

嘉实新金宝货币市场基金更新招募说明书摘要

2015年第1号

和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业水平、国际市场利率水平、汇率等），决定组合的平均剩余期限（长/中/短）和比例分布。

根据各类资产的流动性特征（主要包括：平均日交易量、交易频率、机构投资者持有情况、回购抵押数量等），决定组合中各类资产的投资比例。

根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别。

2、个券选择策略
在个券选择上，本基金通过定性定量方法，综合分析收益率曲线、流动性、信用风险、评估个券投资价值，发掘出具备相对价值的个券。

3、银行存款投资策略
本基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整体货币市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。

4、利用短期市场机会的灵活策略
由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其具体的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。

5、投资决策
(1) 决策依据
1) 国家有关法律、法规和本基金合同的相关规定。
2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；
3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

(2) 决策程序
1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的投资投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。

3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。

4) 交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。

5) 监察稽核部门负责监控基金的投资管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款税后利率

活期存款是具备最高流动性的存款，本基金期望通过科学严谨的管理，使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益，因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前2日在中国证监会指定媒体上刊登公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征
本基金为货币市场基金，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。

十一、基金投资组合报告
基金管理人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。

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月17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。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,384,333,433.74	42.29
	其中：债券	5,384,333,433.74	42.29
	资产支持证券	-	-
	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	7,226,459,960.90	56.75
4	其他资产	122,015,824.07	0.96
合计		12,732,809,227.71	100.00

2、报告期末债券回购融资情况

	其中：债券	5,384,333,433.74	42.29
	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	7,226,459,969.90	56.75
4	其他资产	122,015,824.07	0.96
	合计	12,732,809,227.71	100.00

注：(1) 报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例均为报告期内每日融资余额占基金资产净值的简单平均值。(2) 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%。

3、基金投资组合平均剩余期限

(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	118
投资组合内投资品种平均剩余期限最高值	119
最低值	87

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

(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	29.77	18.71
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	19.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.94	-
4	90天(含)-180天	18.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	180天(含)-397天(含)	29.47	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		117.63	18.71

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	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	720,624,406.05	6.72
	其中：政策性金融债	720,624,406.05	6.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,663,709,027.69	43.50
6	中期票据	-	-
7	合计	5,384,333,433.74	50.22
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	100,277,999.23	0.94

注：上表摊余成本包括债券的公允价值调整和折溢价，贴现债券的成本包括债券投资成本和内含应收利息。

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041553017	15宝通煤业CP001	5,000,000	500,000,290.38	4.66
2	10122006	15广信36	2,600,000	260,287,117.96	2.43
3	01552302	14CP02	2,000,000	200,000,143.40	1.87
4	041453118	14CP02	2,000,000	200,000,096.90	1.87
5	011415006	14中财债SCP006	2,000,000	199,937,709.85	1.87
6	011513001	15招商债SCP006	2,000,000	199,865,940.77	1.86
7	011537003	15中财债SCP003	1,900,000	189,528,704.15	1.77
8	041454043	14广信CP001	1,500,000	150,000,044.54	1.40
9	071524002	15东兴证CP002	1,500,000	149,964,988.18	1.40
10	041553006	15云天债CP001	1,500,000	149,939,050.10	1.40

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%期间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1873%
报告期内偏离度的最低值	0.0652%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1522%

7、报告期末按公允价值占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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注
(1) 基金计价方法说明
本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

(2) 若本报告期末货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

报告期内，本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

(3) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

(4) 其他资产构成

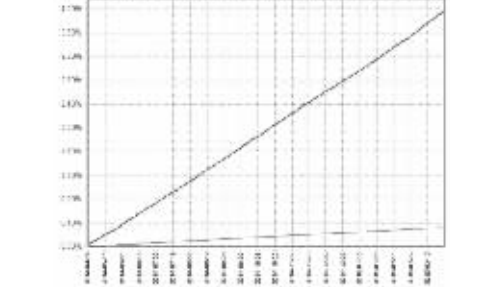
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	121,468,324.07
4	应收申购款	-
5	其他应收款	547,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
合计		122,015,824.07

十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 本报告期基金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	净值收益率①	净值收益率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
基金合同生效日至2014年3月31日	0.7140%	0.0035%	0.0603%	0.0000%	0.6537%	0.0035%
基金合同生效日至2014年12月31日	2.8480%	0.0019%	0.2367%	0.0000%	2.6113%	0.0019%
2015年1月1日至2015年3月31日	1.0979%	0.0017%	0.0862%	0.0000%	1.0117%	0.0017%

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：嘉实新金宝货币市场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对比图

(2014年4月29日至2015年3月31日)
注：本基金基金合同生效日2014年4月29日至报告期末未满1年。按基金合同及招募说明书的约定，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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

十三、基金的费用与税收
(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金费用的种类
(1) 基金管理人的管理费；
(2) 基金托管人的托管费；
(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
(4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费；
(5) 基金份额持有人大会费用；
(6) 基金的证券交易费用；

2. 基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1. 在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及与财务状况的截止日期。

2. 在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。

3. 在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。

4. 在“五、相关服务机构”部分：新增北京农商行为代销机构，并更新直销机构、相关代销机构信息。

5. 在“九、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合内容。

6. 增加“十、基金的业绩”：更新了2015年1季度的基金业绩。

7. 在“二十二、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2014年10月29日至2015年4月29日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2015年6月12日

