

嘉实货币市场基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

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：2011 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2011 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 审计报告	13
§ 7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§ 8 投资组合报告	35

8.1 期末基金资产组合情况	35
8.2 债券回购融资情况	35
8.3 基金投资组合平均剩余期限	36
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
8.5 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	37
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	37
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	37
8.8 投资组合报告附注	37
§ 9 基金份额持有人信息	38
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	38
§ 10 开放式基金份额变动	38
§ 11 重大事件揭示	39
11.1 基金份额持有人大会决议	39
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	39
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
11.4 基金投资策略的改变	39
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	39
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	40
11.9 其他重大事件	40
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实货币市场基金
基金简称	嘉实货币
基金主代码	070008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 3 月 18 日
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
报告期末基金份额总额	11,450,474,064.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	根据宏观经济指标决定债券组合的剩余期限和比例分布；根据各类资产的流动性特征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。
业绩比较基准	税后活期存款利率
风险收益特征	本基金具有较低风险、流动性强的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	唐州徽
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594855
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942
注册地址		上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		王忠民	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层 嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	159,430,927.80	129,173,659.48	719,196,411.48
本期利润	159,430,927.80	129,173,659.48	719,196,411.48
本期净值收益率	1.9870%	1.3683%	4.3646%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末基金资产净值	11,450,474,064.27	21,875,563,297.47	36,778,234,782.21
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
累计净值收益率	16.5743%	14.3032%	12.7604%

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，本期已实现收益和本期利润的金额相等。(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；(3)本基金收益分配按月结转份额。

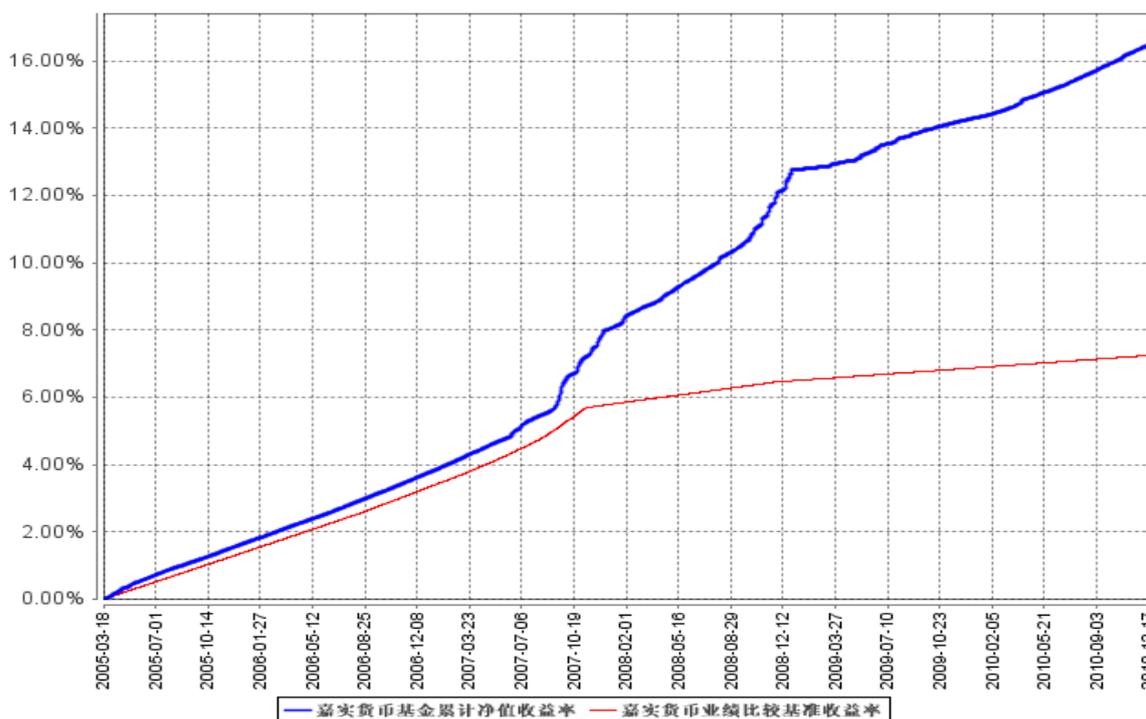
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5688%	0.0034%	0.0906%	0.0000%	0.4782%	0.0034%
过去六个月	1.1255%	0.0026%	0.1813%	0.0000%	0.9442%	0.0026%
过去一年	1.9870%	0.0041%	0.3600%	0.0000%	1.6270%	0.0041%
过去三年	7.8946%	0.0112%	1.3857%	0.0004%	6.5089%	0.0108%
过去五年	14.6306%	0.0101%	5.7589%	0.0025%	8.8717%	0.0076%
自基金合同生效起至今	16.5743%	0.0096%	7.2634%	0.0024%	9.3109%	0.0072%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实货币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

