

## 嘉实活期宝货币市场基金更新招募说明书摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

### 重要提示

嘉实活期宝货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2013 年 10 月 28 日证监许可[2013]1360 号文核准公开发售，本基金基金合同于 2013 年 12 月 18 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基金合同的承认和接受，并按照《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，应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。

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 2018 年 12 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日（未经审计），特别事项注明除外。

### 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

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 53 层 09-11 单元

办公地址

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人

赵学军

成立日期

1999 年 3 月 25 日

注册资本

1.5 亿元

股权结构

中诚信托有限责任公司 40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%，立信投资有限责任公司 30%。

存续期间

持续经营

电话

（010）65215588

传真

（010）65185678

联系人

胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[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、北京怀柔、武汉分公司。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。

## (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情况

牛成立先生,联席董事长,经济学硕士,中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长;中国银行厦门分行党委委员、副行长(挂职);中国银行业监督管理委员会(下称银监会)非银行金融机构监管部处长;银监会新疆监管局党委委员、副局长;银监会银行监管四部副主任;银监会黑龙江监管局党委书记、局长;银监会融资性担保业务工作部(融资性担保业务监管部际联席会议办公室)主任;中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长,兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生,董事长,党委书记,经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商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2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理,2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员;国都证券有限责任公司研究部高级经理;中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官;现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理;兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

高峰先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁,美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长,2008年至今任德意志银行(中国)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生,董事,英国籍,南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问,JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO,JP Morgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO,德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生,董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今,任北京德恒有限责任公司总经理;2001年11月至今,任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生,独立董事,美国福特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辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员,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长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

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、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编,汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、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委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,注册会计师,中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

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。

经雷先生，总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

宋振茹女士，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管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。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。

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法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、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。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，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

李金灿先生，硕士研究生，9年证券从业经历，CFA、具有基金从业资格。曾任 FutexTradingLtd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。2015年6月9日至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金经理、2015年6月9日至今任嘉实超短债证券投资基金基金经理、2016年1月28日至今任嘉实薪金宝货币市场基金基金经理、2016年2月5日至今任嘉实快线货币市场基金基金经理、2016年7月23日至今任嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金经理、2016年7月23日至今任嘉实安心货币市场基金基金经理、2016年12月27日至今任嘉实增益宝货币市场基金基金经理、2017年5月24日至今任嘉实1个月理财债券型证券投资基金基金经理、2017年5月25日至今任嘉实3个月理财债券型证券投资基金基金经理、2017年5月25日至今任嘉实现金宝货币市场基金基金经理、2017年5月25日至今任嘉实现金添利货币市场基金基金经理、2017年5月25日至今任嘉实活期宝货币市场基金基金经理、2017年5月25日至今

任嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金基金经理、2017 年 5 月 25 日至今任嘉实活钱包货币市场基金基金经理、2017 年 6 月 29 日至今任嘉实 6 个月理财债券型证券投资基金基金经理。

万晓西先生，经济学硕士，18 年证券从业经历，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理，第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理，民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理，2007 年 6 月 6 日至 2009 年 10 月 20 日任南方现金增利货币基金经理。2013 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系短端 alpha 策略组组长，中国国籍。2013 年 7 月 5 日至 2014 年 7 月 16 日任嘉实信用债券型证券投资基金基金经理、2013 年 7 月 5 日至 2014 年 7 月 16 日任嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、2013 年 9 月 4 日至 2014 年 9 月 19 日任嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013 年 12 月 11 日至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金经理、2013 年 12 月 18 日至今任嘉实活期宝货币市场基金基金经理、2014 年 3 月 17 日至今任嘉实活钱包货币市场基金基金经理、2014 年 6 月 27 日至今任嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金基金经理、2015 年 6 月 25 日至今任嘉实快线货币市场基金基金经理、2017 年 3 月 29 日至今任嘉实现金添利货币市场基金基金经理、2017 年 5 月 24 日至今任嘉实货币市场基金基金经理、2017 年 5 月 24 日至今任嘉实薪金宝货币市场基金基金经理、2017 年 6 月 19 日至今任嘉实 6 个月理财债券型证券投资基金基金经理。

