

嘉实货币市场基金 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。本半年度报告已经由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	41,534,876,907.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实货币 A	嘉实货币 B
下属分级基金的交易代码:	070008	070088
报告期末下属分级基金的份额总额	29,772,796,624.42 份	11,762,080,283.53 份

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	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	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	嘉实货币 A	嘉实货币 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	706,579,725.51	275,799,742.95
本期利润	706,579,725.51	275,799,742.95
本期净值收益率	2.2988%	2.4207%
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	29,772,796,624.42	11,762,080,283.53
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	40.9807%	12.6544%

注：（1）2012 年 12 月 13 日本基金管理人发布“关于嘉实货币市场基金实施基金份额分类修改基金合同、招募说明书、托管协议”的公告，自 2012 年 12 月 17 日起，本基金分为嘉实货币 A、嘉实货币 B。投资者可申购嘉实货币 B，同时根据基金份额分类规则予以升级或降级处理；

（2）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；

（3）嘉实货币 A 与嘉实货币 B 适用不同的销售服务费率；（4）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（5）自 2014 年 6 月 16 日起本基金收益分配从按月结转份额调整为按日结转份额。

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	0.3071%	0.0033%	0.0287%	0.0000%	0.2784%	0.0033%
过去三个月	1.1466%	0.0071%	0.0871%	0.0000%	1.0595%	0.0071%

过去六个月	2.2988%	0.0055%	0.1734%	0.0000%	2.1254%	0.0055%
过去一年	4.6779%	0.0047%	0.3500%	0.0000%	4.3279%	0.0047%
过去三年	13.7599%	0.0040%	1.0544%	0.0000%	12.7055%	0.0040%
自基金合同生效起至今	40.9807%	0.0082%	9.1678%	0.0021%	31.8129%	0.0061%

嘉实货币 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	0.3271%	0.0033%	0.0287%	0.0000%	0.2984%	0.0033%
过去三个月	1.2071%	0.0071%	0.0871%	0.0000%	1.1200%	0.0071%
过去六个月	2.4207%	0.0055%	0.1734%	0.0000%	2.2473%	0.0055%
过去一年	4.9292%	0.0047%	0.3500%	0.0000%	4.5792%	0.0047%
自基金合同生效起至今	12.6544%	0.0040%	0.8903%	0.0000%	11.7641%	0.0040%

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

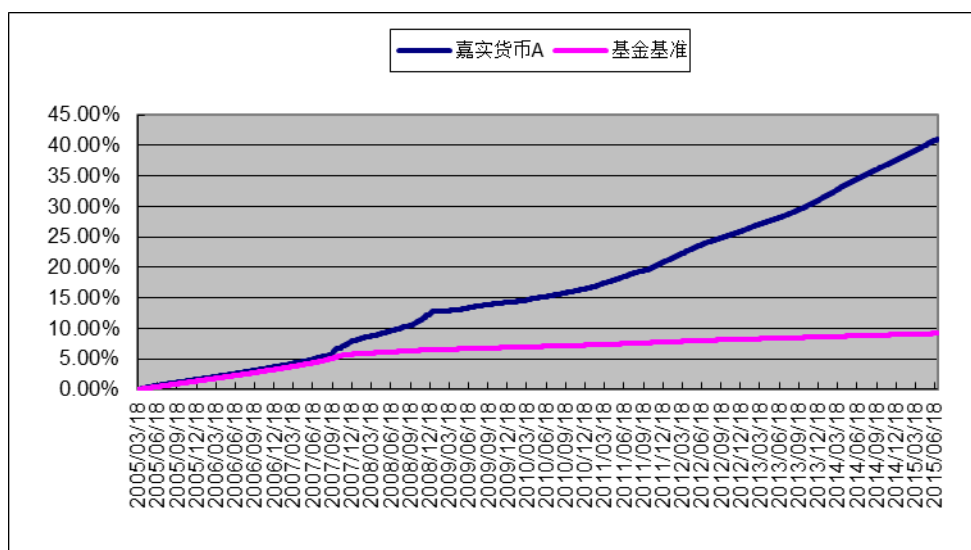


图 1: 嘉实货币 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005 年 3 月 18 日至 2015 年 6 月 30 日)

