

(上接C39版)

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资... 7 报告期末未持有资产支持证券... 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细...

11.1 报告期内基金投资的前十名证券除 19 国开 06 (证券代码 190206)、19 国开 10 (证券代码 190210)、19 农发 04 (证券代码 190404)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查... 11.2 对上述证券的投资决策程序的说明:本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求...

11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 其他资产, etc.

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 中信转债, 国债, 可转债, etc.

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明... 11.6 报告期末未持有股票

Table with 3 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 2018.11.02-2018.12.31, etc.

招商金鸿债券 C:

Table with 3 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 2018.11.02-2018.12.31, etc.

注:本基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日。 14.1 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.基金销售服务费; 4.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费及仲裁费; 6.基金份额持有人大会费用; 7.基金的证券、期货交易费用; 8.基金的银行汇划费用; 9.基金开户及支付费用; 10.货币经纪服务费(若有); 11.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 14.2 基金费用的计提方法、计提标准和支付方式 1.基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.70%÷当年天数 H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值 基金管理人应于每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划款指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。 2.基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.10%÷当年天数 H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值 基金管理人应于每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。 3.C 类基金份额的销售服务费 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。 销售服务费计提的计算公式如下: H=E×0.30%÷当年天数 H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值 基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划款指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。 4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。 14.3 基金费用的调整 本基金运作过程中涉及的各项纳税义务,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 14.4 基金费用的变更 1. 基金管理人和基金托管人未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; 2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; 3. 《基金合同》生效前的相关费用; 4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。 14.5 与基金销售有关的费用 1. 申购费用 本基金申购 A 类基金份额需缴纳申购费,C 类基金份额不收取申购费用。本基金采用前端收费方式,A 类基金份额的申购费率如下表。投资者在一天之内如果有多次申购,费率按单笔计算。 申购金额(M) A 类基金份额申购费率 M<100 0.80% 100 元<=M<300 0.50% 300 元<=M<500 0.30% M>=500 0.20% 注:1000 元 本基金的申购费用由 A 类基金份额的投资者承担,不列入基金资产,用于基金的销售、登记等各项费用。 净申购金额=申购金额/(1+申购费率),或净申购金额=申购金额-固定申购费金额 申购费用=申购金额-净申购金额,或申购费用=固定申购费金额 申购费用以人民币元为单位,计算结果保留到小数点后第 2 位,小数点后第 3 位开始舍去,舍去部分归基金财产。 2. 赎回费用 注:根据本基金发行文件规定,本基金每次收益分配比例不低于基准日基金可供分配利润的 20%。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=基准日基金可供分配利润*20%。 2. 与分红相关的其他信息

本基金 A 类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减,费率如下表:

Table with 2 columns: 持有期限(N), 赎回费率. Rows include 0<=N<7天, 7天<=N<30天, 1年<=N<2年, N>=2年.

(注:1 年指 365 天,2 年为 730 天,依此类推) 赎回费用的计算方法:赎回费用=赎回份额×赎回受理当日 A 类基金份额净值×A 类基金份额赎回费率 赎回费用以人民币元为单位,计算结果保留到小数点后第 2 位,小数点后第 3 位开始舍去,舍去部分归基金财产。 A 类基金份额的赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。 如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动,本基金将依新法规进行修改,不需召开持有人大会。 C 类基金份额不收取认购、申购费,赎回费用如下:

Table with 2 columns: 持有期限(N), 赎回费率. Rows include 0<=N<7天, 7天<=N<30天, N>=30天.

