

# 嘉实货币市场基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 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

送出日期：2011 年 8 月 24 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。本半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 8 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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遵规守信情况的说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 债券回购融资情况.....	30
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	30
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	31
7.5 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.....	31
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	32
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	32
7.8 投资组合报告附注.....	32
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>33</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	33
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	33
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>33</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>33</b>

10.1 基金份额持有人大会决议.....	33
10.2 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 .....	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	34
10.4 基金投资策略的改变.....	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	34
10.9 其他重大事件.....	34
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>35</b>
11.1 备查文件目录.....	35
11.2 存放地点.....	36
11.3 查阅方式.....	36

## § 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	11,217,830,467.55 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》
----------------	---------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	209,634,310.37
本期利润	209,634,310.37
本期净值收益率	1.7466%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末基金资产净值	11,217,830,467.55
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
累计净值收益率	18.6102%

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。

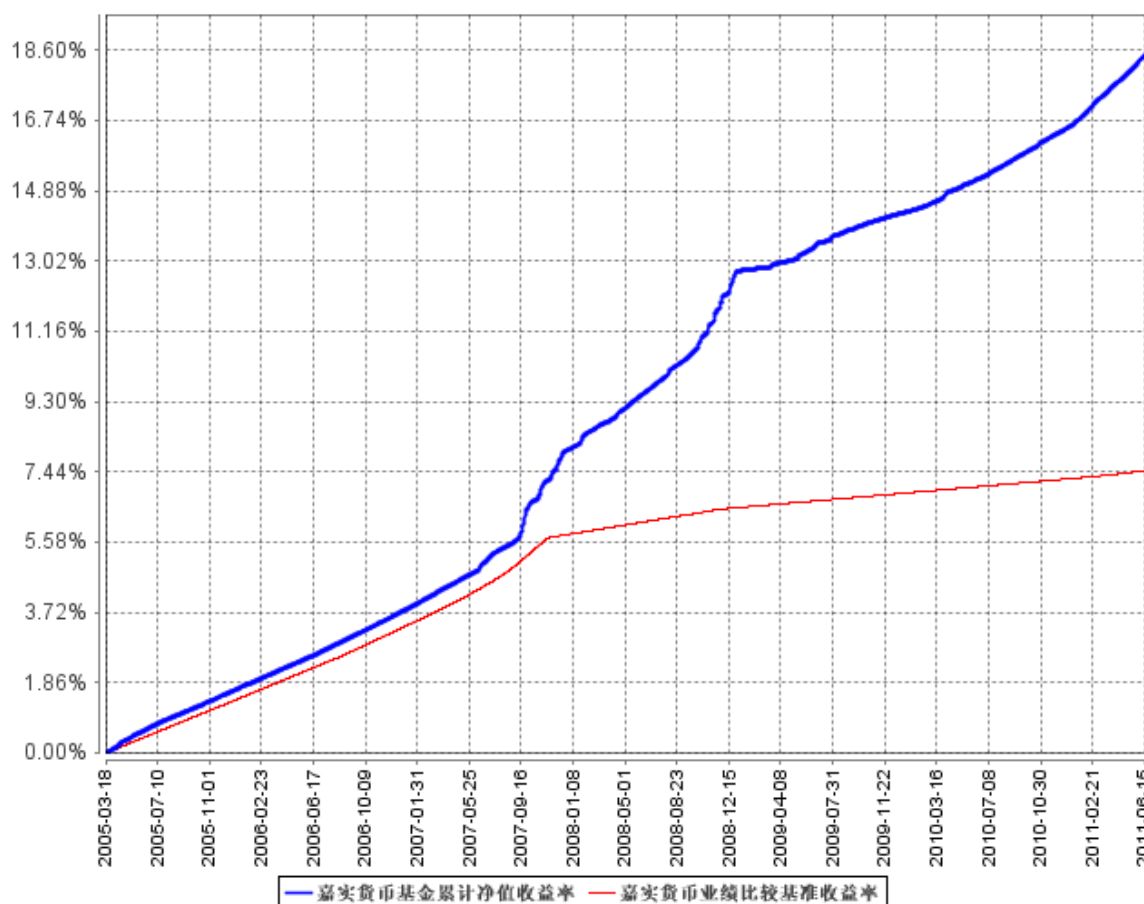
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	0.3167%	0.0067%	0.0410%	0.0000%	0.2757%	0.0067%
过去三个月	0.8763%	0.0039%	0.1231%	0.0001%	0.7532%	0.0038%
过去六个月	1.7466%	0.0040%	0.2174%	0.0002%	1.5292%	0.0038%
过去一年	2.8916%	0.0038%	0.3991%	0.0002%	2.4925%	0.0036%
过去三年	8.1332%	0.0112%	1.2613%	0.0003%	6.8719%	0.0109%
自基金合同生效起至今	18.6102%	0.0093%	7.4966%	0.0024%	11.1136%	0.0069%

