

嘉实安心货币市场基金 2015 年 半年度报告摘要

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：2015 年 8 月 29 日

§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 2015 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实安心货币市场基金	
基金简称	嘉实安心货币	
基金主代码	070028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 12 月 28 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	5,307,909,559.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B
下属分级基金的交易代码:	070028	070029
报告期末下属分级基金的份额总额	176,610,332.26 份	5,131,299,227.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金以确保组合安全性为首要任务，兼顾流动性和收益性。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	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本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。

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	王永民
	联系电话	(010) 66594896
	电子邮箱	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010) 65182266	(010) 66594942

2.4 信息披露方式

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
-------------	------------------------------------

§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

基金级别	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,359,662.72	35,180,935.82
本期利润	3,359,662.72	35,180,935.82
本期净值收益率	1.6585%	1.7814%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	176,610,332.26	5,131,299,227.55
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	11.8393%	12.7871%

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）嘉实安心货币 A 与嘉实安心货币 B 适用不同的销售服务费率；（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（4）本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实安心货币 A

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	0.2000%	0.0020%	0.1110%	0.0000%	0.0890%	0.0020%
过去三个月	0.6928%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.3562%	0.0020%
过去六个月	1.6585%	0.0027%	0.6695%	0.0000%	0.9890%	0.0027%
过去一年	3.5963%	0.0025%	1.3500%	0.0000%	2.2463%	0.0025%
过去三年	10.2307%	0.0034%	4.0505%	0.0000%	6.1802%	0.0034%
自基金合同 生效起至今	11.8393%	0.0034%	4.8035%	0.0001%	7.0358%	0.0033%

嘉实安心货币 B

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	0.2197%	0.0020%	0.1110%	0.0000%	0.1087%	0.0020%
过去三个月	0.7539%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.4173%	0.0020%
过去六个月	1.7814%	0.0027%	0.6695%	0.0000%	1.1119%	0.0027%
过去一年	3.8471%	0.0025%	1.3500%	0.0000%	2.4971%	0.0025%
过去三年	11.0289%	0.0034%	4.0505%	0.0000%	6.9784%	0.0034%
自基金合同 生效起至今	12.7871%	0.0034%	4.8035%	0.0001%	7.9836%	0.0033%

