

# 嘉实安心货币市场基金

## 2014 第一季度报告

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:2014年4月22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2014年4月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。  
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当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2014年1月1日起至2014年3月31日止。

### §2 基金产品概况

基金名称	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	2011年12月28日
报告期末基金份额总额	1,668,931,452.86份
投资目标	具有风险控制投资风险的货币市场基金,力争获得高于业绩比较基准的增值收益。
投资策略	本基金以流动性高、安全性高、信用可靠、期限短、收益稳定的货币市场工具为主要投资对象,在严格控制投资风险的前提下,适当参与短期债券、中期票据、资产支持证券、金融衍生品等固定收益类资产的投资,以提高基金资产的整体收益水平。
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
本基金基金经理	嘉实安心货币A
本基金基金经理	070028
报告期末本基金基金经理	86,008,167.90份
报告期末本基金基金经理	1,582,923,284.96份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年1月1日—2014年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	637,515.77	5,060,609.77
2.本期公允价值变动收益	637,515.77	5,060,609.77
3.本期基金净值	86,008,167.90	1,582,923,284.96

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)上述基金净值指标不包括因基金份额拆分而产生的公允价值变动收益,计算净值增长率时,应考虑基金份额拆分的影响。  
(3)本基金无持有认购/申购交易费用产生的费用。(4)本基金收益分配按月结转份额。

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率和基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	1.0532%	0.0046%	0.3329%	0.0000%	0.7203%

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

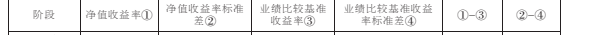


图1:嘉实安心货币A基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图2:嘉实安心货币B基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图3:嘉实安心货币C基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

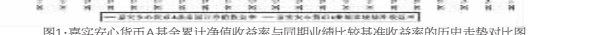


图4:嘉实安心货币D基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图5:嘉实安心货币E基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图6:嘉实安心货币F基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图7:嘉实安心货币G基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图8:嘉实安心货币H基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图9:嘉实安心货币I基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

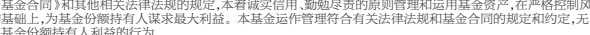


图10:嘉实安心货币J基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

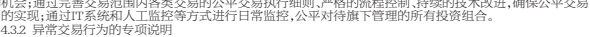


图11:嘉实安心货币K基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

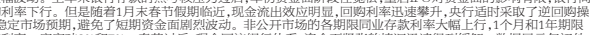


图12:嘉实安心货币L基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

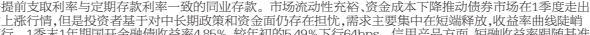


图13:嘉实安心货币M基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

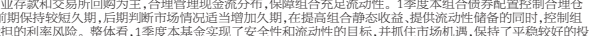


图14:嘉实安心货币N基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

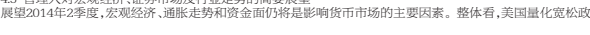


图15:嘉实安心货币O基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图16:嘉实安心货币P基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

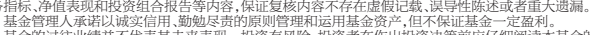


图17:嘉实安心货币Q基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

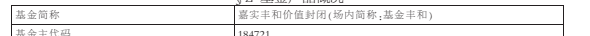


图18:嘉实安心货币R基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

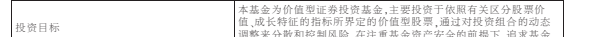


图19:嘉实安心货币S基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

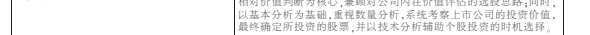


图20:嘉实安心货币T基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

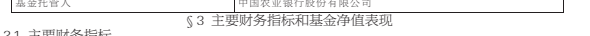


图21:嘉实安心货币U基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

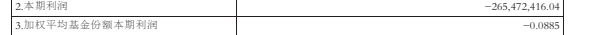


图22:嘉实安心货币V基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

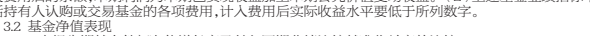


图23:嘉实安心货币W基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图24:嘉实安心货币X基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图25:嘉实安心货币Y基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图26:嘉实安心货币Z基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



策退出节奏已经逐步明朗,由此带来的影响将复杂;国内经济存在一定的下行压力,但通胀大概率将回到3%以上;人民币汇率改革也将加快推进,综合当前国内外整体经济和货币环境,预计央行将持续稳健的货币政策,并着力增强政策的弹性、针对性和灵活性,运用各类创新工具进行预期调控,未来将进一步推进利率市场化改革,并继续推进人民币汇率市场化改革,保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。  
本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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。  
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当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2014年1月1日起至2014年3月31日止。

### §2 基金产品概况

基金名称	嘉实策略增长
基金代码	070011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月12日
报告期末基金份额总额	5,399,241,287.63份
投资目标	通过有效的策略组合,为基金持有人创造较高的中长期资产增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,主要策略为积极成长策略,即在严格控制风险的前提下,适当参与短期债券、中期票据、资产支持证券、金融衍生品等固定收益类资产的投资,以提高基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为股票型基金,是证券投资基金中的高风险品种,本基金的风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
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
本基金基金经理	嘉实策略增长
本基金基金经理	070011
报告期末本基金基金经理	86,008,167.90份
报告期末本基金基金经理	1,582,923,284.96份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年1月1日—2014年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-117,199,546.00	-117,199,546.00
2.本期公允价值变动收益	-261,531,419.09	-261,531,419.09
3.本期基金净值	-378,730,965.09	-378,730,965.09

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)上述基金净值指标不包括因基金份额拆分而产生的公允价值变动收益,计算净值增长率时,应考虑基金份额拆分的影响。  
(3)本基金无持有认购/申购交易费用产生的费用。(4)本基金收益分配按月结转份额。

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率和基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	-8.29%	2.39%	-10.68%	2.39%	-8.29%

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图1:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

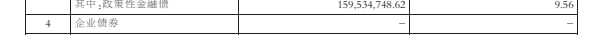


图2:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图3:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

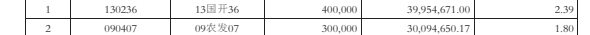


图4:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

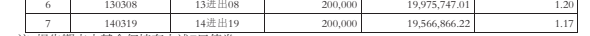


图5:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

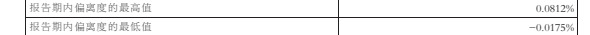


图6:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

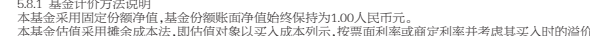


图7:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

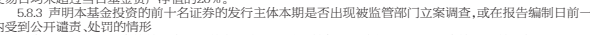


图8:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

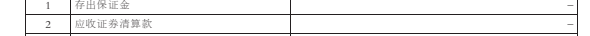


图9:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

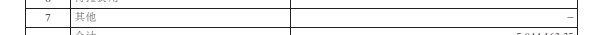


图10:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

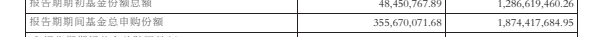


图11:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图12:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图13:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

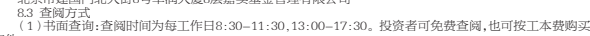


图14:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:

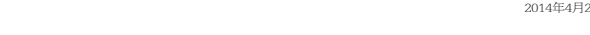


图15:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图16:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图17:嘉实策略增长基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图如下:



图18:嘉实策略增长基金份额净值