

(上接 C48 版)

Table listing various securities companies and their details, including company name, address, and contact information.

Table listing various securities companies and their details, including company name, address, and contact information.

(二) 注册登记机构

Table with columns: 名称, 住所, 办公地址, 法定代表人, 电话, 传真. Lists registration details for 嘉实基金.

(三) 律师事务所和经办律师

Table with columns: 名称, 住所, 办公地址, 负责人, 电话, 传真, 经办律师. Lists legal counsel details.

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

Table with columns: 名称, 住所, 办公地址, 法定代表人, 电话, 传真, 经办注册会计师. Lists audit firm details.

四、基金名称

本基金名称: 嘉实货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型: 契约型开放式

六、基金的投资目标

力求资产的安全性和流动性, 追求超过业绩比较基准的稳定收益。

七、基金的投资方向

本基金投资于如下的金融工具: 现金; 期限在一年以内(含一年)的银行定期存款、债券回购、中央银行票据、同业存单; 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

1. 整体资产配置策略 根据宏观经济指标(主要包括: 利率水平、通货膨胀率、GDP 增长率、货币供应量、就业水平、国际利率水平、汇率), 决定投资组合的剩余期限(长/中/短)和资产配置。

2. 流动性管理策略 根据各类型资产的流动性特征(主要包括: 平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量、分析转换进程), 决定组合中各类资产的投资比例。根据债券的信用等级及担保状况, 决定组合的风险级别。

3. 类别资产配置策略 根据整体策略要求, 决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。根据不同类型的资产的流动性指标(二级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变动量、交易场所), 决定类别资产的当期配置比率。根据不同类型的资产的收益率水平(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类别资产收益差异)、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金投资目标、业绩比较基准等决定不同类型的资产的目标配置比率。

3. 1 明确资产配置策略 第一步筛选, 根据明确资产的剩余期限、资信等级、流动性指标(流通总量、日均交易量), 决定是否纳入组合。第二步筛选, 根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比, 对组合基金的收益要求决定是否纳入组合。第三步筛选, 根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间), 决定投资总量。

九、基金的业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为: 税后活期存款利率(即活期存款利率 × (1 - 利息税率))

本基金管理人认为, 业绩的选择标准需要合理、透明, 为广大投资者所接受。本基金业绩基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益。

在合理的市场化利率基准推出的情况下, 本基金管理人可根据投资目标和投资策略, 确定变更业绩比较基准, 并及时公告。

十、基金的风险收益特征 本基金在证券投资基金中属于高流动性、低风险的品种, 其预期风险和预期收益都低于股票、债券和混合型基金。

十一、基金投资组合报告 基金管理人及基金托管人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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2020 年 1 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 2019 年 12 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

Table showing asset composition at the end of the reporting period, including categories like 固定收益投资, 买入返售金融资产, 银行存款, etc.

2. 报告期末债券回购融资情况

Table showing bond repurchase financing at the end of the reporting period, including 报告期末债券回购融资余额, 其中: 买断式回购融资.

注: (1) 报告期末债券回购融资余额为报告期末每日的融资余额合计数, 报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期末日融资余额占基金资产净值的比例简单平均值。(2) 报告期末本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 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

Table showing average remaining maturity of investment portfolio, including 报告期末投资组合平均剩余期限, 报告期末投资组合平均剩余期限最高值, etc.

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

Table showing distribution of average remaining maturity of investment portfolio, including 30 天以内, 30 天(含)-60 天, etc.

4. 报告期末投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond investment portfolio by category, including 国家债券, 央行票据, 金融债券, etc.

注: 上表中, 附息债券的成本包括债券面值和折溢价, 贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应计利息。

6. 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

Table showing top 10 bond investments by摊余成本占基金资产净值比例, including 1 11905244, 2 111989087, etc.

7. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table showing deviation between shadow pricing and amortized cost method, including 项目, 偏离情况.

报告期内每个交易日偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5%区间内次数 0

报告期内偏离度的最高值 0.0592%

报告期内偏离度的最低值 0.0029%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0222%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 报告期内每个交易日偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

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资产支持证券投资明细 无。

9. 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, 按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价, 在其剩余期限内摊销, 每日计提收益或损失。

(2) 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、处罚的情形。如是, 还应对相关证券的投资决策程序做出说明 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。

(3) 其他资产构成 无。

Table showing performance metrics for 嘉实货币 A, including 序号, 名称, 金额(元).

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。投资者在进行投资决策前, 应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较 嘉实货币 A

Table comparing historical returns of 嘉实货币 A with benchmark returns across different periods.

嘉实货币 B

Table comparing historical returns of 嘉实货币 B with benchmark returns across different periods.

嘉实货币 E

Table comparing historical returns of 嘉实货币 E with benchmark returns across different periods.

(二) 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 基金自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的历史走势图对比图



图 2: 嘉实货币 B 基金自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的历史走势图对比图

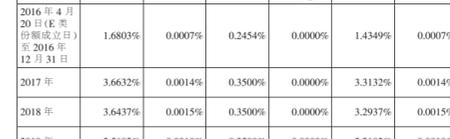


图 3: 嘉实货币 E 基金自合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势图对比图