李瞳先生，硕士研究生，9 年证券从业经历，具有基金从业资格。曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。2015 年 5 月 14 日至 2018 年 11 月 2 日任嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金经理。2015 年 1 月 28 日至今任嘉实活钱包货币市场基金基金经理、2015 年 5 月 14 日至今任嘉实安心货币市场基金基金经理、2016 年 1 月 28 日至今任嘉实活期宝货币市场基金基金经理、2016 年 1 月 28 日至今任嘉实货币市场基金基金经理、2016 年 4 月 21 日至今任嘉实快线货币市场基金基金经理、2016 年 12 月 22 日至今任嘉实现金宝货币市场基金基金经理、2017 年 4 月 13 日至今任嘉实现金添利货币市场基金基金经理、2017 年 5 月 24 日至今任嘉实超短债证券投资基金基金经理、2017 年 5 月 25 日至今任嘉实增益宝货币市场基金基金经理、2017 年 5 月 25 日至今任嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金基金经理、2017 年 5 月 25 日至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金经理。

## （2）历任基金经理

本基金无历任基金经理。

## 3、债券投资决策委员会

债券投资决策委员会的成员包括：公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系策略组组长王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及养老金固收投资组长王怀震先生。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2018年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共419只。

### (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规

范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

## 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

## 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址

北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心D座12层

电话

(010) 65215588

传真

(010) 65215577

联系人

赵佳

##### (2) 嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元

电话

(021) 38789658

传真

(021) 68880023

联系人

邵琦

(3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址

成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元

电话

(028) 86202100

传真

(028) 86202100

联系人

王启明

(4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层

电话

0755-84362200

传真

(0755) 25870663

联系人

陈寒梦

(5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址

青岛市市南区山东路 6 号华润大厦 3101 室

电话

(0532) 66777997

传真

(0532) 66777676

联系人

胡洪峰

(6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址

杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城 2 幢 1001A 室

电话

(0571) 88061392

传真

(0571) 88021391

联系人

王振

(7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址

福州市鼓楼区五四路 137 号信合广场 801A 单元

电话

(0591) 88013670

传真

(0591) 88013670

联系人

吴志锋

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址

南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室

电话

(025) 66671118

传真

(025) 66671100

联系人

徐莉莉

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址

广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元

电话

(020) 88832125

传真

(020) 81552120

联系人

周炜

## 2、代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司

住所

北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址

北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

注册地址

北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人

周慕冰

电话

(010)85108227

传真

(010)85109219

网址

<http://www.abchina.com>

客服电话

95599

(2) 中信银行股份有限公司

住所、办公地址

北京市东城区朝阳门北大街 9 号

注册地址

北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人

李庆萍

联系人

廉赵峰

网址

<http://www.citicbank.com>

客服电话

95558

(3)平安银行股份有限公司

住所

广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址

深圳市深南东路 5047 号

注册地址

深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人

谢永林

联系人

张青

电话

0755-22166118

传真

0755-82080406

网址

<http://www.bank.pi>

客服电话

95511-3 或 95501

[ngan.com](http://ngan.com)

(4)青岛银行股份有限公司

住所

青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

办公地址

山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

注册地址

山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

法定代表人

郭少泉

联系人

徐伟静

电话

0532-68629925

传真

0532-68629939

网址

<http://www.qdccb.com/>

客服电话

96588(青岛)、4006696588(全国)