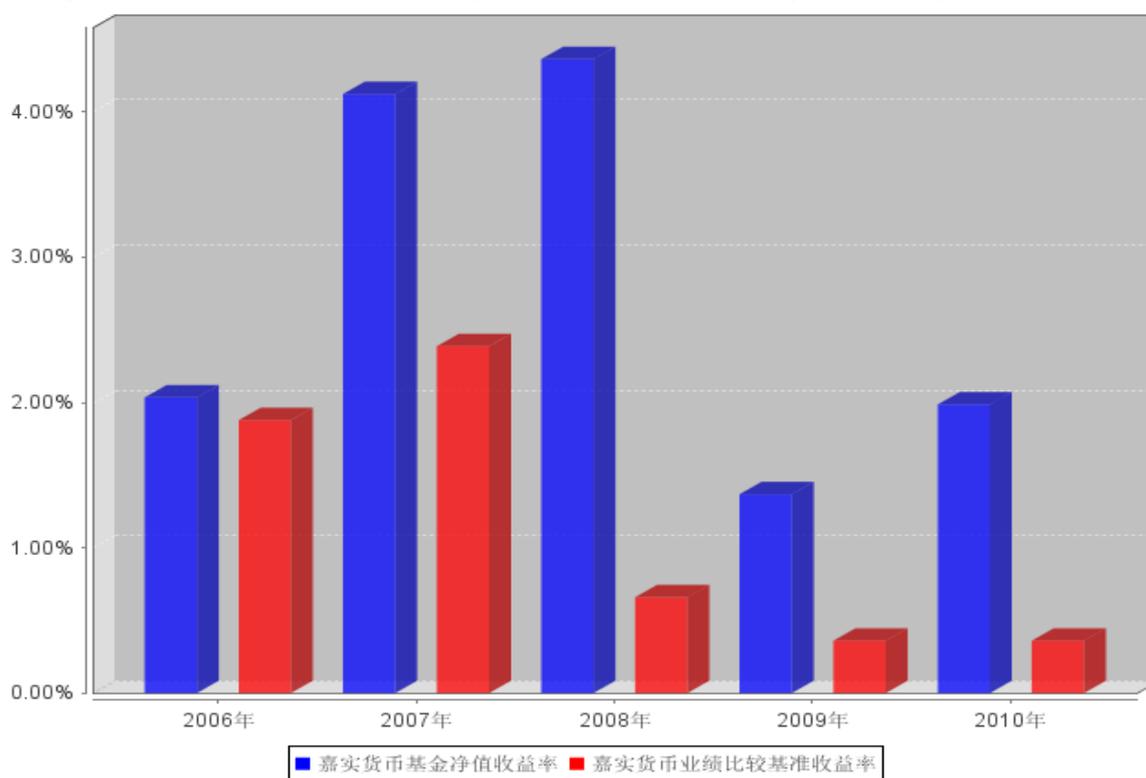


注 1: 按基金合同规定, 本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第十五节(二、投资范围和八、投资限制)的规定: (1) 投资组合的平均剩余期限不得超过 180 天; (2) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%; (3) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 30%; 存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%; (4) 除发生巨额赎回的情形外, 债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%; (5) 中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