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

嘉实安心货币A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

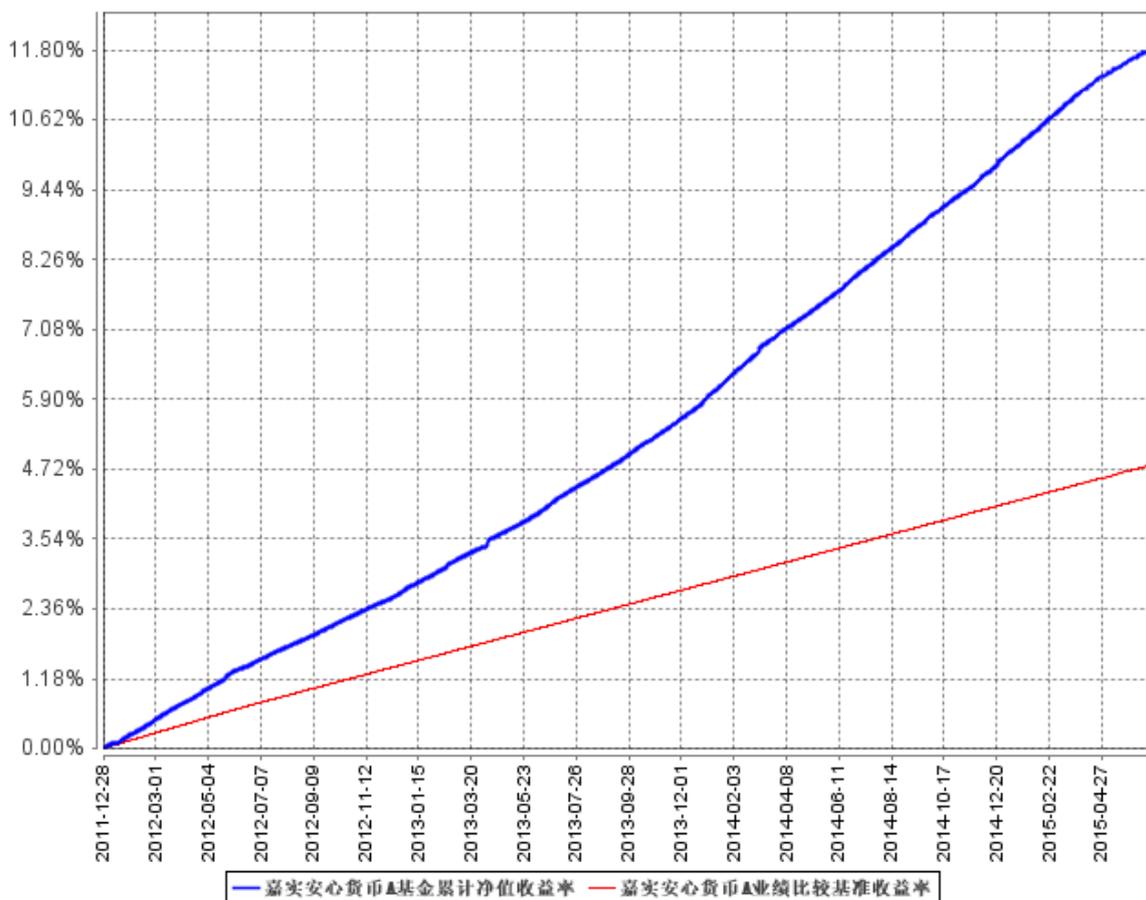


图 1：嘉实安心货币 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 12 月 28 日至 2015 年 6 月 30 日)