### 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



图：嘉实货币市场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

(2005年3月18日至2011年6月30日)

注：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。

## § 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。

截止 2011 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、23 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、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏莉	本基金基金经理、嘉实超短债债券基金经理	2009 年 1 月 16 日	-	8	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遵规守信情况的说明

在报告期内，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

嘉实货币基金份额净值收益率为 1.7466%，投资风格相似的嘉实超短债债券基金份额净值增长率为 1.47%。

主要原因：嘉实货币持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值；嘉实超短债债券采用公允价值估值。报告期内，嘉实超短债债券的业绩中包含了市场波动带来的估值损失影响。

### 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

2011 年上半年，央行累计上调商业银行存款准备金率 6 次、升息 2 次，目前全市场平均存款准备金率已经达到约 21% 的历史高点。受到宏观紧缩政策的影响，上半年货币市场整体上处于资金不断收紧的过程中，其中在 1 月春节前和 6 月半年末前出现 2 次流动性极度紧张的状态。具体来说，春节前资金市场最具指导性的交易品种 7 天回购利率一度飙升至 8% 以上，但 2 月以后随着公开市场资金逐渐到期，市场流动性才逐步得到缓解。其后几个月 7 天回购利率主要维持在 2.0-3.5% 之间，整体处于稳定水平。但随着上半年央行数次调高商业银行存款准备金率，资金价格中枢逐渐抬高。随着半年末的到来，5 月下旬开始资金面再度出现大范围紧张局面。6 月银行间市场 7 天回购利率一度飙升至 9% 附近，紧张程度甚至超过春节前的情况。受到流动性紧张和资金成本高的影响，上半年央行公开市场操作回笼能力大幅下降，上半年公开市场累计净投放 14000 亿。央行为加强公开市场回笼能力不断提高央票发行利率，作为货币市场的基准利率产品，1 年期央票发行利率期间从 2.62% 升至 3.5%，累计升幅接近 100 个基点。央票发行利率的提高直接带动了短期利率产品整体收益率出现大幅上行。信用债方面，走势与利率产品类似，都受到资金面的影响呈现收益率大幅上行的走势。AAA 级别的短期融资券发行利率由 1 月时约 4% 的水平升至 6 月末超过 5% 的水平。其它各信用等级短融收益率也都随之出现调整。整体而言，今年上半年是货币市场资金利率出现大幅波动，短期债券收益率整体上行的时期。

2011 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务。操作中始终注意保持组合久期处于中性水平，通过在适当时机增加银行间逆回购等高收益品种来提高组合静态收益。流动性方面，则通过适度增加较高流动性的信用品种配置，在提高组合静态收益的同时提高组合流动性。通过上述操作，本基金上半年顺利应对了市场的大幅波动，且组合业绩持续改善。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金基金份额净值收益率为 1.7466%，同期业绩比较基准收益率为 0.2174%，本基金份额净值收益率超越业绩比较基准收益率 152.92 个基点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 11 年下半年，资金面将是影响货币市场的主要因素。今年以来，央行已经 6 次调高存款准备金率，准备金率继续调整的累计效应逐步显现，下半年继续提高存款准备金率的必要性在下降。但是由于通胀仍然处于高位，预计下半年货币政策仍将偏紧，资金价格难以出现趋势性回落。此外，由于目前商业银行存款准备金率达到历史高位，商业银行超额准备金率处于历史较低水平，下半年不能排除市场继续出现间歇性资金紧张的可能性。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，以确保组合安全性和流动性为首要任务，兼顾收益性。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、交易、基金运营、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，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。

#### 4.7 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二十三节三、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 209,634,310.37 元，每日分配，每月支付，合计分配 209,634,310.37 元，符合本基金基金合同的约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