注 2: 2010 年 3 月 11 日, 本基金管理人发布《关于调整嘉实货币和嘉实超短债债券基金经理的公告》, 吴洪坚先生不再担任嘉实货币市场基金基金经理职务, 嘉实货币市场基金由现任基金经理魏莉女士管理。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实货币过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2010年	136,977,288.90	18,476,048.55	3,977,590.35	159,430,927.80	
2009年	181,416,330.47	34,591,567.59	-86,834,238.58	129,173,659.48	
2008年	571,238,488.68	71,079,842.26	76,878,080.54	719,196,411.48	
合计	889,632,108.05	124,147,458.40	-5,978,567.69	1,007,800,998.76	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地在上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截至 2010 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、21 只开放式基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金基金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴洪坚	本基金经理	2006年5月10日	2010年3月11日	8年	曾任职于中国银行交易中心（上海），从事人民币固定收益投资及交易等工作。2005年加入嘉实基金管理有限公司固定收益部工作，曾任嘉实货币市场基金基金经理助理，嘉实超短债债券基金经理。清华大学工学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。
魏莉	本基金经理、嘉实超短债债券基金经理	2009年1月16日	-	8年	曾任职于国家开发银行国际金融局，中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作。金融硕士，CFA，CPA，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期内，嘉实货币市场基金基金份额净值收益率为 1.9870%，投资风格相似的嘉实超短债债券基金份额净值增长率为 1.57%。主要原因：嘉实货币市场基金持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值；嘉实超短债债券基金持有的债券（包括票据）采用公允价值估值。报告期内债券市场出现大幅波动，超短债业绩中包含了部分市场估值波动损失。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年，中国经济继续保持平稳较快发展，整体运行态势良好。配合货币信贷增长从高位向常态回归的目标，央行适度宽松的货币政策自年初开始有所调整，提高存款准备率，重启三年期央票发行。但整体看来，截至 3 季度末，银行体系流动性整体仍保持充裕，资金成本维持较低水平，各投资机构的债券需求持续旺盛，期间债市虽有所波动，但整体呈现不断上涨态势。但 4 季度开始，通胀持续上行，达到超预期的 5.1% 高位。央行正式结束了前期适度宽松的货币政策，释放紧缩信号，当季两次上调存贷款利率，三次上调存款准备金率。在通胀高企和流动性收紧的双重压力下，债市大幅下挫，收益率曲线整体持续上行。接近年末，又叠加了银行贷存比指标考核、留存备付等因素影响，市场流动性极度紧张，资金成本不断跳升，银行间 7 天回购利率一度攀升至 6%，1 年和 3 年央票二级市场收益率分别升至 3.6% 和 3.8%。信用产品方面，短融收益率水平基本跟随基准利率走势，年内先降后升。年末主体 AAA 级的短期融资券收益率超过 4%，较 09 年末上升超过 120 个基点，其它信用级别也都出现类似的收益率上行。

报告期内，本基金秉持稳健投资原则，深入分析宏观经济走势，谨慎把握政策方向，灵活调整投资策略，在确保组合安全性和流动性的前提下，努力提高组合整体投资收益。组合整体保持中性偏短久期。把握月末、季末和大盘新股发行等关键时点市场利率变化的节奏，按计划调整持仓结构，在利率上行前减持了部分券种，适时兑现投资收益；确保组合流动性，提高组合弹性空间，顺利应对规模波动；在市场收益较高时开展逆回购操作，提高组合投资收益。信用产品方面，本基金在严格控制信用风险和持仓比例的前提下，平衡配置高流动性和高票息品种，提高组合静

态收益。通过上述操作，报告期内组合取得较好投资业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0000 元；本报告期基金份额净值收益率为 1.9870%，业绩比较基准收益率为 0.3600%，本报告期基金份额净值收益率超越业绩比较基准收益率 1.627 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年是我国经济保持平稳较快发展、加快结构调整的关键一年，宏观调控政策和通胀走势仍是主导货币市场的资金供应和利率水平的关键性因素。预期上半年通胀形势依然严峻，央行将更为谨慎地实施稳健货币政策，综合运用利率、存款准备金率和公开市场操作等工具，控制信贷规模，加大差别化政策实施力度，增强调控的针对性、灵活性、有效性，货币市场流动性应呈现整体趋近态势。社会融资总规模指标的实施对债券的供给影响也需要进一步观察和分析。针对上述复杂的市场环境，本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，以确保组合安全性为首要任务，兼顾流动性和收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，继续保持较高的流动性资产配置，谨慎控制组合的信用配置，以应对利率上行风险和组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人重点开展了合规管理、内部审计、法律事务、制度建设、海外业务、信息披露等方面监察稽核工作，采取的主要措施如下：

(1) 内控前置：在新产品设计、新业务拓展、基金营销、投资管理、海外业务、信息披露等方面，全面实现内控前置，从组织保证和制度安排确保内控的独立性和权威性，在参与公司新项目活动、事前合规审核、制度建设等方面紧跟公司业务发展战略，为公司决策、业务部门提供充足的法律支持以及合规、操作风险防范措施。

(2) 差错管理：差错管理目标是无重大差错和违规，公司全面开展了风险导向型内审、差错统计分析和风险控制委员会等工作。

(3) “三条底线”防范：公司管理层多次要求公司和全体员工，都不能触犯“老鼠仓”、非公平交易和各种形式的利益输送这三条底线，同时采取有效防范措施。公司管理的不同投资组合能够得到公平对待，未发现违法违规行为。

(4) 海外业务合规与支持，启动 GIPS 认证和 SAS70 审计，实施严格内控，强化公司的国际竞争力，增强客户信心，为年金、特定资产管理业务、海外等业务拓展创造了良好条件。

(5)信息披露和投资者关系管理工作：完成 23 只基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同第二十节三、基金收益分配原则的约定：“1、每日分配、按月支付。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益”，“3、本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式”，本期已实现收益为 159,430,927.80 元，每日分配，每月支付，合计分配 159,430,927.80 元，符合本基金基金合同的约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20638 号

