

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
送出日期:2014年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2014年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核后不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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及其摘要。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 嘉实货币市场基金

基金简称 嘉实货币

基金主代码 070008

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2005年3月18日

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

报告期末基金资产净值 31,002,760,333.95元

基金合同存续期 不定期

基金管理人对基金的管理费 0.02%760.333.95元

基金合同对基金的托管费 0.070008

报告期末下属分级基金的份额总额 11,848,817,584.37份

19,153,951,749.58份

2.2 基金产品说明

投资目标 力求资产的安全性和流动性，追求比业绩基准的稳定收益。

投资策略 根据宏观经济指标判断组合的剩余期限和分布比例，根据各资产的流动性特征决定投资组合的期限和分布比例。

业绩比较基准 纯洁活期存款

本基金具有较低风险、流动性特征的货币。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 嘉实基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 嘉实货币 嘉实货币

信息披露负责人 刘军电话 (010)62151588 9556

电子邮箱 service@fundchina.com

客户服务电话 400-609-8800 9556

传真 (010)6182266 (010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 http://www.fundchina.com

基金年度报告备置地点 北京市朝阳区北辰西路8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标 2013年 2012年 2011年

嘉实货币A 嘉实货币B 嘉实货币A 嘉实货币B 嘉实货币A 嘉实货币B

本期已实现收益 356,126,298.16 689,551,171.60 860,434,978.89 19,321,193,43 460,736,657.08

本期利润 356,126,298.16 689,551,171.60 860,434,978.89 19,321,193,43 460,736,657.08

本期末基金资产净值 4,129.99% 4,379.29% 4,164.60% 0.1456% 3.8274%

3.1.3 期末资产和负债 2013年末 2012年末 2011年末

期末基金总资产 11,848,817,584.37 19,153,951,749.58 10,065,789,464.12 14,907,571,559.35 20,123,294,778.97

期末基金总负债 1,000.00 1,000.00 1,000.00 1,000.00 1,000.00

期末基金净资产 1,000.00 1,000.00 1,000.00 1,000.00 1,000.00

3.1.4 期末利润指标 2013年末 2012年末 2011年末

累计净值增长率 31.2836% 4.5308% 26.0771% 0.1456% 21.0306%

注: (1) 2012年12月31日本基金管理人发布《关于嘉实货币市场基金实施基金份额分类修改基金合同、招募说明书、托管协议》的公告，自2012年12月17日起，本基金分为嘉实货币A、嘉实货币B，投资者可申购货币A，同时根据基金的分类原则予以升级或降级处理。(2) 本期间已实现收益指基金本期间收入，投资收益其收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期间为本期已实现收入加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期间的金额相等。(3) 嘉实货币A与嘉实货币B适用不同的销售服务费率。(4) 本基金无持有人认购/申购或交易基金的份额。(5) 本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金的表现

3.2.1 基金的净值表现及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实货币A

阶段 份额净值 收益率(%) 份额净值 收益率(%) 基金业比较基准 基金业比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.1296% 0.0030% 0.0881% 0.0000% 1.715% 0.0000%

过去六个月 0.2344% 0.0028% 0.1736% 0.0000% 2.1431% 0.0028%

过去一年 4.1299% 0.0035% 0.3500% 0.0000% 3.779% 0.0035%

过去二年 12.610% 0.0048% 1.2449% 0.0002% 11.373% 0.0046%

过去五年 16.421% 0.0039% 1.9752% 0.0002% 14.451% 0.0039%

自基金合同生效日起至今 31.2836% 0.0035% 8.5987% 0.00022% 22.6849% 0.0036%

嘉实货币B

阶段 份额净值 收益率(%) 份额净值 收益率(%) 基金业比较基准 基金业比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.1303% 0.0036% 0.0881% 0.0000% 1.3222% 0.0000%

过去六个月 0.2444% 0.0028% 0.1736% 0.0000% 2.2681% 0.0028%

过去一年 4.1299% 0.0035% 0.3500% 0.0000% 3.779% 0.0035%

过去二年 12.610% 0.0048% 1.2449% 0.0002% 11.373% 0.0046%

过去五年 16.421% 0.0039% 1.9752% 0.0002% 14.451% 0.0039%

自基金合同生效日起至今 31.2836% 0.0035% 8.5987% 0.00022% 22.6849% 0.0036%

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

图1:嘉实货币A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 (2005年3月18日至2013年12月31日)

图2:嘉实货币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 (2012年1月1日至2013年12月31日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第十五节(二、投资范围和八、投资限制)的规定:(1)投资组合的平均剩余期限不得超过180天;(2)投资比例于公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的30%;(3)存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;(4)除发生巨额赎回的情形外,债券正回购的基金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;(5)中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率与其同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实货币A

阶段 份额净值 收益率(%) 份额净值 收益率(%) 基金业比较基准 基金业比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.1296% 0.0030% 0.0881% 0.0000% 1.715% 0.0000%

过去六个月 0.2344% 0.0028% 0.1736% 0.0000% 2.1431% 0.0028%

过去一年 4.1299% 0.0035% 0.3500% 0.0000% 3.779% 0.0035%

过去二年 12.610% 0.0048% 1.2449% 0.0002% 11.373% 0.0046%

过去五年 16.421% 0.0039% 1.9752% 0.0002% 14.451% 0.0039%

自基金合同生效日起至今 31.2836% 0.0035% 8.5987% 0.00022% 22.6849% 0.0036%

嘉实货币B

阶段 份额净值 收益率(%) 份额净值 收益率(%) 基金业比较基准 基金业比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.1303% 0.0036% 0.0881% 0.0000% 1.3222% 0.0000%

过去六个月 0.2444% 0.0028% 0.1736% 0.0000% 2.2681% 0.0028%

过去一年 4.1299% 0.0035% 0.3500% 0.0000% 3.779% 0.0035%

过去二年 12.610% 0.0048% 1.2449% 0.0002% 11.373% 0.0046%

过去五年 16.421% 0.0039% 1.9752% 0.0002% 14.451% 0.0039%

自基金合同生效日起至今 31.2836% 0.0035% 8.5987% 0.00022% 22.6849% 0.0036%

3.2.4 基金合同生效以来基金累计净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势图 (2005年3月18日至2013年12月31日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第十五节(二、投资范围和八、投资限制)的规定:(1)投资组合的平均剩余期限不得超过180天;(2)投资比例于公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的30%;(3)存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;(4)除发生巨额赎回的情形外,债券正回购的基金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;(5)中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

3.2.5 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

嘉实货币A

年度 已披露收益形式 直接收益/应付税款 资本利得/损失 分配类型 年度利润 分配金额 备注

2013年 325,531,513.63 345,700,925.09 -3,792,148.40 15,316,296,296.18

2012年 741,340,088.64 8,289,085.79 860,434,976.89

2011年 375,427,294.95 643,595,297.72 20,954,068.41 460,736,657.08

合计 1,442,304,891.22 218,732,033.15 25,451,006.80 1,686,487,930.15

单位:人民币元

嘉实货币B

年度 已披露收益形式 直接收益/应付税款 资本利得/损失 分配类型 年度利润 分配金额 备注

2013年 92,699,534.41 25,528,840.00 689,551,171.60

2012年 26,023,137.53 4,532,686.36 -13,234,624.36 19,321,193.43

2011年 97,232,227.71 12,294,270.58 708,872,365.03

合计 309,345,934.68

单位:人民币元

基金管理人/基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理的简介

本基金基金管理人公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金

基金管理人之一,是中外合资基金管理公司,公司地址在北京设立,成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。