

嘉实安心货币市场基金

[2015] 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:2015年4月21日

基金合同生效后第一个工作日起至2015年3月31日止。

基金产品概况

基金简称	嘉实安心货币
基金主代码	070028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月31日
报告期末基金份额总额	3,922,973,560.00

投资目标 以有固定收益预期和风险相对较高稳定性为优先目标,力求获得高于银行存款的稳定收益。

投资策略 基金经理根据宏观经济形势及资金的期限配置资产,但不保证基金一定盈利。

基金经理在行业间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。

本报告期中无财务数据未经审计。

注:按有关规定,基金合同生效后六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投

资比例符合基金合同(十二)(一)投资范围和(八)投资组合比例限制的有关约定。

§3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)	
嘉实安心货币A	嘉实安心货币B	
1. 本期已实现收益	2,173,114.79	20,200,528.39
2. 本期利润	2,173,114.79	20,200,528.39
3. 期末基金资产净值	240,674,700.22	3,687,598,882.33

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核算,因此,公允价值变动收益为零。(2)嘉实安心货币A与嘉实安心货币B在费用适用上不同的费率收取。(3)本基金无持有人申购或赎回交易费用。(4)本基金无申购或赎回费用。

§3.2 基金份额净值

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④
过去三个月	0.9502%	0.0241%	0.3320%	0.0000%

注:(1)本基金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核算,因此,公允价值变动收益为零。(2)嘉实安心货币A与嘉实安心货币B在费用适用上不同的费率收取。(3)本基金无持有人申购或赎回交易费用。(4)本基金无申购或赎回费用。

§3.2.2 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	510,124,362.16	12.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,991,512.50	3.82
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		600,115,894.74	16.81

注:上图中,前10位债券的投资占比包括货币市场基金所列示的前10名债券投资明细。

§3.5 报告期未按摊余成本法计算基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发02	2,000,000.00	0.50
2	140213	14农发13	1,000,000.00	0.17
3	011690126	16电建SCP006	1,000,000.00	0.17
4	140429	14农发29	900,000.00	0.02
5	140212	14农发12	600,000.00	0.01
6	011690108	16电建SCP001	600,000.00	0.01
7	100236	10农开36	400,000.00	0.01
8	100230	10农开30	200,000.00	0.01

注:报告期末,本基金仅持有上述10只债券。

§3.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

单位:人民币元

项目	偏离情况
报告期内内购期内债到期的债券占20%(含)-30%的次数	0
报告期内内购期内债的最高值	0.0366%
报告期内内购期内债的最低值	0.0060%
报告期内内购期内债的简单平均值	0.0222%

注:报告期末,本基金管理人按公允价值对基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发02	2,000,000.00	0.50
2	140213	14农发13	1,000,000.00	0.17
3	011690126	16电建SCP006	1,000,000.00	0.17
4	140429	14农发29	900,000.00	0.02
5	140212	14农发12	600,000.00	0.01
6	011690108	16电建SCP001	600,000.00	0.01
7	100236	10农开36	400,000.00	0.01
8	100230	10农开30	200,000.00	0.01

注:报告期末,本基金管理人按公允价值对基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发02	2,000,000.00	0.50
2	140213	14农发13	1,000,000.00	0.17
3	011690126	16电建SCP006	1,000,000.00	0.17
4	140429	14农发29	900,000.00	0.02
5	140212	14农发12	600,000.00	0.01
6	011690108	16电建SCP001	600,000.00	0.01
7	100236	10农开36	400,000.00	0.01
8	100230	10农开30	200,000.00	0.01

注:报告期末,本基金管理人按公允价值对基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发02	2,000,000.00	0.50
2	140213	14农发13	1,000,000.00	0.17
3	011690126	16电建SCP006	1,000,000.00	0.17
4	140429	14农发29	900,000.00	0.02
5	140212	14农发12	600,000.00	0.01
6	011690108	16电建SCP001	600,000.00	0.01
7	100236	10农开36	400,000.00	0.01
8	100230	10农开30	200,000.00	0.01

注:报告期末,本基金管理人按公允价值对基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429	14农发02	2,000,000.00	0.50
2	140213	14农发13	1,000,000.00	0.17
3	011690126	16电建SCP006	1,000,000.00	0.17
4	140429	14农发29	900,000.00	0.02
5	140212	14农发12	600,000.00	0.01
6	011690108	16电建SCP001	600,000.00	0.01
7	100236	10农开36	400,000.00	0.01</td