嘉实货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实货币市场基金的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是嘉实货币市场基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序

取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了嘉实货币市场基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所有限公司

中国上海市

注册会计师

汪 棣

陈 宇

2011 年 3 月 14 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实货币市场基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,703,958,904.48	1,208,905,696.37
结算备付金		55,714,545.39	48,773,809.53
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	5,382,511,217.09	4,747,000,139.30
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,382,511,217.09	4,747,000,139.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	3,790,006,885.00	13,415,178,289.35
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	62,258,228.66	29,938,503.29
应收股利		-	-
应收申购款		19,100.00	4,802,540,868.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	40,000.00	-
资产总计		11,994,508,880.62	24,252,337,305.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		525,739,537.13	-
应付证券清算款		-	2,366,668,076.39
应付赎回款		5,106,064.57	2,522,375.26
应付管理人报酬		2,774,197.30	2,021,486.96
应付托管费		840,665.83	612,571.80
应付销售服务费		2,101,664.58	1,531,429.53
应付交易费用	7.4.7.7	107,035.61	106,038.73
应交税费		35,940.00	35,940.00
应付利息		65,653.17	-
应付利润		7,101,945.84	3,124,355.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	162,112.32	151,734.22
负债合计		544,034,816.35	2,376,774,008.38
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	11,450,474,064.27	21,875,563,297.47
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,450,474,064.27	21,875,563,297.47
负债和所有者权益总计		11,994,508,880.62	24,252,337,305.85

注: 报告截止日 2010 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0000 元, 基金份额总额 11,450,474,064.27 份。

7.2 利润表

会计主体: 嘉实货币市场基金

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至	上年度可比期间 2009年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2010 年 12 月 31 日	2009 年 12 月 31 日
一、收入		233,838,704.05	221,817,246.44
1. 利息收入		217,433,862.30	177,208,849.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	53,143,561.81	30,084,695.42
债券利息收入		104,746,172.67	107,138,134.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,544,127.82	39,986,019.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		16,374,841.75	44,548,396.55
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	16,374,841.75	44,548,396.55
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益		-	-
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.13	30,000.00	60,000.00
减：二、费用		74,407,776.25	92,643,586.96
1. 管理人报酬		27,214,341.81	39,274,473.34
2. 托管费		8,246,770.13	11,901,355.63
3. 销售服务费		20,616,925.38	29,753,388.95
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		17,874,112.59	11,377,761.26
其中：卖出回购金融资产支出		17,874,112.59	11,377,761.26
6. 其他费用	7.4.7.15	455,626.34	336,607.78
三、利润总额		159,430,927.80	129,173,659.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润		159,430,927.80	129,173,659.48

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实货币市场基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,875,563,297.47	-	21,875,563,297.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	159,430,927.80	159,430,927.80

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-10,425,089,233.20	-	-10,425,089,233.20
其中：1. 基金申购款	46,498,663,529.32	-	46,498,663,529.32
2. 基金赎回款	-56,923,752,762.52	-	-56,923,752,762.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-159,430,927.80	-159,430,927.80
五、期末所有者权益（基金净值）	11,450,474,064.27	-	11,450,474,064.27
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,778,234,782.21	-	36,778,234,782.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,173,659.48	129,173,659.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-14,902,671,484.74	-	-14,902,671,484.74
其中：1. 基金申购款	42,330,011,565.39	-	42,330,011,565.39
2. 基金赎回款	-57,232,683,050.13	-	-57,232,683,050.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-129,173,659.48	-129,173,659.48
五、期末所有者权益（基金净值）	21,875,563,297.47	-	21,875,563,297.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 赵学军 李松林 王红
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字 2005 第 29 号《关于同意嘉实货币市场基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,947,125,566.43 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实货币市场基金基金合同》于 2005 年 3 月 18

日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,947,208,439.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 82,872.67 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《嘉实货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：现金；1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券；期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购；期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格(附注 7.4.4.5)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资于处置时, 其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益, 而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式, 每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入所有者权益, 每月集中宣告收益分配并将当月收益结转至投资人基金账户。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

报告期内本基金无涉及会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

报告期内本基金无涉及会计估计变更事项。

7.4.5.3 差错更正的说明

报告期内本基金无涉及重大会计差错事项。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	3,958,904.48	8,905,696.37
定期存款	2,700,000,000.00	1,200,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	2,300,000,000.00	1,200,000,000.00
存款期限 1 个月以内	400,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	2,703,958,904.48	1,208,905,696.37

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,382,511,217.09	5,378,373,800.00	-4,137,417.09	-0.0361%
	合计	5,382,511,217.09	5,378,373,800.00	-4,137,417.09	-0.0361%
项目		上年度末 2009 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,747,000,139.30	4,750,055,400.00	3,055,260.70	0.0140%
	合计	4,747,000,139.30	4,750,055,400.00	3,055,260.70	0.0140%

