254016
8	011201003

注:报告期末本基金仅持有上述三只债券。

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	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	0.0206%
报告期内偏离度的最低值	-0.0079%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0102%

5.7 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	
序号	债券代码
1	1001042
2	1001037
3	129908
4	1001032
5	120238
6	110206
7	041254016
8	011201003

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,939,678.65
4	应收申购款	778,402,683.93
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
合计		782,342,362.58

§6 开放式基金份额变动

项目	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
本报告期期初基金份额总额	54,524,549.75	697,296,345.04
本报告期基金总申购份额	375,208,072.66	1,195,224,807.84
减:本报告期基金总赎回份额	157,828,073.81	270,004,968.45
本报告期期末基金份额总额	271,904,548.60	2,122,516,184.43

7.1 备查文件目录	7.2 备查文件目录
1) 中国证监会批准嘉实安心货币市场基金募集的文件;	2) 嘉实安心货币市场基金基金合同;
3) 嘉实安心货币市场基金招募说明书;	4) 嘉实安心货币市场基金托管协议;
5) 基金管理人基金投资业务决策程序、投资授权;	6) 报告期内嘉实安心货币市场基金公告的各项原稿。
7.3 备查文件目录	7.4 备查文件目录
1) 中国证监会批准嘉实安心货币市场基金募集的文件;	2) 嘉实安心货币市场基金基金合同;
3) 嘉实安心货币市场基金招募说明书;	4) 嘉实安心货币市场基金托管协议;
5) 基金管理人基金投资业务决策程序、投资授权;	6) 报告期内嘉实安心货币市场基金公告的各项原稿。

注:1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
 4.2 管理人对报告期内本基金基金运作遵规守信情况的说明
 报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《非和值证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

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,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待所管理的所有投资组合。
 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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 报告期内,基金场内先跌后涨,总体出现较大幅度反弹市。上证指数大幅跑赢沪深300指数,而沪深300大幅跑赢中证500。

从经济方面看,我们认为:第一,国内宏观经济出现了复苏迹象,企业盈利出现显著回升,市场对银行资产质量和息差的担忧得到缓解,投资者的风险偏好改善;第二,改革预期加强,“十八大”尘埃落定,市场对改革继续推进的预期加强,新型城镇化政策主线清晰;第三,外围环境趋暖,美国推出QE3及欧债危机阶段性缓解使全球风险偏好上升。四季度后半期美国、欧洲、日本、韩国、香港等股市普遍涨幅较好。从资金面的供求状况看,我们发现对货币有利:第一,QFII-RQFII等资金流入增加,中长期增量资金效应,发掘低估值蓝筹板块配置价值;第二,企业首发及再融资速度的放缓,阶段性缓解了资金市场的压力。综观四季度,周期性板块大幅跑赢,其中银行、房地产、汽车、建材建材等板块表现较好,而消费和成长板块则由于业绩缺乏弹性、行业突发事件 催化及欧美土地风波、限售解禁压力、业绩下调等原因,明显表现较弱。

本基金报告期内继续超配地产、医药、传媒,增配了银行、水电等周期股,减持了部分小市值股票、LED行业、受行业突发事件影响的消费股。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
 截至本报告期末本基金份额净值为0.9211元,本报告期基金份额净值增长率为2.42%。
 4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 展望2013年第一季度,我们认为:第一,中国经济将呈现GDP增速低位缓慢回升,投资增速回升而出口增速依旧处于低位,就业压力将进一步显现,企业盈利虽将增长,但仍然在低位。第二,受制于央行换届和各级政府财政压力,实质性松放政策还难以看到;由于房价上涨,通胀预期开始回升,且央行顾虑上一轮刺激后巨大存量流动性对资产价格存在拉升的风险,因此货币政策偏紧的取向难以改变。第三,企业首发及再融资、大小非减持将继续对市场形成较大的供给压力。综合来看,我们认为市场下跌的压力不大,但短期内全面上行的动力也不足,市场将继续呈现结构性机会,为此,我们将继续维持较高仓位,继续

丰和价值证券投资基金

2012 第四季度报告

超配业绩弹性强的食品饮料、医药、软件、传媒等行业和早周期的银行、地产等行业,坚持精选个股。

§5 投资组合报告	
5.1 报告期末基金资产组合情况	
序号	项目
1	权益投资
其中:股票	2,032,409,381.81
2	固定收益投资
其中:债券	565,116,000.00
资产支持证券	-
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-
5	银行存款和结算备付金合计
6	其他资产
合计	2,7