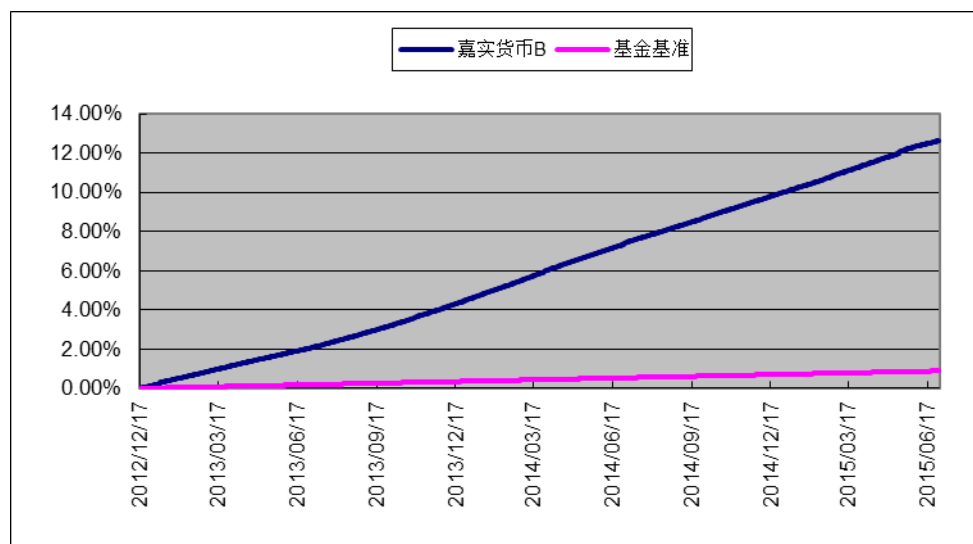


图 2: 嘉实货币 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 12 月 17 日至 2015 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 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	本基金基金经理、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、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	2009 年 1 月 16 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。
--	--	--	--	--	----

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合规守信情况的说明

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，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，本基金未发生异常交易行为。

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

2015 年上半年，资金面是货币市场的关键性主导因素。年初市场资金面延续了 14 年末的紧张状况，但每月数据显示宏观经济下行压力加大，春节后央行货币政策逐步调整，降低融资成本，支持实体经济发展，货币市场收益率大幅下行，推动债市走出一波上涨行情。年初美元指数走强，人民币贬值压力下资金外流增加，每月新股集中 IPO 冻结大量资金，春节前假日取现效应也增加了银行系统的备付需求，导致春节前市场资金面持续紧张。虽然央行 2 月初下调存款准备金率，但市场流动性改善有限。但之后数据显示 1 季度宏观经济下行压力加大，央行 2 月底宣布降息，3 月份公开市场连续三次下调 7 天逆回购利率，并通过 SLO、SLF 和 MLF 等定向方式向银行体系投放资金，同时引导银行间回购开盘利率逐步下行。2 季度宏观经济数据显示整体经济仍处低位、政府稳增长压力较大，因此央行继续采取前期各项措施，加大了货币政策放松操作，向市场投放资金。4 月 19 日更超预期降低金融机构法定存款准备金利率 1 个百分点，5 月 10 日年内第二次

降息；继续对银行开展中期借贷便利(MLF)，对政策性银行提供抵押补充贷款(PSL)支持提供长期稳定资金来源；6月28日更同时采取了定向降准和降息的双重措施。央行的量价配合操作取得了明显效果，市场流动性持续改善。1季度银行间隔夜和7天回购利率均值分别为3.09%和4.36%，2季度已经分别大幅下行至1.54%和2.50%，创09年以来的最低点。上半年债券市场也在资金面影响下波动，1季度受流动性紧张、资金成本维持高位影响走势偏弱，季末1年期国开金融债收益率3.97%，与年初的3.95%基本持平，但2季末已大幅下行至2.78%。信用产品方面，短融收益率跟随基准利率波动，1季度资金成本高企，投资者更为看重信用债票息收入，2季度资金面宽松推动信用利差收窄，但经济低迷环境中信用违约风险增加，不同等级的信用息差则有所拓宽。上半年1年期高评级的AAA级短融收益率先由年初的4.72%略升至1季末的4.81%，后又大幅降至2季末的3.43%；同期中评级的AA级短融收益率则由年初的5.63%降至1季末的5.39%，然后进一步降至2季末的4.35%。

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；灵活配置债券投资和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；合理配置债券仓位，前期适当提高组合久期，后期则相对谨慎通过短期投资过渡。在实现组合较高静态收益的同时，市场收益率下行也为组合带来资本利得收益。整体看，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

本报告期嘉实货币A的基金份额净值收益率为2.2988%，嘉实货币B的基金份额净值收益率为2.4207%，同期业绩比较基准收益率为0.1734%。

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2015年下半年，宏观经济、货币政策和短期资金面仍将是影响货币市场的主要因素。整体看，美国经济温和复苏，市场对下半年加息预期已经明朗；但欧洲和日本经济差强人意；国际资本流动不确定性增加，由此带来的影响将错综复杂。国内经济向新常态转型，改革攻坚难度增加，需要警惕经济增速下行太快带来的负面影响，经济结构仍需改善，股票市场波动加剧，通胀缓慢回升。综合当前国内外整体经济和货币环境，预计下半年央行将持续稳健偏宽松的货币政策，以支持稳定的经济增长，存在继续降息和降准的概率，但会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性，运用各类创新工具进行预调微调，根据经济情况调整。央行公开市场操作、回购利率和各种定向工具运用将是影响资金面、资金利率、和投资者政策预期的关键指标。3季度通常是债