(5)东莞银行股份有限公司

住所

东莞市城区运河东一路 193 号

办公地址

东莞市莞城区体育路 21 号

注册地址

广东省东莞市城区运河东一路 1 9 3 号

法定代表人

廖玉林

联系人

吴照群

电话

(0769)22119061

传真

(0769)22117730

网址

<http://www.dongguanbank.cn/>

客服电话

4001196228

(6)江苏银行股份有限公司

住所

南京市中华路 26 号江苏银行总部大厦

办公地址

江苏省南京市中华路 26 号

注册地址

江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人

夏平

联系人

张洪玮

电话

(025)58587036

传真

(025)58587820

网址

<http://www.jsbchina.cn>

客服电话

95319

(7)乌鲁木齐银行股份有限公司

住所

乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址

新疆乌鲁木齐市天山区新华北路 8 号

注册地址

新疆乌鲁木齐市天山区新华北路 8 号

法定代表人

杨黎

联系人

何佳

电话

(0991)8824667

传真

(0991)8824667

网址

<http://www.uccb.com.cn>

客服电话

(0991)96518

(8)重庆农村商业银行股份有限公司

办公地址

重庆市江北区金沙门路 36 号

注册地址

重庆市江北区金沙门路 36 号

法定代表人

刘建忠

联系人

范亮

电话

023-67637962

传真

023-67637709

网址

<http://www.cqrcb.com>

客服电话

966866

(9)西安银行股份有限公司

办公地址

陕西省西安市高新路 60 号

注册地址

陕西省西安市高新路 60 号

法定代表人

郭军

联系人

白智

电话

029-88992881

传真

029-88992475

网址

<http://www.xacbank.com>

客服电话

40086-96779

(10)苏州银行股份有限公司

办公地址

江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

注册地址

江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

法定代表人

王兰凤

联系人

熊志强

电话

0512-69868390

传真

0512-69868370

网址

<http://www.suzhoubank.com>

客服电话

0512-96067

(11)四川天府银行股份有限公司

办公地址

四川省南充市顺庆区滨江中路一段 97 号 26 栋

注册地址

四川省南充市涪江路 1 号

法定代表人

邢敏

联系人

樊海波

电话

028-67676033

传真

028-67676033

网址

<http://www.tf.cn>

(12)江苏紫金农村商业银行股份有限公司

办公地址

南京市建邺区江东中路 381 号

注册地址

江苏省南京市建邺区江东中路 381 号

法定代表人

张小军

联系人

游丹

电话

025-88866645

传真

025-88866724

网址

<http://www.zjrcban>

客服电话

96008

k.com/

(13)河南安存基金销售有限公司

办公地址

郑州市管城区郑汴路 96 号中原信托大厦 5 楼

注册地址

郑州市管城区郑汴路 76 号绿都广场 1 单元 13 层 1313 号

法定代表人

李飞月

联系人

裴小龙

电话

0371-85337363

传真

0371-85337363

网址

<http://www.anjfax.cn>

客服电话

0371-85337369

(14)上海天天基金销售有限公司

办公地址

上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

注册地址

上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

法定代表人

其实

联系人

潘世友

电话

021-54509977

传真

021-64385308

网址

<http://www.1234567.com.cn>

客服电话

95021

(15)上海好买基金销售有限公司

办公地址

上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼

注册地址

上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人

杨文斌

联系人

张茹

电话

021-20613999

传真

021-68596916

网址

<https://www.howbuy.com/>

客服电话

4007009665

(16)上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址

上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

注册地址

浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人

张跃伟

联系人

单丙焯

电话

021-20691869

传真

021-20691861

网址

<http://www.erichfund.com>

客服电话

400-089-1289

(17)浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址

浙江省杭州市西湖区古荡街道

注册地址

杭州市文二西路 1 号 903 室

法定代表人

凌顺平

联系人

林海明

传真

0571-86800423

网址

<http://www.5ifund.com>

客服电话

4008-773-772

(18)嘉实财富管理有限公司

住所

上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址

上海市浦东新区世纪大道八号国金中心二期 53 楼

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人

赵学军

联系人

景琪

电话

021-20289890

传真

021-20280110

网址

<http://www.harvestwm.cn>

客服电话

400-021-8850

(19)南京苏宁基金销售有限公司

办公地址

南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

注册地址

南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人

刘汉青

联系人

喻明明

电话

025-66996699-884131

传真

025-66008800-884131

网址

<http://www.snjijin.com/>

客服电话

95177

(20)通华财富(上海)基金销售有限公司

办公地址

上海市浦东新区新金桥路 28 号新金桥大厦 5 楼

注册地址

上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

法定代表人

马刚

联系人

褚志朋

电话

021-60818730

传真

021-60818187

网址

<http://www.tonghuafund.com>

客服电话

40066-95156