嘉实安心货币B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

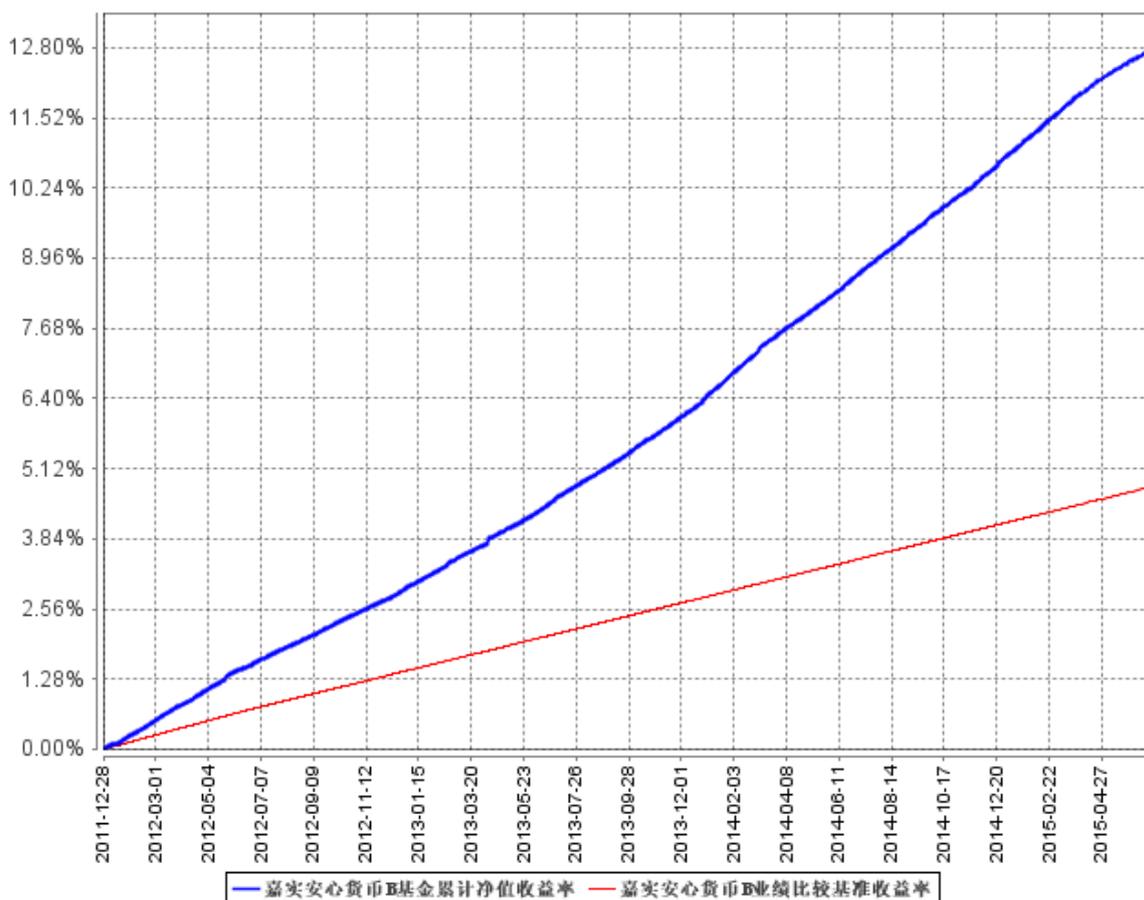


图 2：嘉实安心货币 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 12 月 28 日至 2015 年 6 月 30 日)

注 1：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（十四（二）投资范围和（八）投资组合比例限制）的有关约定。

注 2：2015 年 5 月 14 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实安心货币基金经理的公告》，增聘李瞳先生担任本基金基金经理职务，与基金经理魏莉女士、张文玥女士共同管理本基金。

§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 2015 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、73 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、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 300ETF 联接 (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、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、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、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实 1 个月理财债券、嘉实薪金宝货币基金经理	2013 年 12 月 19 日	-	12 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。
张文玥	本基金、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实 1 个月理财债券、嘉实 3 个月理财债券基金经理	2014 年 8 月 13 日	-	7 年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司现金管理部。硕士，具有基金从业资格。
李瞳	本基金、理财宝 7 天债券、嘉实活钱包货币基金经理	2015 年 5 月 14 日	-	5 年	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。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）任职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、《嘉实安心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，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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；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投资组合。

4.3.2 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

随着国内外发展环境的变化，我国正在经历经济增速的“换档期”。2011 年至 2014 年，国内生产总值同比增速由 9.5%持续下降至 7.4%；今年上半年进一步下调到 7%。

从经济数据来看，一季度我国国内生产总值同比增长 7.0%，创 2009 年 3 月以来的最低值，季调环比增长 1.4%；二季度我国国内生产总值同比增长 7.0%，季调环比增长 1.7%。受益于是政府稳增长措施、深化改革的继续推进和宽松的货币政策执行，二季度以来，经济初步显现企稳迹象。具体来看，工业增加值同比增速由一季度低点 3 月份的 5.6%小幅回升至 6 月份的 6.8%；“克强指数”由一季度低点 2 月份的-0.58%回升至 6 月份的 2.59%；中国制造业采购经理指数（PMI）由一季度低点 49.8%小幅回升至 50.2%。2015 年上半年以投资、消费和出口为代表的“三驾马车”增速持续处于低位，2015 年上半年固定资产投资有所回落，累计同比增速由年初 13.9%跌至 11.4%，其中房地产开发投资累计同比增速由年初 10.4%跌至 4.6%，基础设施投资累计同比增速由年初 20.79%跌至 19.19%，民间固定资产投资累计同比增速由年初 14.67%跌至 11.40%；社会消费品零售总额较为平稳，由年初 10.71%略降至 10.40%；进出口总额同比下降 6.9%。其中，出口同比增长 0.9%，进口同比下降 15.5%。另外，上半年物价水平保持低位，通缩压力逐步减轻，上半年，居民消费价格同比上涨 1.3%，工业生产者出厂价格同比下降 4.6%。从金融数据来看，货币供应量逐步回升，M2 同比增速由年初的 10.8%回升至 11.8%；社会融资规模逐步回升，由上半年低位 4 月份的 10557 亿元升至 6 月份的 18581 亿元；新增人民币贷款逐步改善，由上半年低位 4 月份的 7079 亿元升至 6 月份的 12806 亿元。人民币汇率由一季度的小幅贬值转为二季度的平稳，上半年外汇占款合计减少 2517 亿元，同比减少 10727 亿元；央行外汇