赎回费用的计算方法:赎回费用=赎回份额×赎回受理当日 C 类基金份额净值×C 类基金份额赎回费率 赎回费用以人民币元为单位,计算结果保留到小数点后第 2 位,小数点后第 3 位开始舍去,舍去部分归基金财产。 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取。对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。 如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动,本基金将依新法规进行修改,不需召开持有人大会。 3. 转换费用 (1) 各基金间转换的总费用包括转出基金的赎回费用和申购补差费用两部分。 (2) 每笔转换申请的转出基金额,收取转出基金的赎回费,赎回费根据相关法律法规及基金合同、招募说明书的规定收取,并根据上述规定按后归入基金财产。 (3) 每笔转换申请的转入基金额,申购补差费用(费用)指转出基金转换时,收取转入基金与转入基金的申购费用差额;申购补差费用按照转入基金转换所对应的申购费率(费用)档次进行补差计算。从申购费率(费用)向低档的基金转换时,不收取申购补差费用。

招商基金管理有限责任公司 2020 年 6 月 13 日 招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年度第二次分红公告 公告送出日期:2020 年 6 月 13 日

1、公告基本信息

Table with 2 columns: 基金名称, 招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金; 基金简称, 招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式; 基金代码, 002756; 基金管理人名称, 招商基金管理有限公司; 基金托管人名称, 兴业银行股份有限公司; 收益分配基准日, 2020 年 6 月 10 日; 有关年度分红次数的说明, 本次分红为 2020 年度的第二次分红; 基金份额类别, 招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 A 类基金份额, 招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 C 类基金份额; 基准日基金份额净值(单位:人民币元), 1.1032; 1.1017; 截至收益分配基准日(单位:人民币元)的可供分配利润, 137,672,600.62; 727.58; 截至收益分配基准日(单位:人民币元)的未分配利润, 27,534,520.13; 145.52; 本次下阶段基金份额分红方案(单位:元/10 份基金份额), 0.144; 0.144.

Table with 2 columns: 权益登记日, 2020 年 6 月 16 日; 除息日, 2020 年 6 月 16 日; 现金红利发放日, 2020 年 6 月 17 日; 分红对象, 权益登记日在登记在册的本基金份额持有人; 红利再投资相关事项的说明, 1. 选择红利再投资的投资者其类别基金份额的基金份额净值日为 2020 年 6 月 16 日; 2. 红利再投资的基金份额(赎回)截止日: 2020 年 6 月 18 日;

3. 其他需要提示的事项 3.1 权益派发提示 1) 选择现金分红的投资者的红利款将于 2020 年 6 月 17 日自基金托管账户划出。 2) 选择红利再投资分红的投资者所转换的基金份额将于 2020 年 6 月 17 日直接计入其基金份额,并自 2020 年 6 月 17 日起计算开始分红。 2020 年 6 月 18 日起投资者可以查询、赎回。 3) 权益登记日之前办理了转出基金份额尚未办理转出转入的投资者,其分红方式一律按照原基金份额再投资处理,所转出基金份额经转出转入确认后与红利再投资所得份额一并计入基金份额。 3.2 提示: 1) 权益登记日以后(含权益登记日)申请申购、转换转入的基金份额不享有本次分红权。 2) 本次分红现金方式按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方式进行。投资者如需修改分红方式,请务必在权益登记日之前的工作日(即 2020 年 6 月 15 日 15:00 前)登陆销售网点办理变更手续,投资者权益登记日前一个工作日(即 2020 年 6 月 14 日)下午 15:00 前提交的修改分红方式的申请将无法完成分配。对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式为现金分红。 3.3 咨询办法: 1) 招商基金管理有限公司客户服务中心电话:400-887-9555(免长途话费)。 2) 招商基金管理有限公司网站:www.cmfn.com.cn。 3) 招商基金管理有限公司直销网点及本基金各代销机构的相关网点(详见本基金招募说明书及相关资料)。

(上接 C38 版)