(21)北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址

北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛中心 30 层

注册地址

北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人

周斌

联系人

陈霞

电话

15249236571

传真

010-59313586

网址

<http://www.chtfund>

客服电话

400-8980-618

.com/

(22)北京植信基金销售有限公司

办公地址

北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

注册地址

北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人

于龙

联系人

吴鹏

电话

010-56075718

传真

010-67767615

网址

<http://www.zhixin-inv.com>

客服电话

400-680-2123

(23)上海攀赢基金销售有限公司

办公地址

上海浦东新区银城中路 488 号 603 室

注册地址

上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

法定代表人

田为奇

联系人

吴卫东

电话

021-68889082

传真

021-68889283

网址

<http://www.pytz.cn>

客服电话

021-68889082

(24)上海陆金所基金销售有限公司

办公地址

上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人

胡学勤

联系人

宁博宇

电话

021-20665952

传真

021-22066653

网址

<http://www.lufunds.com>

客服电话

4008219031

(25)珠海盈米财富管理有限公司

办公地址

珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

注册地址

珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人

肖雯

联系人

黄敏嫦

电话

020-89629019

传真

020-89629011

网址

<http://www.yingmi.cn>

客服电话

020-89629066

(26)中民财富基金销售(上海)有限公司

办公地址

上海市黄浦区老太平弄 88 号 A、B 单元

注册地址

上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

法定代表人

弭洪军

联系人

茅旦青

电话

021-33355392

传真

021-63353736

网址

<http://www.cmiwm.com/>

客服电话

400-876-5716

(27)中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司

办公地址

上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号 729S 室

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 729S 室

法定代表人

许欣

联系人

屠帅颖

电话

021-68609600

网址

<http://www.qiangungun.com>

客服电话

400-700-9700

(28)万家财富基金销售(天津)有限公司

办公地址

北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

注册地址

天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

法定代表人

李修辞

联系人

王芳芳

电话

010-59013842/18519215322

传真

010-59013828

网址

<http://www.wanjiawealth.com>

(29)国泰君安证券股份有限公司

住所

上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址

上海市静安区南京西路 768 号

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人

杨德红

联系人

芮敏祺

电话

(021)38676666

传真

(021)38670666

网址

<http://www.gtja.com>

客服电话

4008888666

(30)中信建投证券股份有限公司

住所

北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址

北京市东城区朝内大街 188 号

注册地址

北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人

王常青

联系人

权唐

电话

(010) 65183880

传真

(010) 65182261

网址

<http://www.csc108.com>

客服电话

400-8888-108

(31)国信证券股份有限公司

办公地址

广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

注册地址

深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人

何如

联系人

周杨

电话

0755-82130833

传真

0755-82133952

网址

<http://www.guosen.com.cn>

客服电话

95536

(32)广发证券股份有限公司

住所

广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址

广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、18 楼、19 楼、36 楼、38 楼、39 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼

注册地址

广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

法定代表人

孙树明

联系人

黄岚

电话

(020) 87555888

传真

(020) 87555305

网址

<http://www.gf.com.cn>

客服电话

95575 或致电各地营业网点

(33)中信证券股份有限公司

住所

北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

办公地址

深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

注册地址

深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人

张佑君

联系人

郑慧

电话

010-60838888

网址

<http://www.cs.ecitic.com>

客服电话

95558

(34)华泰证券股份有限公司

办公地址

江苏省南京市江东中路 228 号

注册地址

江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人

周易

联系人

庞晓芸

电话

0755-82492193

传真

0755-82492962(深圳)