### § 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 托管人对半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 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实货币市场基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,804,419,794.12	2,703,958,904.48
结算备付金		-	55,714,545.39
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,533,410,077.50	5,382,511,217.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,533,410,077.50	5,382,511,217.09
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,389,616,404.42	3,790,006,885.00
应收证券清算款		59,908,276.72	-
应收利息	6.4.7.5	104,296,426.37	62,258,228.66
应收股利		-	-
应收申购款		237,835,616.27	19,100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	40,000.00	40,000.00
资产总计		13,129,526,595.40	11,994,508,880.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,890,298,254.85	525,739,537.13
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,009,130.86	5,106,064.57
应付管理人报酬		4,065,121.79	2,774,197.30
应付托管费		1,231,855.09	840,665.83
应付销售服务费		3,079,637.74	2,101,664.58
应付交易费用	6.4.7.7	137,377.12	107,035.61
应交税费		35,940.00	35,940.00
应付利息		260,019.42	65,653.17
应付利润		10,446,169.49	7,101,945.84
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	132,621.49	162,112.32
负债合计		1,911,696,127.85	544,034,816.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	11,217,830,467.55	11,450,474,064.27
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,217,830,467.55	11,450,474,064.27
负债和所有者权益总计		13,129,526,595.40	11,994,508,880.62

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,217,830,467.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实货币市场基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		261,879,197.37	99,315,532.17
1. 利息收入		253,850,035.91	89,185,782.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,983,083.91	20,367,484.64
债券利息收入		92,777,740.57	46,844,472.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		89,089,211.43	21,973,825.21
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		8,029,161.46	10,129,749.60
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	8,029,161.46	10,129,749.60
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	6.4.7.13	-	-
<b>减：二、费用</b>		52,244,887.00	34,804,352.06
1. 管理人报酬		19,835,421.91	13,128,447.26
2. 托管费		6,010,733.88	3,978,317.33
3. 销售服务费		15,026,834.83	9,945,793.30
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		11,162,738.57	7,548,799.57
其中：卖出回购金融资产支出		11,162,738.57	7,548,799.57
6. 其他费用	6.4.7.15	209,157.81	202,994.60
<b>三、利润总额</b>		209,634,310.37	64,511,180.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		209,634,310.37	64,511,180.11

## 6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	11,450,474,064.27	-	11,450,474,064.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	209,634,310.37	209,634,310.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-232,643,596.72	-	-232,643,596.72
其中：1. 基金申购款	41,671,924,986.53	-	41,671,924,986.53
2. 基金赎回款	-41,904,568,583.25	-	-41,904,568,583.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-209,634,310.37	-209,634,310.37
五、期末所有者权益（基金净值）	11,217,830,467.55	-	11,217,830,467.55
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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）	-	64,511,180.11	64,511,180.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-15,323,418,446.92	-	-15,323,418,446.92
其中：1. 基金申购款	16,011,887,579.62	-	16,011,887,579.62
2. 基金赎回款	-31,335,306,026.54	-	-31,335,306,026.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-64,511,180.11	-64,511,180.11
五、期末所有者权益（基金净值）	6,552,144,850.55	-	6,552,144,850.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
赵学军  
基金管理公司负责人

\_\_\_\_\_  
李松林  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
王红  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

报告期内，本基金不存在重大会计差错事项。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	4,419,794.12
定期存款	2,800,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	1,800,000,000.00
3 个月至 1 年	1,000,000,000.00
其他存款	-
合计：	2,804,419,794.12

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30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	6,533,410,077.50	6,513,696,000.00	-19,714,077.50	-0.1757%
	合计	6,533,410,077.50	6,513,696,000.00	-19,714,077.50	-0.1757%

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。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2011年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 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 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产款	3,389,616,404.42	-
交易所市场买入返售金融资产款	-	-
合计	3,389,616,404.42	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2011年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	821.65
应收定期存款利息	18,243,597.68
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	60,905,687.63
应收买入返售证券利息	25,127,804.55
应收申购款利息	18,514.86
其他	-
合计	104,296,426.37

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
其他应收款	40,000.00
待摊费用	-
合计	40,000.00

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	137,377.12
合计	137,377.12

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,141.04
预提费用	118,480.45
合计	132,621.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,450,474,064.27	11,450,474,064.27
本期申购	41,671,924,986.53	41,671,924,986.53
本期赎回	-41,904,568,583.25	-41,904,568,583.25
本期末	11,217,830,467.55	11,217,830,467.55

