

## 嘉实活钱包货币市场基金

### 2014 第三季度 报告

2014年9月30日

**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**  
**报告送出日期:2014年10月24日**

**1.1 重要提示**

基金管理人的董事会及董事承诺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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21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,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。

本报告期内基金未发生诉讼。

本报告自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

**5.2 报告期末货币市场融资情况**

序号	融资品种	余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	短期融资券	3,332	-
2	中期票据	-	-
3	其他	-	-
合计		3,332	-

**5.3 投资组合平均剩余期限**

5.3.1 投资组合平均剩余期限

5.3.2 投资组合平均剩余期限分布

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末投资组合余额	153,999,466.00	6.67
2	其中:买入返售金融资产	-	-
3	其中:买入返售金融资产-质押式回购	-	-

**5.4 报告期末按投资组合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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	160,128,532.27	6.84
4	企业债	161,128,532.27	6.84
5	企业短期融资券	696,456,808.03	29.50
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		1,017,715,872.57	43.78

**5.5 报告期末按行业分类的债券投资组合**

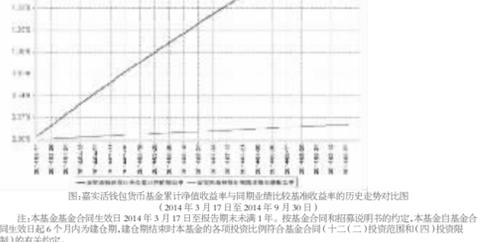
序号	行业名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	160,128,532.27	6.84
4	企业债	161,128,532.27	6.84
5	企业短期融资券	696,456,808.03	29.50
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		1,017,715,872.57	43.78

**5.6 "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%~0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0026%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均值	-0.0026%

**5.7 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**

序号	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140909	147	200.00	0.05



**4.1 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
万晓霞	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年3月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.2 基金经理**

注:(1)任职日期是指本基金基金经理离任之日;(2)证券从业的含义参照中国证监会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.3 基金经理变更**

报告期内,本基金基金经理变更如下:

2014年9月,本基金基金经理变更如下:原基金经理万晓霞女士因个人原因辞去基金经理职务,由王鹏先生接任。王鹏先生于2014年9月17日正式接替万晓霞女士担任本基金基金经理职务。王鹏先生于2014年9月17日正式接替万晓霞女士担任本基金基金经理职务。

**4.4 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.5 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.6 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.7 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.8 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.9 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**5.2 报告期末货币市场融资情况**

序号	融资品种	余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	短期融资券	3,332	-
2	中期票据	-	-
3	其他	-	-
合计		3,332	-

**5.3 投资组合平均剩余期限**

5.3.1 投资组合平均剩余期限

5.3.2 投资组合平均剩余期限分布

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末投资组合余额	153,999,466.00	6.67
2	其中:买入返售金融资产	-	-
3	其中:买入返售金融资产-质押式回购	-	-

**5.4 报告期末按投资组合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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	160,128,532.27	6.84
4	企业债	161,128,532.27	6.84
5	企业短期融资券	696,456,808.03	29.50
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		1,017,715,872.57	43.78

**5.5 报告期末按行业分类的债券投资组合**

序号	行业名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	160,128,532.27	6.84
4	企业债	161,128,532.27	6.84
5	企业短期融资券	696,456,808.03	29.50
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		1,017,715,872.57	43.78

**5.6 "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%~0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0026%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均值	-0.0026%

**5.7 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**

序号	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140909	147	200.00	0.05



**4.1 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.2 基金经理**

注:(1)任职日期是指本基金基金经理离任之日;(2)证券从业的资格参照中国证监会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.3 基金经理变更**

报告期内,本基金基金经理变更如下:

2014年9月,本基金基金经理变更如下:原基金经理万晓霞女士因个人原因辞去基金经理职务,由王鹏先生接任。王鹏先生于2014年9月17日正式接替万晓霞女士担任本基金基金经理职务。王鹏先生于2014年9月17日正式接替万晓霞女士担任本基金基金经理职务。

**4.4 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.5 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.6 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.7 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.8 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.9 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实活钱包货币市场基金基金经理	2014年9月17日	-	14年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

## 嘉实薪金宝货币市场基金

### 2014 第三季度 报告

2014年9月30日

**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**  
**报告送出日期:2014年10月24日**

**1.1 重要提示**

基金管理人的董事会及董事承诺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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21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,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。

本报告期内基金未发生诉讼。

本报告自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

**5.2 报告期末货币市场融资情况**

序号	融资品种	余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	短期融资券	3,332	-
2	中期票据	-	-
3	其他	-	-
合计		3,332	-

**5.3 投资组合平均剩余期限**

5.3.1 投资组合平均剩余期限

5.3.2 投资组合平均剩余期限分布

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末投资组合余额	1,034,598,686.70	16.39
2	其中:买入返售金融资产	-	-
3	其中:买入返售金融资产-质押式回购	-	-

**5.4 报告期末按投资组合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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	840,504,187.85	13.31
4	企业债	840,504,187.85	13.31
5	企业短期融资券	2,434,818,398.83	38.56
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		3,275,322,586.68	51.88

**5.5 报告期末按行业分类的债券投资组合**

序号	行业名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	840,504,187.85	13.31
4	企业债	840,504,187.85	13.31
5	企业短期融资券	2,434,818,398.83	38.56
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计		3,275,322,586.68	51.88

**5.6 "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%~0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0026%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均值	-0.0026%

**5.7 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**

序号	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100326	107	2,660.00	0.04
2	01415006	147	2,000.00	0.03
3	04154043	147	2,000.00	0.03
4	090235	107	2,660.00	0.04
5	01147003	147	2,000.00	0.03
6	07456003	147	2,000.00	0.03
7	07426007	147	2,000.00	0.03
8	140910	147	2,000.00	0.03
9	07431001	147	2,000.00	0.03
10	130306	132	6,600.00	0.10
合计			26,530,275.87	0.41

**5.8 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债券投资明细**

序号	债券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140909	147	200.00	0.05



**4.1 基金管理人(或基金基金经理)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	最近任职日期	证券从业资格	说明
王鹏	本基金基金经理、嘉实薪金宝货币市场基金基金经理	2014年4月29日	-	11年	曾任中国工商银行北京分行及资产管理部副经理,2008年加入嘉实基金管理有限公司,曾任嘉实货币基金经理,2013年12月加入嘉实基金资产管理部,2013年12月担任嘉实基金资产管理部副经理。

**4.2 基金经理**

注:(1)任职日期是指本基金基金经理离任之日;(2)证券从业的资格参照中国证监会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.3 基金经理变更**

报告期内,本基金基金经理变更如下:

2014年9月,本基金基金经理变更如下:原基金经理万晓霞女士因个人原因辞去基金经理职务,由王鹏先生接任。王鹏先生于2014年9月17日正式接替万晓霞女士担任本基金基金经理职务。王鹏先生于2014年9月17日正式接替万晓霞女士担任本基金基金经理职务。

**4.4 基金管理人(或基金基金经理)**