网址

<http://www.htsc.co>

客服电话

95597

m.cn

(35)中国中投证券有限责任公司

住所

深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址

深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18-21 层

注册地址

深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人

高涛

联系人

胡芷境

电话

0755-88320851

传真

0755-82026539

网址

<http://www.china-invs.cn>

客服电话

4006008008

(36)光大证券股份有限公司

住所、办公地址

上海市静安区新闸路 1508 号

注册地址

上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人

周健男

联系人

刘晨、李芳芳

电话

(021) 22169999

传真

(021) 22169134

网址

<http://www.ebscn.com>

客服电话

4008888788、10108998

(37)中信期货有限公司

办公地址

深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1303-1305 室、14 层

注册地址

广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人

张皓

联系人

刘宏莹

电话

010-60833754

传真

0755-83217421

网址

<http://www.citicsf.com>

客服电话

400-990-8826

(38)万联证券股份有限公司

住所

广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

办公地址

广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

注册地址

广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

法定代表人

张建军

联系人

甘蕾

电话

020-38286026

网址

<http://www.wlzq.com.cn>

客服电话

95322

(39)国都证券股份有限公司

住所

北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址

北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

注册地址

北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人

王少华

联系人

黄静

电话

(010)84183389

传真

(010)84183311

网址

<http://www.guodu.com>

客服电话

400-818-8118

(40)国金证券股份有限公司

办公地址

四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼

注册地址

四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人

冉云

联系人

刘婧漪、贾鹏

电话

028-86690057、028-86690058

传真

028-86690126

网址

<http://www.gjq.com.cn>

客服电话

95310

(41)上海挖财基金销售有限公司

住所

中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址

上海浦东杨高南路 799 号 3 号楼 5 楼

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室

法定代表人

冷飞

联系人

李娟

电话

021-50810687

传真

021-58300279

网址

<http://www.wacaijijin.com>

客服电话

021-50810673

(42)北京百度百盈基金销售有限公司

住所

北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

办公地址

北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

注册地址

北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

法定代表人

张旭阳

联系人

杨琳

电话

010-61952702

传真

010-61951007

客服电话

95055

(43)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

办公地址

浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 12 楼

注册地址

浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人

祖国明

联系人

韩爱彬

电话

021-60897840

传真

0571-26697013

网址

<http://www.fund123.cn>

客服电话

4000-766-123

(44)上海万得基金销售有限公司

办公地址

中国（上海）浦东新区福山路 33 号 9 楼

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人

王廷富

联系人

姜吉灵

电话

021-68882280

传真

021-68882281

网址

<https://www.520fund.com.cn/>

客服电话

400-821-0203

(45)和耕传承基金销售有限公司

办公地址

郑州市郑东新区东风东路康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间

注册地址

郑州市郑东新区东风路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间

法定代表人

李淑慧

联系人

裴小龙

电话

0371-855183954000-555-671

传真

0371-85518397

网址

HGCCPB.COM

(46)南京途牛金融信息服务有限公司

办公地址

南京市玄武区玄武大道 699-32 号

注册地址

南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人

宋时琳

联系人

王旋

电话

025-86853960025-86853969

传真

025-86853969

网址

<http://www.tuniufu.com>

(47)北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址

北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

注册地址

北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人

钟斐斐

联系人

袁永姣

电话

010-61840688

传真

010-61840699

网址

<http://www.ncfjj.com>

客服电话

4000-618-518

(48)深圳前海微众银行股份有限公司

办公地址

广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

注册地址

深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）经

营场所：广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法定代表人

顾敏

联系人

苏豪

电话

13469952231

传真

0755-86700688

网址

<http://www.webank.com/>

客服电话

400-999-8877

（二）基金注册登记机构

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 53 层 09-11 单元

办公地址

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人

赵学军

联系人

彭鑫

电话

（010）65215588

传真

（010）65185678

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称

上海市源泰律师事务所

住所、办公地址

上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人

廖海

联系人

张兰

电话

（021）51150298-855

传真

（021）51150398

经办律师

刘佳、张兰

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

法定代表人

李丹

联系人

张勇

电话

(021) 23238888

传真

(021) 23238800

经办注册会计师

薛竞、张勇

四、基金名称

本基金名称：嘉实活期宝货币市场基金

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

在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许基金投资的金融工具，包括：现金；期限在一年以内（含一年）的银行存款、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。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、基金风险收益特征的前提下，本基金可参与投资，不需要召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按照届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

根据宏观经济指标（主要包括：市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP 增长率、货币供应量、就业率水平、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、交易场所、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。

1、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。

根据不同类别资产的流动性指标（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、交易场所等），决定类别资产的当期配置比率。

根据不同类别资产的收益率水平（持有期收益率、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、类别资产收益差异等）、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。

## 2、明细资产配置策略

第一步筛选，根据明细资产的剩余期限、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），决定投资总量。

## 3、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有关规定。
- 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总体投资策略，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运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门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；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

## 九、基金业绩比较基准

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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 23 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 2018 年 9 月 30 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

3,434,050,552.01

34.13

其中：债券

3,397,870,552.01

33.78

资产支持证券

36,180,000.00

0.36

2

买入返售金融资产

280,000,470.00

2.78

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

6,243,796,682.92

62.06

4

其他资产

102,367,303.17

1.02

5

合计

10,060,215,008.10

100.00

2.报告期债券回购融资情况

序号

项目

占基金资产净值比例（%）

1

报告期内债券回购融资余额

11.83

其中：买断式回购融资

-

序号  
项目  
金额（元）  
占基金资产净值比例  
（%）

2  
报告期末债券回购融资余额  
1,312,119,311.82  
15.01  
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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。（2）本基金基金合同第十二部分约定：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%。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%。

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  
106  
报告期内投资组合平均剩余期限最高值  
119  
报告期内投资组合平均剩余期限最低值  
90

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  
22.56  
15.01  
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-  
-