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	209,634,310.37	-	209,634,310.37
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	-209,634,310.37	-	-209,634,310.37
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	127,989.69
定期存款利息收入	71,444,959.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	40,194.00
其他	369,941.20
合计	71,983,083.91

#### 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	7,120,975,235.35
减:卖出债券及债券到期兑付成本总额	7,045,281,688.02
减:应收利息总额	67,664,385.87
债券投资收益	8,029,161.46

#### 6.4.7.13 其他收入

本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金无其他收入。

#### 6.4.7.14 交易费用

本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金无交易费用。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	50,346.62
债券托管账户维护费	8,926.92
银行划款手续费	85,419.31
合计	209,157.81

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无重大或有事项。

##### 6.4.8.2 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7号收益支付公告	2011年7月19日	2011年6月20日至2011年7月19日
2011年第8号收益支付公告	2011年8月22日	2011年7月20日至2011年8月21日

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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,835,421.91	13,128,447.26
其中:支付销售机构的客户维护费	3,221,196.37	1,978,873.99

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。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,010,733.88	3,978,317.33

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 0.1%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 × 0.1% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.3 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
	2011年1月1日至2011年6月30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	5,606,787.58
中国银行	1,038,389.28

国都证券有限责任公司	26,879.21
合计	6,672,056.07
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	3,236,829.07
中国银行	958,938.41
国都证券有限责任公司	7,950.99
合计	4,203,718.47

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。

#### 6.4.10.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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	282,365,725.76	201,819,659.92	-	-	19,585,127,000.00	2,785,276.91
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	654,238,239.53	406,457,512.33	-	-	77,631,570,000.00	4,734,325.36

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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（2011年1月1日至2011年6月30日）及上年度可比期间（2010年1月1日至2010年6月30日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本期末（2011年6月30日）及上年度末（2010年12月31日），其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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	4,419,794.12	127,989.69	3,658,719.37	6,676,811.26

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（2011 年 6 月 30 日），本基金无存于中国银行的定期存款，本期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日），由中国银行保管的银行存款产生的利息收入无定期存款利息收入；上期末（2010 年 6 月 30 日），本基金无存于中国银行的定期存款，上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日），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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.11 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
175,835,115.44	30,454,971.28	3,344,223.65	209,634,310.37	-

#### 6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2011 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 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 1,890,298,254.85 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
010220	01 国开 20	2011 年 7 月 1 日	99.76	500,000	49,880,000.00
090213	09 国开 13	2011 年 7 月 1 日	101.14	1,400,000	141,596,000.00
100226	10 国开 26	2011 年 7 月 1 日	99.62	1,000,000	99,620,000.00
100231	10 国开 31	2011 年 7 月 1 日	99.71	3,200,000	319,072,000.00
100236	10 国开 36	2011 年 7 月 1 日	100.98	3,000,000	302,940,000.00
110206	11 国开 06	2011 年 7 月 1 日	100.48	800,000	80,384,000.00
110217	11 国开 17	2011 年 7 月 1 日	100.41	8,500,000	853,485,000.00

1101023	11 央行票据 23	2011 年 7 月 1 日	99.89	1,000,000	99,890,000.00
1181065	11 武钢 CP01	2011 年 7 月 1 日	100.00	310,000	31,000,000.00
合计				19,710,000	1,977,867,000.00

#### 6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本期末（2011 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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工作流程、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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	4,080,193,507.96	3,709,867,837.01
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	4,080,193,507.96	3,709,867,837.01

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。

##### 6.4.13.2.2 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 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	406,334,882.00	322,716,099.59
AAA 以下	-	-



未评级	-	-
合计	406,334,882.00	322,716,099.59

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。

#### 6.4.13.3 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%。

#### 6.4.13.3.1 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 2011 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	合计
资产					
银行存款	2,854,746,009.11	-	-	-	2,854,746,009.11
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	2,354,585,231.58	2,641,229,219.56	1,129,788,320.00	1,101,851,250.00	7,227,454,021.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,465,407,590.25	-	-	-	3,465,407,590.25
应收证券清算款	59,908,276.72	-	-	-	59,908,276.72
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	237,854,131.13	-	-	-	237,854,131.13
其他资产	40,000.00	-	-	-	40,000.00
资产总计	8,972,541,238.79	2,641,229,219.56	1,129,788,320.00	1,101,851,250.00	13,845,410,028.35
负债					