资产合计减少 3532 亿元，同比减少 11393 亿元，跨境资金流出规模较大。

一季度，为兼顾维稳人民币汇率和应对经济下行风险，央行货币政策“明松暗紧”；二季度，为降低社会融资成本、维稳经济和配合地方债务置换等，央行货币政策持续放松，“全面+定向”政策工具齐上阵。银行间市场资金利率快速下行，二季度末隔夜、7 天、1 个月和 3 个月回购加权利率较一季度末分别下降 201BP、117BP、142BP 和 175BP；银行间市场国债收益率曲线也大幅下移，二季度末国债收益率曲线 1 年、3 年、5 年、7 年和 10 年期收益率较一季度末分别下降 149BP、41BP、25BP、7BP 和 5BP，10 年期与 1 年期国债期限利差为 186BP，较一季度末扩大 144BP。

2015 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；组合持仓以短期利率债、优质短融、同业存款和交易所回购为主，合理管理现金流分布，保障组合充足流动性。根据判断市场情况优化久期配置，在实现组合较好静态收益的同时，减小组合承担的利率风险。整体看，2015 年上半年本基金成功应对了市场和规模波动，投资业绩平稳提高，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实安心货币 A 的基金份额净值收益率为 1.6585%，嘉实安心货币 B 的基金份额净值收益率为 1.7814%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年 7 月 9 日，国际货币基金组织（IMF）将 2015 年全球经济增长预期从 3.5% 下调至 3.3%，IMF 指出下调今年全球经济预期因为发达国家经济恢复放缓，发展中国家表现疲软。IMF 预计 2016 年的增长将回到 3.8% 的水平。本次全球经济增速遭下调主要受到美国的影响，IMF 将美国 2015 年增长预期从 3.1% 大幅下调至 2.5%，另外维持了欧元区 2015 年经济增长 1.5% 的预期和中国 2015 年经济增长 6.8% 的预期。

展望 2015 年下半年，国际经济环境依然复杂，政策分化将持续，美联储下半年加息概率较大，希腊债务危机的进一步发展或冲击欧洲基金，新兴市场继续面临经济疲软、资本外流的压力。在政府前期宏观政策的刺激下，中国经济短期内有望企稳。2015 年下半年国内经济压力或有所减少，一方面是受基数的影响，另一方面，是受上半年新出台很多经济刺激政策，政策效应将会在下半年逐渐体现。但是国内经济稳定基础并不牢固，需政策进一步刺激给力。

由于产能过剩和实际利率水平过高，信用风险开始逐渐暴露。2015 年 4 月 7 日，中国债市

迎来第一单公募债券 ST 湘鄂债本金违约。4 月 21 日，天威集团因未能按期支付所发中票利息，成为首家债券违约的国企。4 月 25 日珠海中富发布公告，宣布债务违约，成为年内第三只违约债券。

在稳增长压力仍然较大、积极财政政策后续需加大发力、地方政府债务置换和美联储加息预期下资本流出的背景下，2015 年下半年货币政策将延续稳健基调，偏松的货币调控方向不会发生根本变化，但政策节奏和结构或有所调整，巩固宽松效果，突显定向方针，维稳汇率，平抑资金波动，关注重点为经济、通胀、汇率和股市。

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，平衡配置同业存款和债券投资，谨慎控制组合的信用配置，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动，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、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，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，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