2  
30 天（含）—60 天  
17.12

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

0.45

-

3

60 天（含）—90 天

12.53

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

4

90 天（含）—120 天

7.21

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

5

120 天（含）—397 天（含）

54.49

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

合计

113.90

15.01

4.报告期内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

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

510,289,003.04

5.84

其中：政策性金融债

510,289,003.04

5.84

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

451,631,569.42

5.17

6

中期票据

29,889,485.83

0.34

7

同业存单

2,406,060,493.72

27.52

8

其他

-

-

9

合计

3,397,870,552.01

38.87

10

剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券

39,650,631.98

0.45

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。

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

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（%）

1

111821276

18 渤海银行 CD276  
6,000,000  
597,272,734.97  
6.83  
2  
111818177  
18 华夏银行 CD177  
4,000,000  
396,165,875.28  
4.53  
3  
011800908  
18 中石油 SCP001  
3,000,000  
301,559,561.73  
3.45  
4  
111811200  
18 平安银行 CD200  
3,000,000  
299,398,116.12  
3.42  
5  
111805181  
18 建设银行 CD181  
3,000,000  
295,840,231.40  
3.38  
6  
111816236  
18 上海银行 CD236  
2,700,000  
269,441,548.43  
3.08  
7  
011801096  
18 大唐发电 SCP002  
1,500,000  
150,072,007.69  
1.72  
8  
080217  
08 国开 17  
1,100,000

110,074,144.42

1.26

9

111713121

17 浙商银行 CD121

1,000,000

99,799,019.09

1.14

10

111881588

18 北京农商银行 CD053

1,000,000

99,788,723.24

1.14

7. “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

0

报告期内偏离度的最高值

0.0945%

报告期内偏离度的最低值

0.0409%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0637%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负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

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

1889046

18 交元 1A

2,000,000

36,180,000.00

0.41

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只资产支持证券。

## 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)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

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	90,240,779.28
4	应收申购款	11,599,523.89
5	其他应收款	527,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	102,367,303.17

## 十二、基金业绩

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。

（一）本报告期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

净值收益率①

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

2013 年 12 月 18 日（合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日

0.2667%

0.0012%

0.0134%

0.0000%

0.2533%

0.0012%

2014 年度

5.2938%

0.0026%

0.3500%

0.0000%

4.9438%

0.0026%

2015 年度

4.1726%

0.0046%

0.3500%

0.0000%

3.8226%

0.0046%

2016 年度

2.8984%

0.0045%

0.3510%

0.0000%

2.5474%

0.0045%

2017 年度

3.9213%

0.0010%

0.3500%

0.0000%

3.5713%

0.0010%

2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

2.0733%

0.0010%

0.1734%

0.0000%

1.8999%

0.0010%

2018年1月1日至2018年9月30日

3.0093%

0.0017%

0.2617%

0.0000%

2.7476%

0.0017%

(二)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

图：嘉实活期宝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

(2013年12月18日至2018年9月30日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，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)基金的销售服务费；
- (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、仲裁费和诉讼费；
- (6)基金份额持有人大会费用；
- (7)基金的证券交易费用；
- (8)基金的银行汇划费用；
- (9)基金的开户费用、账户维护费用；
- (10)基金的登记结算费用；
- (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。

##### 2、基金费用计提方法、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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人 and 基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前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0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“1、基金费用的种类”中第(4)–(11)项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

## (二) 与基金销售有关的费用

本基金不收取申购费用和赎回费用,但发生以下任一情形时除外:

(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下,当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时,为确保基金平稳运作,避免诱发系统性风险,本基金对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人应与基金托管人协商确认上述做法无益于本基金利益最大化的情形除外。

(2) 如本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%,当投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时,基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用。

## 2、基金销售服务费

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用。在通常情况下,基金份额的销售服务费年费率为 0.22%。计算方法如下:

$H = E \times R \div \text{当年天数}$

H 为基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为基金份额前一日的基金资产净值

R 为基金份额适用的基金销售服务费率

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销售服务费划付指令,经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,由基金管理人代收,基金管理人收到后支付给基金销售机构,专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

## 3、转换费

本基金在嘉实基金管理有限公司直销柜台上开放办理基金转换业务的基金包括:嘉实活钱包货币市场基金、嘉实薪金宝货币市场基金。

嘉实活期宝货币市场基金与嘉实活钱包货币市场基金、嘉实薪金宝货币市场基金之间互转时,不收取转换费用,但发生法规规定须征收强制赎回费的情况除外。

注:嘉实活期宝货币、嘉实薪金宝货币、嘉实活钱包货币有单日单个基金账户的累计申购(转入)限制,具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

## 4、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- (1) 基金管理人和基金托管人因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。

### （三）基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商一致，调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《公开募集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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它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有关财务数据的截止日期。
- 2.在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关内容。
- 3.在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关内容。
- 4.在“五、相关服务机构”部分：更新相关代销机构的信息。
- 5.在“十一、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
- 6.在“十二、基金的业绩”部分：基金业绩更新至 2018 年 9 月 30 日。
- 7.在“二十二、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2018 年 6 月 18 日至 2018 年 12 月 18 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 1 月 30 日