卖出回购金融资 产款	1,890,558,274.27	-	-	-	1,890,558,274.27
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	2,009,130.86	-	-	-	2,009,130.86
应付管理人报酬	4,065,121.79	-	-	-	4,065,121.79
应付托管费	1,231,855.09	-	-	-	1,231,855.09
应付销售服务费	3,079,637.74	-	-	-	3,079,637.74
应付交易费用	137,377.12	-	-	-	137,377.12
应交税费	35,940.00	-	-	-	35,940.00
应付利润	10,446,169.49	-	-	-	10,446,169.49
其他负债	132,621.49	-	-	-	132,621.49
负债总计	1,911,696,127.85	-	-	-	1,911,696,127.85
流动性净额	7,060,845,110.94	2,641,229,219.56	1,129,788,320.00	1,101,851,250.00	11,933,713,900.50
上年度末 2010 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	合计
资产					-
银行存款	2,721,147,626.71	-	-	-	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	1,028,450,302.46	3,490,736,824.66	1,139,450,480.00	-	5,658,637,607.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,817,517,589.04	-	-	-	3,817,517,589.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
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	7,622,889,163.60	3,490,736,824.66	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	7,078,657,387.74	3,490,736,824.66	1,139,450,480.00	-	11,708,844,692.40

注：表中所示金额为未折现合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	2,804,419,794.12	-	-	-	2,804,419,794.12
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	4,062,491,495.69	2,470,918,581.81	-	-	6,533,410,077.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,389,616,404.42	-	-	-	3,389,616,404.42
应收证券清算款	-	-	-	59,908,276.72	59,908,276.72
应收利息	-	-	-	104,296,426.37	104,296,426.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	204,745,451.88	-	-	33,090,164.39	237,835,616.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	40,000.00	40,000.00
资产总计	10,461,273,146.11	2,470,918,581.81	-	197,334,867.48	13,129,526,595.40
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,890,298,254.85	-	-	-	1,890,298,254.85
应付证券清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	2,009,130.86	2,009,130.86
应付管理人报酬	-	-	-	4,065,121.79	4,065,121.79
应付托管费	-	-	-	1,231,855.09	1,231,855.09
应付销售服务费	-	-	-	3,079,637.74	3,079,637.74
应付交易费用	-	-	-	137,377.12	137,377.12
应交税费	-	-	-	35,940.00	35,940.00
应付利息	-	-	-	260,019.42	260,019.42
应付利润	-	-	-	10,446,169.49	10,446,169.49
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	132,621.49	132,621.49
负债总计	1,890,298,254.85	-	-	21,397,873.00	1,911,696,127.85
利率敏感度缺口	8,570,974,891.26	2,470,918,581.81	-	-175,936,994.48	11,217,830,467.55
上年度末 2010年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	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
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	2,004,985,479.78	3,377,525,737.31	-	-	5,382,511,217.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,790,006,885.00	-	-	-	3,790,006,885.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	62,258,228.66	62,258,228.66
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	19,100.00	19,100.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
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					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	525,739,537.13	-	-	-	525,739,537.13
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
应付利息	-	-	-	65,653.17	65,653.17
应付利润	-	-	-	7,101,945.84	7,101,945.84
递延所得税负债	-	-	-	-	-
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

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 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(2010 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.4 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。

#### 6.4.14 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)。

2011 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具均属于第二层级，无属于第一

层级和第三层级的余额。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	6,533,410,077.50	49.76
	其中：债券	6,533,410,077.50	49.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,389,616,404.42	25.82
	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	2,804,419,794.12	21.36
4	其他各项资产	402,080,319.36	3.06
5	合计	13,129,526,595.40	100.00

### 7.2 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	6.23	
	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	1,890,298,254.85	16.85
	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) 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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	134
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	138
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

注：报告期内投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

#### 7.3.2 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	13.78	16.85
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.26	-
2	30 天(含)—60 天	16.7	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.72	-
3	60 天(含)—90 天	19.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	10.31	-
4	90 天(含)—180 天	39.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.62	-
5	180 天(含)—397 天(含)	25.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		113.99	16.85

#### 7.4 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	199,888,942.15	1.78
3	金融债券	1,846,994,795.35	16.46
	其中：政策性金融债	1,846,994,795.35	16.46
4	企业债券	406,332,832.04	3.62
5	企业短期融资券	4,080,193,507.96	36.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	6,533,410,077.50	58.24
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,784,742,584.46	15.91