注：偏离金额 = 影子定价 - 摊余成本，偏离度 = 偏离金额 / 摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

报告期末（2010 年 12 月 31 日）及上年度末（2009 年 12 月 31 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产款	-	-
银行间同业市场买入返售金融资产款	3,790,006,885.00	-
合计	3,790,006,885.00	-
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产款	6,436,600,000.00	-
银行间同业市场买入返售金融资产款	6,978,578,289.35	-
合计	13,415,178,289.35	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末（2010 年 12 月 31 日）及上年度末（2009 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	858.36	972.85
应收定期存款利息	6,915,221.97	1,465,602.93
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	19,500.10	17,070.80
应收债券利息	40,655,949.96	25,057,628.84
应收买入返售证券利息	14,605,804.22	3,151,971.59
应收申购款利息	60,894.05	245,256.28
其他	-	-
合计	62,258,228.66	29,938,503.29

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
其他应收款	40,000.00	-
待摊费用	-	-
合计	40,000.00	-

注：上年度末（2009 年 12 月 31 日），本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	107,035.61	106,038.73
合计	107,035.61	106,038.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	37,612.32	17,234.22
预提费用	124,500.00	134,500.00
合计	162,112.32	151,734.22

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,875,563,297.47	21,875,563,297.47
本期申购	46,498,663,529.32	46,498,663,529.32
本期赎回	-56,923,752,762.52	-56,923,752,762.52
本期末	11,450,474,064.27	11,450,474,064.27

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	159,430,927.80	-	159,430,927.80
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-159,430,927.80	-	-159,430,927.80
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,659,382.89	79,340.96

定期存款利息收入	46,433,785.72	28,517,370.52
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	409,810.86	1,098,511.98
其他	640,582.34	389,471.96
合计	53,143,561.81	30,084,695.42

7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	15,266,414,404.84	31,462,965,938.42
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	15,126,096,046.79	31,099,228,547.80
减：应收利息总额	123,943,516.30	319,188,994.07
债券投资收益	16,374,841.75	44,548,396.55

7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	-	-
手续费返还	30,000.00	60,000.00
合计	30,000.00	60,000.00

7.4.7.14 交易费用

本报告期及上年度可比期间，本基金无交易费用。

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	140,000.00	130,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行划款手续费	197,626.34	88,107.78
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	-	500.00
合计	455,626.34	336,607.78

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

报告期内，本基金不存在或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日后的收益支付事项如下：

	宣告日	分配收益所属期间
2011年第1号收益支付公告	2011.01.20	2010.12.20-2011.01.19
2011年第2号收益支付公告	2011.02.21	2011.01.20-2011.02.20
2011年第3号收益支付公告	2011.03.21	2011.02.21-2011.03.20

注：本基金收益支付方式为收益再投资方式，基金份额持有人所拥有收益结转的基金份额于收益支付日直接计入其基金账户。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
国都证券有限责任公司	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,214,341.81	39,274,473.34
其中：支付销售机构的客户维护费	4,082,053.41	10,789,377.01

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,246,770.13	11,901,355.63

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
嘉实基金管理有限公司	7,090,561.17	
中国银行	2,076,564.92	
国都证券有限责任公司	42,391.81	
合计	9,209,517.90	
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
嘉实基金管理有限公司	4,435,703.93	
中国银行	4,286,264.24	
国都证券有限责任公司	62,861.99	
合计	8,784,830.16	

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金注册登记人嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	1,062,141,207.33	540,665,176.44	-	-	143,221,900,000.00	10,122,422.12
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	99,930,745.21	3,948,068,583.87	-	-	249,735,518,000.00	8,595,594.54

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例%	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例%
国都证券有限责任公司	-	-	1,000,000,000.00	4.57

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,958,904.48	6,700,252.33	408,905,696.37	8,068,471.52

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，活期银行存款按银行同业利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。（2）本期末基金无存于中国银行的定期存款，本期由中国银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入1,040,869.44元；上年度末由中国银行保管的银行存款余额含定期存款400,000,000.00元；上年度可比期间由中国银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入7,989,130.56元。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金未参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
136,977,288.90	18,476,048.55	3,977,590.35	159,430,927.80	-

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末（2010年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 525, 739, 537. 13 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
090213	09 国开 13	2011 年 1 月 4 日	101. 32	2, 900, 000	293, 828, 000. 00
100236	10 国开 36	2011 年 1 月 4 日	100. 00	2, 000, 000	200, 000, 000. 00
100221	10 国开 21	2011 年 1 月 4 日	99. 84	520, 000	51, 916, 800. 00
合计				5, 420, 000	545, 744, 800. 00