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十九（二）收益分配原则“2. “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。4. 本基金每日进行收益计算并分配，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 A 类份额已实现收益为 3,359,662.72 元，每日分配，每月支付，合计分配 3,359,662.72 元，B 类份额已实现收益为 35,180,935.82 元，每日分配，每月支付，合计分配 35,180,935.82 元，符合本基金基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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”）在对嘉实安心货币市场基金（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：嘉实安心货币市场基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,082,761,229.73	621,240,758.01
结算备付金		16,582,500.00	19,340,000.00
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	802,109,996.55	580,336,417.46
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		802,109,996.55	580,336,417.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,338,002,045.00	2,353,400,000.00
应收证券清算款		50,137,016.57	-
应收利息	6.4.7.5	18,923,648.78	17,916,943.43
应收股利		-	-
应收申购款		2,779,813.48	52,745,891.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	141,111.00	-
资产总计		5,311,437,361.11	3,644,980,010.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		891,998.89	228,865.46
应付管理人报酬		625,769.08	592,231.59
应付托管费		189,627.03	179,464.13
应付销售服务费		47,715.78	45,151.95
应付交易费用	6.4.7.7	12,361.50	3,876.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		1,470,977.80	2,455,351.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	289,351.22	369,000.00
负债合计		3,527,801.30	3,873,941.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,307,909,559.81	3,641,106,069.30
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		5,307,909,559.81	3,641,106,069.30
负债和所有者权益总计		5,311,437,361.11	3,644,980,010.48

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，嘉实安心货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 176,610,332.26 份；嘉实安心货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,131,299,227.55 份。嘉实安心货币基金份额总额合计为 5,307,909,559.81 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实安心货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		43,860,861.17	15,827,935.07
1.利息收入		42,963,366.04	15,394,935.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,654,672.80	4,262,787.18
债券利息收入		10,877,233.88	3,832,903.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,431,459.36	7,299,244.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益		897,495.13	432,999.44
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	897,495.13	432,999.44
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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	-	-
减：二、费用		5,320,262.63	1,814,581.84
1. 管理人报酬		3,636,282.50	1,137,090.45
2. 托管费		1,101,903.86	344,572.83
3. 销售服务费		347,455.81	113,553.56
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	234,620.46	219,365.00
三、利润总额		38,540,598.54	14,013,353.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润		38,540,598.54	14,013,353.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实安心货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,636,282.50	1,137,090.45
其中：支付销售机构的客户维护费	33,788.90	34,008.72

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,101,903.86	344,572.83

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。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B	合计
嘉实基金管理有限公司	160,073.83	100,052.24	260,126.07
中国银行	23,283.80	-	23,283.80
合计	183,357.63	100,052.24	283,409.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B	合计
嘉实基金管理有限公司	8,736.37	30,473.74	39,210.11
中国银行	15,337.93	66.99	15,404.92
合计	24,074.30	30,540.73	54,615.03

注：（1）嘉实安心货币 A 类基金份额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。对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日 A 类基金份额销售服务费 = 前一日 A 类基金份额资产净值 × 0.25% / 当年天数。

（2）嘉实安心货币 B 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给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。对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费

率。其计算公式为：日 B 类基金份额销售服务费 = 前一日 B 类基金份额资产净值 × 0.01% / 当年天数。

6.4.4.3 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	-	229,093,860.27	676,000,000.00	183,548.43	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	-	20,143,635.34	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B
基金合同生效日（2011 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	304,233,169.72
期间申购/买入总份额	-	444,272,292.81
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	640,000,000.00
期末持有的基金份额	-	108,505,462.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.11%

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B
基金合同生效日（2011 年 12 月 28 日）持有	-	-

的基金份额		
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	300,632,909.46
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	300,632,909.46
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：本报告期内（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖嘉实安心货币A类份额，管理人持有的B类份额期间申购/买入总份额含红利再投份额。

6.4.4.4.2 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（2015年6月30日）及上年度末（2014年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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	702,761,229.73	4,582,853.36	71,108,509.71	1,184,029.98