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。

#### 7.5 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	110217	11 国开 17	8,500,000	853,499,604.61	7.61
2	058031	05 中信债 1	4,060,000	406,332,832.04	3.62
3	100231	10 国开 31	3,200,000	319,082,757.77	2.84
4	100236	10 国开 36	3,000,000	302,927,710.28	2.70

5	1181281	11 华谊 CP01	2,800,000	279,931,735.00	2.50
6	1081325	10 沪城控 CP01	1,700,000	169,837,711.09	1.51
7	1081316	10 横店 CP01	1,500,000	149,804,891.73	1.34
8	090213	09 国开 13	1,400,000	141,600,064.03	1.26
9	1181267	11 洛钼 CP01	1,400,000	140,239,045.22	1.25
10	1181274	11 国电集 CP02	1,400,000	140,010,360.12	1.25

## 7.6 “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	0.1490%
报告期内偏离度的最低值	-0.1757%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0926%

注：表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

## 7.8 投资组合报告附注

**7.8.1** 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。

**7.8.2** 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%。

**7.8.3** 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。

### 7.8.4 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	59,908,276.72
3	应收利息	104,296,426.37
4	应收申购款	237,835,616.27
5	其他应收款	40,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	402,080,319.36



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
84,983	132,000.88	5,346,606,404.63	47.66%	5,871,224,062.92	52.34%

### 8.2 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	3,114,824.62	0.03%

## § 9 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	11,450,474,064.27
本报告期基金总申购份额	41,671,924,986.53
减：本报告期基金总赎回份额	41,904,568,583.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	11,217,830,467.55

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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的情况

2011年5月起，王忠民先生因任期届满并退休，不再担任本基金管理人董事长职务，公司董事兼总经理赵学军先生代任董事长职务；2011年8月起安奎先生任本基金管理人董事长。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职

资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，报告期内未改聘。

### 10.6 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。

### 10.7 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	交易单元数量	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	3,564,200,000.00	100.00%	-	-	-

### 10.8 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%。

### 10.9 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	关于旗下基金在交通银行开办定投起点金额调整的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 1 月 5 日
2	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2011 年第 1 号）	中国证券报、管理人网站	2011 年 1 月 20 日
3	关于旗下开放式基金通过天相投顾开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 1 月 24 日
4	关于嘉实货币 2011 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	2011 年 1 月 28 日
5	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2011 年第 2 号）	中国证券报、管理人网站	2011 年 2 月 21 日
6	关于交通银行开办嘉实旗下基金日常转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 2 月 22 日
7	关于嘉实货币市场基金收益支付的	中国证券报、管理人网站	2011 年 3 月 21 日

	公告（2011 年第 3 号）		
8	关于增加高华证券为嘉实增长混合等基金代销机构的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 3 月 24 日
9	关于对中国工商银行借记卡持有人开通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	2011 年 3 月 25 日
10	关于嘉实货币 2011 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	2011 年 3 月 29 日
11	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2011 年第 4 号）	中国证券报、管理人网站	2011 年 4 月 20 日
12	关于增加烟台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	2011 年 4 月 22 日
13	关于嘉实货币 2011 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	2011 年 4 月 26 日
14	关于旗下开放式基金通过中信证券开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 5 月 4 日
15	嘉实基金管理有限公司董事长变更公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 5 月 11 日
16	关于增加浙江稠州商业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	2011 年 5 月 18 日
17	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2011 年第 5 号）	中国证券报、管理人网站	2011 年 5 月 20 日
18	关于旗下开放式基金通过烟台银行开办定投业务的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 5 月 25 日
19	关于嘉实货币 2011 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	2011 年 5 月 31 日
20	关于对中国工商银行借记卡持卡人通过嘉实直销网上交易的在线支付方式申购费率优惠促销的公告	中国证券报、管理人网站	2011 年 6 月 9 日
21	关于嘉实货币市场基金收益支付的公告（2011 年第 6 号）	中国证券报、管理人网站	2011 年 6 月 20 日
22	关于增加哈尔滨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	2011 年 6 月 24 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

## 11.2 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

## 11.3 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](mailto:service@jsfund.cn)。

**嘉实基金管理有限公司**  
**2011 年 8 月 24 日**