7.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

报告期末(2010 年 12 月 31 日), 本基金无交易所债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具, 属于高流动性、低风险的品种, 其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制限定在限定的范围之内, 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。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系, 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会, 负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况, 充分发挥独立董事监督职能, 保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险, 本基金的基金管理人设立风险控制委员会, 由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成, 负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险, 并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度, 积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核, 定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作, 并保证监察稽核部的独立性和权威性, 配备了充足合格的监察稽核人员, 明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人, 对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察

稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行和信用风险较低的股份制商业银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的短期企业债券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
A-1	3,709,867,837.01	1,581,182,598.27
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	3,709,867,837.01	1,581,182,598.27

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
AAA	322,716,099.59	491,373,981.21
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	322,716,099.59	491,373,981.21

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值且正回购余额在每个交易日均不超过基金资产净值的 20%。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产						
银行存款	1,811,665,182.26	909,482,444.45	-	-	-	2,721,147,626.71
结算备付金	55,714,545.39	-	-	-	-	55,714,545.39
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	319,679,900.00	381,937,186.30	3,817,570,040.82	1,139,450,480.00	-	5,658,637,607.12
买入返售金融资产	2,312,426,712.33	998,460,739.72	506,630,136.99	-	-	3,817,517,589.04

应收申购款	19,100.00	-	-	-	-	19,100.00
其他资产	40,000.00	-	-	-	-	40,000.00
资产总计	4,499,545,439.98	2,289,880,370.47	4,324,200,177.81	1,139,450,480.00	-	12,253,076,468.26
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	526,002,149.81	-	-	-	-	526,002,149.81
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	5,106,064.57	-	-	-	-	5,106,064.57
应付管理人报酬	2,774,197.30	-	-	-	-	2,774,197.30
应付托管费	840,665.83	-	-	-	-	840,665.83
应付销售服务费	2,101,664.58	-	-	-	-	2,101,664.58
应付交易费用	107,035.61	-	-	-	-	107,035.61
应交税费	35,940.00	-	-	-	-	35,940.00
应付利润	7,101,945.84	-	-	-	-	7,101,945.84
其他负债	162,112.32	-	-	-	-	162,112.32
负债总计	544,231,775.86	-	-	-	-	544,231,775.86
流动性净额	3,955,313,664.12	2,289,880,370.47	4,324,200,177.81	1,139,450,480.00	-	11,708,844,692.40
上年度末 2009年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	-
银行存款	8,905,696.37	1,203,940,916.67	-	-	-	1,212,846,613.04
结算备付金	48,773,809.53	-	-	-	-	48,773,809.53
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	328,785,250.00	2,402,389,600.00	1,363,456,716.58	73,922,080.00	769,780,520.00	4,938,334,166.58
买入返售金融资产	12,160,817,847.12	258,868,488.03	1,006,012,328.76	-	-	13,425,698,663.91
应收申购款	4,802,540,868.01	-	-	-	-	4,802,540,868.01
资产总计	17,349,823,471.03	3,865,199,004.70	2,369,469,045.34	73,922,080.00	769,780,520.00	24,428,194,121.07
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	2,366,668,076.39	-	-	-	-	2,366,668,076.39
应付赎回款	2,522,375.26	-	-	-	-	2,522,375.26
应付管理人报酬	2,021,486.96	-	-	-	-	2,021,486.96
应付托管费	612,571.80	-	-	-	-	612,571.80
应付销售服务费	1,531,429.53	-	-	-	-	1,531,429.53
应付交易费用	106,038.73	-	-	-	-	106,038.73
应交税费	35,940.00	-	-	-	-	35,940.00
应付利润	3,124,355.49	-	-	-	-	3,124,355.49
其他负债	151,734.22	-	-	-	-	151,734.22
负债总计	2,376,774,008.38	-	-	-	-	2,376,774,008.38
流动性净额	14,973,049,462.65	3,865,199,004.70	2,369,469,045.34	73,922,080.00	769,780,520.00	22,051,420,112.69

