

## 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

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、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、收益分配等信息，保证复核结果与本基金管理人计算的结果一致。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自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A  
基金代码:070028

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年12月28日

报告期末基金份额总额:3,394,420,733.03份

投资目标:以安全性、流动性和稳定性为优先目标,力求获得高于基准利率的稳定回报。

本基金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、政策调整和市场资金面情况,继续保持较高的流动性资产配置,谨慎控制组合的信用配置,以应对利率、信用风险和资产规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

## § 3 投资组合报告

## 5.1 基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况表

基金名称:嘉实安心货币A

基金代码:070028

基金总资产:2,965,465,566.60元

占基金总资产的比例(%):100.00

其中:固定收益投资:249,784,699.01元

占基金总资产的比例(%):8.42

其中:债券:249,784,699.01元

占基金总资产的比例(%):8.42

其中:货币支持证券:—元

占基金总资产的比例(%):—

其中:买断式回购的买入返售金融资产:1,212,000,000.00元

占基金总资产的比例(%):40.87

其中:买断式回购的买入返售金融资产:—元

占基金总资产的比例(%):—

其中:银行存款和结算备付金合计:721,338,505.01元

占基金总资产的比例(%):24.32

其中:其他资产:782,342,362.58元

占基金总资产的比例(%):26.38

合计:2,965,465,566.60元

占基金总资产的比例(%):100.00

5.2 报告期内债券回购融资情况

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均未超过资产净值的20%。

## 5.3 报告期内债券平均剩余期限情况

## 5.3.1 报告期内债券平均剩余期限基本情况

报告期末债券平均剩余期限:75天。

## 5.3.2 报告期末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(%) 天数

1 30天以内 79.28 23.80

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

2 30天(含)-60天 3.13 —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:0.42

3 60天(含)-90天 — —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

4 90天(含)-180天 7.10 —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

5 180天(含)-397天(不含) 1.25 —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

合计:91.18 天数:23.80

注:报告期末每日平均剩余期限均未超过75天。

## 5.3.3 报告期末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(%) 天数

1 30天以内 79.28 23.80

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

2 30天(含)-60天 3.13 —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:0.42

3 60天(含)-90天 — —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

4 90天(含)-180天 7.10 —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

5 180天(含)-397天(不含) 1.25 —

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:—

合计:91.18 天数:23.80

注:报告期末每日平均剩余期限均未超过75天。

## 5.3.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 39,884,512.49 1.67

2 行业票据 159,895,656.27 6.68

3 金融债券 29,986,271.34 1.25

其中:政策性金融债 29,986,271.34 1.25

4 企业债券 29,986,271.34 —

5 短期融资券 20,018,258.91 0.84

6 中期票据 — —

7 其他 — —

8 合计 249,784,699.01 10.43

其中:剩余期限超过397天的浮动利率债:10,023,266.57

9 利率债券 0.42 —

10 合计 249,784,699.01 10.43

注:报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

## 5.3.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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)

嘉实安心货币A 0.9945

嘉实安心货币B 0.9943

1.本期已实现收益 306,291.44

2.本期利润 2,428,923.41

3.期末基金资产净值 271,904,548.60

4.期末基金份额净值 2,122,516,184.43

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。②本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,以及赎回或卖出基金时产生的费用。

## 5.3.6 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)

嘉实安心货币A 0.9945

嘉实安心货币B 0.9943

1.本期已实现收益 -64,863,697.71

2.本期利润 65,511,597.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.0218

4.期末基金资产净值 2,763,315,904.48

5.期末基金份额净值 0.9211

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。②上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,以及赎回或卖出基金时产生的费用。

## 5.3.7 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

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)

嘉实安心货币A 0.9945

嘉实安心货币B 0.9943

1.本期已实现收益 -64,863,697.71

2.本期利润 65,511,597.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.0218

4.期末基金资产净值 2,763,315,904.48

5.期末基金份额净值 0.9211

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。②上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,以及赎回或卖出基金时产生的费用。

## 5.3.8 报告期基金份额净值历史走势对比图

图:嘉实安心货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

2011年12月28日至2012年12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(下同)的投资范围和投资比例限制。

§ 4 管理人报告

## 4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 在本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

桑迎 基金基金经理 2011年12月28 日 8年 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,所长助理兼债券交易员,固定收益总部经理助理。银行与金融市场硕士,具有基金从业资格,中银基金研究员。

注:①任职日期指基金经理开始担任本基金基金经理之日;②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的规定。

## 4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

报告期内,基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实安心货币基金合同》及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,不从事违法操纵市场、内幕交易等违法违规行为,充分保护基金持有人的利益。

本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定,无损益风险。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,基金管理人严格执行了《公平交易制度》、《公平交易操作流程》、《公平交易执行细则》、《公平交易定期评估报告》、《公平交易异常交易行为的专项检查》、《公平交易制度的定期评估报告》,未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,基金管理人严格按照《公平交易制度》、《公平交易操作流程》、《公平交易执行细则》、《公平交易定期评估报告》、《公平交易异常交易行为的专项检查》、《公平交易制度的定期评估报告》,未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4.2 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.3 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.4 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.5 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.6 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.7 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.8 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.9 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.10 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.11 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.12 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.13 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.14 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.15 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.16 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.17 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.18 报告期内基金的投顾策略和业绩表现的说明

4.4.19 报告期内