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（2015年6月30日）由中国银行保管的银行存款余额含定期存款700,000,000元，本期（2015年1月1日至2015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4,497,009.76元。（3）上年度可比期间末（2014年6月30日），由中国银行保管的银行存款余额含定期存款50,000,000.00元，上年度可比期间（2014年1月1日至2014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1,120,522.91元。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015年1月1日至2015年6月30日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014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。

6.4.5 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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（2015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。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	802,109,996.55	15.10
	其中：债券	802,109,996.55	15.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,338,002,045.00	62.85
	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	1,099,343,729.73	20.70
4	其他各项资产	71,981,589.83	1.36
	合计	5,311,437,361.11	100.00

7.2 债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。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	14
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	44
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	12

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 75 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	85.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	0.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	1.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	1.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.65	-

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	-	-
3	金融债券	300,365,406.45	5.66
	其中：政策性金融债	300,365,406.45	5.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	320,513,683.06	6.04
6	中期票据	181,230,907.04	3.41
7	其他	-	-
	合计	802,109,996.55	15.11
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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序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	1282287	12 电网 MTN1	1,800,000	181,230,907.04	3.41
2	011599045	15 中油股 SCP001	1,800,000	180,554,644.87	3.40
3	140443	14 农发 43	1,100,000	110,151,662.84	2.08
4	100234	10 国开 34	900,000	90,185,428.33	1.70
5	011599189	15 中油股 SCP002	800,000	79,918,488.43	1.51
6	011599019	15 中电信 SCP002	600,000	60,040,549.76	1.13
7	100220	10 国开 20	500,000	50,021,909.33	0.94
8	140223	14 国开 23	200,000	20,029,449.81	0.38
9	100230	10 国开 30	200,000	20,008,770.07	0.38
10	140352	14 进出 52	100,000	9,968,186.07	0.19

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1201%
报告期内偏离度的最低值	0.0065%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0442%

7.7 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

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	50,137,016.57
3	应收利息	18,923,648.78
4	应收申购款	2,779,813.48
5	其他应收款	141,111.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	71,981,589.83

§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

份额级别	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
嘉实安心货币 A	2,314	76,322.53	9,891,761.01	5.60%	166,718,571.25	94.40%
嘉实安心货币 B	30	171,043,307.59	5,131,299,227.55	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,344	2,264,466.54	5,141,190,988.56	96.86%	166,718,571.25	3.14%

注：(1) 嘉实安心货币 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实安心货币 A 份额占嘉实安心货币 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实安心货币 A 份额占嘉实安心货币 A 总份额比例；

(2) 嘉实安心货币 B: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实安心货币 B 份额占嘉实安心货币 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实安心货币 B 份额占嘉实安心货币 B 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	嘉实安心货	4,659.81	0.00%

持有本基金	币 A		
	嘉实安心货币 B	0.00	0.00%
	合计	4,659.81	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实安心货币 A	0~10
	嘉实安心货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实安心货币 A	0
	嘉实安心货币 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B
基金合同生效日（2011 年 12 月 28 日）基金份额总额	343,887,031.85	1,427,980,425.81
本报告期期初基金份额总额	330,696,785.90	3,310,409,283.40
本报告期基金总申购份额	2,970,036,604.08	8,736,526,192.43
减：本报告期基金总赎回份额	3,124,123,057.72	6,915,636,248.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	176,610,332.26	5,131,299,227.55

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升降级调增份额；基金总赎回份额含转换出及基金份额自动升降级调减份额。

§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情况

2015 年 5 月 14 日，本基金管理人发布《关于新增嘉实安心货币基金经理的公告》，聘请李瞳先生担任本基金基金经理，与现任基金经理魏莉女士、张文玥女士共同管理本基金。

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	

华泰证券股份 有限公司	3	27,427,700,000.00	100.00%	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	5	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
安信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	4	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-

国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	新增 2 个
东吴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-

中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

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%。

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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日