注：表中所示金额为未折现合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过影子定价(附注 7.4.4.4)对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,703,958,904.48	-	-	-	-	2,703,958,904.48
结算备付金	55,714,545.39	-	-	-	-	55,714,545.39
交易性金融资产	2,004,985,479.78	3,377,525,737.31	-	-	-	5,382,511,217.09
买入返售金融资产	3,790,006,885.00	-	-	-	-	3,790,006,885.00
应收利息	-	-	-	-	62,258,228.66	62,258,228.66
应收申购款	-	-	-	-	19,100.00	19,100.00
其他资产	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
资产总计	8,554,665,814.65	3,377,525,737.31	-	-	62,317,328.66	11,994,508,880.62
负债						
卖出回购金融资产款	525,739,537.13	-	-	-	-	525,739,537.13
应付赎回款	-	-	-	-	5,106,064.57	5,106,064.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,774,197.30	2,774,197.30
应付托管费	-	-	-	-	840,665.83	840,665.83
应付销售服务费	-	-	-	-	2,101,664.58	2,101,664.58
应付交易费用	-	-	-	-	107,035.61	107,035.61
应交税费	-	-	-	-	35,940.00	35,940.00
应付利息	-	-	-	-	65,653.17	65,653.17
应付利润	-	-	-	-	7,101,945.84	7,101,945.84
其他负债	-	-	-	-	162,112.32	162,112.32
负债总计	525,739,537.13	-	-	-	18,295,279.22	544,034,816.35
利率敏感度缺口	8,028,926,277.52	3,377,525,737.31	-	-	44,022,049.44	11,450,474,064.27

上年度末 2009 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,208,905,696.37	-	-	-	-	1,208,905,696.37
结算备付金	48,773,809.53	-	-	-	-	48,773,809.53
交易性金融资产	3,802,243,588.47	944,756,550.83	-	-	-	4,747,000,139.30
买入返售金融资产	13,415,178,289.35	-	-	-	-	13,415,178,289.35
应收利息	-	-	-	-	29,938,503.29	29,938,503.29
应收申购款	3,275,483,906.01	-	-	-	1,527,056,962.00	4,802,540,868.01
资产总计	21,750,585,289.73	944,756,550.83	-	-	1,556,995,465.29	24,252,337,305.85
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,366,668,076.39	2,366,668,076.39
应付赎回款	-	-	-	-	2,522,375.26	2,522,375.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,021,486.96	2,021,486.96
应付托管费	-	-	-	-	612,571.80	612,571.80
应付销售服务费	-	-	-	-	1,531,429.53	1,531,429.53
应付交易费用	-	-	-	-	106,038.73	106,038.73
应交税费	-	-	-	-	35,940.00	35,940.00
应付利润	-	-	-	-	3,124,355.49	3,124,355.49
其他负债	-	-	-	-	151,734.22	151,734.22
负债总计	-	-	-	-	2,376,774,008.38	2,376,774,008.38
利率敏感度缺口	21,750,585,289.73	944,756,550.83	-	-	-819,778,543.09	21,875,563,297.47

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动(2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项:

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 5,382,511,217.09 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：无第一层级，第二层级 4,747,000,139.30 元，无第三层级)。于本年度内，本基金持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动(2009 年度：同)。

§ 8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,382,511,217.09	44.87
	其中：债券	5,382,511,217.09	44.87
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,790,006,885.00	31.60
	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	2,759,673,449.87	23.01
4	其他各项资产	62,317,328.66	0.52
5	合计	11,994,508,880.62	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	13.58	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	525,739,537.13	4.59
	其中：买断式回购融资	-	-

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为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2) 报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	151
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

注：报告期内投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

8.3.2 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	41.69	4.59
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.57	-
2	30 天(含)—60 天	9.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.74	-
3	60 天(含)—90 天	13.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.75	-
4	90 天(含)—180 天	9.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.82	-
5	180 天(含)—397 天(含)	29.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.21	4.59

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	98,668,316.75	0.86
3	金融债券	1,251,258,963.74	10.93

	其中：政策性金融债	1,251,258,963.74	10.93
4	企业债券	322,716,099.59	2.82
5	企业短期融资券	3,709,867,837.01	32.40
6	其他	-	-
7	合计	5,382,511,217.09	47.01
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,016,268,565.17	8.88

注：上表中，付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收利息。

8.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	058031	05 中信债 1	3,260,000	322,716,099.59	2.82
2	100231	10 国开 31	3,000,000	297,908,072.13	2.60
3	090213	09 国开 13	2,900,000	293,840,442.73	2.57
4	1081295	10 同盛 CP01	2,200,000	220,000,000.00	1.92
5	100236	10 国开 36	2,000,000	199,996,318.14	1.75
6	100230	10 国开 30	2,000,000	199,715,704.71	1.74
7	1081325	10 沪城控 CP01	1,700,000	169,479,017.93	1.48
8	1081316	10 横店 CP01	1,500,000	149,351,751.28	1.30
9	1081268	10 酒钢 CP01	1,400,000	140,018,027.33	1.22
10	1081223	10 农六师 CP01	1,200,000	120,234,811.35	1.05

8.6 “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%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2358%
报告期内偏离度的最低值	-0.1842%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1129%

注：表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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%。

8.8.3 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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	62,258,228.66
4	应收申购款	19,100.00
5	其他应收款	40,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	62,317,328.66