嘉实超短债证券投资基金
2015年第五次收益分配公告
公告送出日期：2015年6月12日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实超短债证券投资基金
基金简称	嘉实超短债债券
基金代码	070009
基金合同生效日	2006年4月26日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《嘉实超短债证券投资基金基金合同》、《嘉实超短债证券投资基金招募说明书》
收益分配基准日	2015年5月31日
基准日基金份额净值(单位：元)	1.0387
截止分配基准日基金份额可供分配利润(单位：元)	3,590,173.06
目标的相关指标	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额(单位：元)
本次分红方案(单位：元/10份基金份额)	0.0470
有关年度分红次数的说明	本次分红为2015年的第五次分红

注：(1) 截止基准日按照基金合同约定的应分配金额计算的应分配金额为每份基金份额应分配金额0.0468元，即每10份基金份额应分配金额0.468元；(2) 本次分红方案为每10份基金份额发放红利0.047元。

2 与分红相关的其他信息

将其分红方式默认为现金方式，投资者可通过查询了解本基金目前的分红设置状态。

(5) 投资者可以在基金开放日的交易时间内到本基金销售网点修改分红方式。本次分红方式将按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准。投资者可以到销售网点或通过本公司确认分红方式是否正确，如不正确或希望修改分红方式的，敬请于2015年6月12日、6月15日到本基金销售网点办理变更手续。

(6) 投资者可以通过以下途径咨询了解本基金有关问题：

3 其他需要提示的事项
(1) 本次收益分配公告已经本基金托管人中国银行股份有限公司复核。

(2) 因本次分红导致基金净值变化，不会改变本基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

(3) 权益登记日当日，申请赎回及转换转出本基金的基金份额将享有本次分红权益，申请申购及转换转入本基金的基金份额将不享有本次分红权益。

(4) 如果投资者未选择具体分红方式，本公司注册登记系统将视其分红方式默认为现金方式，投资者可通过查询了解基金目前的分红设置状态。

(5) 投资者可以在基金开放日的交易时间内到本基金销售网点修改分红方式，本次分红方式将按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准。投资者可以到销售网点或通过本公司确认分红方式是否正确，如不正确或希望修改分红方式的，敬请于2015年6月12日，6月15日到本基金销售网点办理变更手续。

(6) 投资者可以通过以下途径咨询、了解本基金有关详情：
① 嘉实基金管理有限公司网站http://www.jsfund.cn，客户服务热线：400-600-8800。
② 基金代销机构：中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国民生

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司

重要提示
嘉实新金宝货币市场基金证券监督管理委员会《关于核准嘉实新金宝货币市场基金募集的批复》（证监许可[2014]375号）和2014年4月18日《关于嘉实新金宝货币市场基金募集时间安排的确认函》（证券投资基金监管部部函[2014]31号）的注册公开发售，本基金基金合同于2014年4月29日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对该基金合同的承认和接受，并依照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应仔细阅读基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年4月29日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日（未经审计）。

一、基金管理人
(一) 基金管理人基本情况

1. 基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期46层06-08单元
办公地址	北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人	邓红国
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.52亿元
股权结构	中诚信信托有限责任公司40%、德意志资产管理（亚洲）有限公司30%、立信投资有限公司30%
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
联系人	胡琴芳

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、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、QDII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何处罚记录。

(二) 主要人员情况
1. 基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策制度法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理部、银行监管司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司，获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

赵学军先生，董事，总经理，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司天津设计所，外贸部中国贸易进出口总公司，北京商品交易所，天津纺织原材料交易所，南鼎期货经纪有限公司，北京证券有限公司，大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

苗蔚先生，董事，学士学位，中共党员。曾任中诚信托有限责任公司国际业务部项目经理，投资管理部业务经理；2004年3月至今历任中诚信信托有限责任公司投资管理部业务经理、副经理、经理，投资总监兼投资管理部经理；现任中诚信信托有限责任公司投资总监、副总经理、公司党委书记。

Bernert Amtnung先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自1980年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management, London）全球战略与业务发展负责人，MD。

Mark Cullen先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官，MD。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官，MD。

韩家荣先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理专业，硕士研究生，1990年4月至2000年6月任海南证券投资有限公司总经理；1994年至今任北京德恒律师事务所主任/总经理；2001年1月至今任立信投资有限公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特汉姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行总行分行。曾任中国银行总行国际金融中心助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事。2004年至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事，中共党员，教授、机械工程系教师，清华大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械专业系主任，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授，清华大学法学院研究中心副主任，《清华法学》副主编，汤玛森路透集团“中国商法”论坛编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证监会监管委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市公司委员会、中国上市公司协会独立董事委员会前任主任。

李蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官，北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源部高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

宋薇娟女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行政管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理有限公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

戴京武女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大不列颠哥伦比亚大学MBA，历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券集团公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理，2008年7月起任公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学的法律系，北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所律师，新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任元国证券深圳证券信息总监，南方证券运营部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2. 基金经理
(1) 现任基金经理
魏巍女士，金融硕士，CFA，CPA，具有基金从业资格，12年证券从业经历。曾任职于国家开发银行国际金融部，中国银行银行分行投资部经理。2008年7月加盟嘉实基金管理有限公司，从事固定收益投资研究工作。2009年1月16日至至今任嘉实超短债债券基金经理。2009年1月16日至至今任嘉实货币市场基金经理。2013年12月19日起至今任嘉实天颐债券基金经理。2013年12月24日至至今任嘉实1个月理财债券基金经理。2014年4月2