(二) 注册登记机构 名称: 嘉实基金管理有限公司 住所: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 层 09-14 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: 邵健 联系人: 郭彤 电话: 010-65215588 010-65185678 (三) 律师事务所和经办律师 名称: 国浩律师集团(北京)事务所 住所/办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 38 号泰康金融大厦 9 层 负责人: 王卫东 联系人: 黄伟民 电话: 010-65068066 010-65176801 (四) 会计师事务所和经办注册会计师 名称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) 住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号展业大厦 507 单元 01 室 办公地址: 中国上海市黄浦区南苏州路 202 号顺泰广场二座 20 层 法定代表人: 李丹 联系人: 周伟 电话: 021-23238888 021-23238800 5. 基金的投资目标 力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。 六. 基金的投资方向 本基金投资于如下金融工具: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具有良好流动性的货币市场工具。 七. 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),决定债券组合的剩余期限(长/中/短)和比例分布。 根据各类资产的流动性特征(主要包括:日均交易量、交易所、机构投资者持仓情况、回购到账数、券种转换情况),决定组合中各类资产的投资比例。 根据债券信用等级及担保状况,决定组合的风险等级。 2. 类别资产配置策略 根据投资策略要求,决定组合中类别资产的配置区间和各类别资产的比例。 根据不同类型的流动性指标(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、交易所),决定类别资产的当期配置比例。 根据不同类型的收益率水平(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息处理、附加选择权价值、类别资产收益差异)、市场偏好、法律法规对目标配置的规范、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类型的资产的目标配置比例。 3. 明细资产配置策略 第一步筛选,根据明组合的剩余期限、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、利息处理方式)与剩余期限的配比,对照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),决定投资仓位。 八. 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)) 九. 基金的风险收益特征 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。本业绩基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。 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 本基金在债券类资产中属于中高风险、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. 基金投资组合情况 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。 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”),本报告所列投资组合数据未经审计。 1. 报告期末基金资产组合情况 2. 报告期末债券回购融资情况 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 4. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 5. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 6. 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进行说明 报告期末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 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,投资者投资时应认真阅读投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。 (一) 历史各阶段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较 嘉实货币 A 嘉实货币 B

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 with 3 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例(%), 各期限负债占基金资产净值的比例(%). Rows include 30 天以内, 30 天以上, etc.

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 111905244, 19 建设银行 CD244, 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含应收利息。

6. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 111905244, 19 建设银行 CD244, 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 with 2 columns: 项目, 偏离情况. Rows include 报告期内偏离度的绝对值在 0.25%~0.5% 间的次数, 报告期内偏离度的最高值, etc.

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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进行说明 报告期末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

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 应收申购款, 其他资产, etc.

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,投资者投资时应认真阅读投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。 (一) 历史各阶段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较 嘉实货币 A 嘉实货币 B

Table with 3 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 2005 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日, etc.

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 应收申购款, 其他资产, etc.

嘉实货币 B

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 with 3 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例(%), 各期限负债占基金资产净值的比例(%). Rows include 30 天以内, 30 天以上, etc.

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 111905244, 19 建设银行 CD244, 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含应收利息。

6. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 111905244, 19 建设银行 CD244, 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 with 2 columns: 项目, 偏离情况. Rows include 报告期内偏离度的绝对值在 0.25%~0.5% 间的次数, 报告期内偏离度的最高值, etc.

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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进行说明 报告期末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

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 应收申购款, 其他资产, etc.

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,投资者投资时应认真阅读投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。 (一) 历史各阶段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较 嘉实货币 A 嘉实货币 B

Table with 3 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 2012 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日, etc.

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 应收申购款, 其他资产, etc.

嘉实货币 B

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 with 3 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例(%), 各期限负债占基金资产净值的比例(%). Rows include 30 天以内, 30 天以上, etc.

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 111905244, 19 建设银行 CD244, 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含应收利息。

6. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 111905244, 19 建设银行 CD244, 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 with 2 columns: 项目, 偏离情况. Rows include 报告期内偏离度的绝对值在 0.25%~0.5% 间的次数, 报告期内偏离度的最高值, etc.

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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进行说明 报告期末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

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 应收申购款, 其他资产, etc.

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,投资者投资时应认真阅读投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。 (一) 历史各阶段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较 嘉实货币 A 嘉实货币 B

Table with 3 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 2012 年 12 月 17 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日, etc.

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 存出保证金, 应收证券清算款, 应收利息, 应收申购款, 其他资产, etc.

嘉实货币 B