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
74,791	153,099.63	7,800,352,326.46	68.12%	3,650,121,737.81	31.88%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,961,737.90	0.03%

§ 10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2005年3月18日)基金份额总额	2,947,208,439.10
本报告期期初基金份额总额	21,875,563,297.47
本报告期基金总申购份额	46,498,663,529.32
减:本报告期基金总赎回份额	56,923,752,762.52

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,450,474,064.27

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2010年3月11日，本基金管理人发布《关于调整嘉实货币和嘉实超短债债券基金经理的公告》，吴洪坚先生不再担任嘉实货币市场基金基金经理职务，嘉实货币市场基金由现任基金经理魏莉女士管理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费 140,000.00 元，该审计机构已连续 6 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	债券回购交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	--------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	1	64,809,300,000.00	100.00%	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下开放式基金通过浙商证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年1月4日
2	关于旗下开放式基金通过上海农商银行开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年1月18日
3	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第1号）	中国证券报、管理人网站	2010年1月20日
4	关于嘉实货币市场基金 2010 年春节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年2月6日
5	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第2号）	中国证券报、管理人网站	2010年2月22日
6	关于成立广州分公司的公告	中国证券报、管理人网站	2010年3月3日
7	关于旗下开放式基金通过江海证券和第一创业证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年3月10日
8	关于调整嘉实货币和嘉实超短债债券基金经理的公告	中国证券报、管理人网站	2010年3月11日
9	关于直销网上交易赎回转申购业务有关申购费率统一优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2010年3月17日
10	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第3号）	中国证券报、管理人网站	2010年3月22日
11	关于嘉实货币市场基金 2010 年清明节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年3月31日
12	关于旗下开放式基金通过爱建证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年4月16日
13	关于增加乌鲁木齐市商业银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2010年4月20日
14	关于对兴业银行借记卡持有人开通嘉实直销网上交易定期定额申购业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年4月21日
15	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第4号）	中国证券报、管理人网站	2010年4月21日
16	关于旗下开放式基金通过乌鲁木齐市商业银行开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年4月23日
17	关于嘉实货币市场基金 2010 年劳动节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年4月27日
18	关于增加渤海银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年4月27日

19	关于增加华融证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2010年5月5日
20	关于增加中国光大银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年5月6日
21	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第5号）	中国证券报、管理人网站	2010年5月20日
22	关于增加上海农商银行和洛阳银行为嘉实旗下基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2010年5月24日
23	关于旗下开放式基金通过华融证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年5月28日
24	关于旗下开放式基金通过信达证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年6月3日
25	关于嘉实货币市场基金 2010 年端午节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年6月8日
26	关于旗下开放式基金通过洛阳银行开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年6月8日
27	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第6号）	中国证券报、管理人网站	2010年6月21日
28	关于旗下开放式基金通过申银万国证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年6月24日
29	关于旗下开放式基金通过国信证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年7月7日
30	关于直销电话交易开通农行金穗卡、建行龙卡储蓄卡、广发理财通卡、中行广东分行卡认购和申购业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年7月9日
31	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第7号）	中国证券报、管理人网站	2010年7月20日
32	关于旗下开放式基金通过东吴证券和日信证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年7月21日
33	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第8号）	中国证券报、管理人网站	2010年8月20日
34	关于农行金穗卡持卡人通过直销网上和电话交易系统在线支付方式申购基金费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2010年8月20日
35	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务开通范围增加中行、交行、招行及广发银行借记卡持卡人业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年8月27日
36	关于嘉实货币市场基金 2010 年中秋国庆节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年9月15日
37	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第9号）	中国证券报、管理人网站	2010年9月20日
38	关于增加深圳农村商业银行作为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2010年9月21日
39	关于旗下开放式基金通过中投证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年9月30日
40	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010年第10号）	中国证券报、管理人网站	2010年10月20日
41	关于旗下开放式基金通过长江证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010年10月22日

42	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010 年第 11 号）	中国证券报、管理人网站	2010 年 11 月 22 日
43	关于增加北京农村商业银行作为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010 年 12 月 2 日
44	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务开通范围增加邮储银行等 6 家银行借记卡持卡人业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010 年 12 月 3 日
45	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2010 年第 12 号）	中国证券报、管理人网站	2010 年 12 月 20 日
46	关于嘉实货币 2011 年元旦节前暂停申购及转入业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010 年 12 月 29 日
47	关于对中国民生银行借记卡持卡人开通嘉实直销网上交易和电话交易业务的公告	中国证券报、管理人网站	2010 年 12 月 31 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实货币市场基金募集的文件；
- (2) 《嘉实货币市场基金基金合同》；
- (3) 《嘉实货币市场基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实货币市场基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实货币市场基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2011 年 3 月 28 日