券发行密集期，政府地方债置换计划继续实施，债市供给增长。股票市场波动加剧和密集的新股发行也会对市场资金面有更多分流。这都将对债券和资金市场带来复杂和深远影响，投资者要重点关注这方面的政策。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，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第二十节三、基金收益分配原则的约定及管理人 2014 年 6 月 11 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于嘉实货币市场基金调整收益支付方式并相应修订基金合同部分条款的公告》：“1、每日将基金净收益分配给基金份额持有人，当日收益参与下一日的收益分配，并定期支付且结转为相应的基金份额；3、本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式”（通常情况下，本基金的收益支付方式为按日支付，对于目前暂不支持按日支付的销售机构，仍保留按月支付的方式），本期 A 类份额已实现收益为 706,579,725.51 元，每日分配，定期支付，合计分配 706,579,725.51 元，B 类份额已实现收益为 275,799,742.95 元，每日分配，定期支付，合计分配 275,799,742.95 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	16,441,244,419.07	25,940,420,157.79
结算备付金		63,566,500.00	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	27,194,810,863.85	21,696,177,656.46
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		27,164,810,863.85	21,666,177,656.46
资产支持证券投资		30,000,000.00	30,000,000.00
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	-	318,590,877.89
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	521,741,235.30	770,476,599.35
应收股利		-	-
应收申购款		525,722,173.07	914,037,507.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	2,305,554.67	1,175,000.00
资产总计		44,749,390,745.96	49,640,877,799.13
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		3,145,856,957.07	3,315,353,512.35
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		43,871,615.12	18,408,340.32
应付管理人报酬		12,767,421.33	13,001,011.35
应付托管费		3,868,915.54	3,939,700.42
应付销售服务费		7,125,302.28	7,427,588.07
应付交易费用	6.4.7.7	334,957.40	197,713.98
应交税费		93,698.63	93,698.63
应付利息		127,853.23	777,274.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	467,117.41	305,512.44
负债合计		3,214,513,838.01	3,359,504,352.04
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,534,876,907.95	46,281,373,447.09
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		41,534,876,907.95	46,281,373,447.09
负债和所有者权益总计		44,749,390,745.96	49,640,877,799.13

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，嘉实货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

29,772,796,624.42 份；嘉实货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

11,762,080,283.53 份。嘉实货币基金份额总额合计为 41,534,876,907.95 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实货币市场基金

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		1,182,157,429.19	963,357,625.32
1.利息收入		1,075,121,293.87	947,742,491.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	582,037,168.01	588,306,381.84
债券利息收入		481,639,109.85	334,889,832.74
资产支持证券利息收入		724,865.74	-
买入返售金融资产收入		10,720,150.27	24,546,277.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益		106,901,135.32	15,615,133.58
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	106,901,135.32	15,615,133.58
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	135,000.00	-
减：二、费用		199,777,960.73	131,309,650.71
1. 管理人报酬		70,148,723.50	52,534,803.25
2. 托管费		21,257,188.88	15,919,637.30
3. 销售服务费		39,364,457.27	20,397,606.10
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		68,791,427.56	42,182,539.80
其中：卖出回购金融资产支出		68,791,427.56	42,182,539.80
6. 其他费用	6.4.7.15	216,163.52	275,064.26
三、利润总额		982,379,468.46	832,047,974.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润		982,379,468.46	832,047,974.61

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	46,281,373,447.09	-	46,281,373,447.09
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	982,379,468.46	982,379,468.46
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数	-4,746,496,539.14	-	-4,746,496,539.14
其中：1. 基金申购款	112,944,658,621.38	-	112,944,658,621.38
2. 基金赎回款	-117,691,155,160.52	-	-117,691,155,160.52
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动	-	-982,379,468.46	-982,379,468.46
五、期末所有者权益 (基金净值)	41,534,876,907.95	-	41,534,876,907.95
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	31,002,769,333.95	-	31,002,769,333.95
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	832,047,974.61	832,047,974.61
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数	889,740,292.69	-	889,740,292.69
其中：1. 基金申购款	78,821,622,889.68	-	78,821,622,889.68
2. 基金赎回款	-77,931,882,596.99	-	-77,931,882,596.99
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动	-	-832,047,974.61	-832,047,974.61
五、期末所有者权益 (基金净值)	31,892,509,626.64	-	31,892,509,626.64

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：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>常旭</u>
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
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东

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	70,148,723.50	52,534,803.25
其中：支付销售机构的客户维护费	17,578,419.07	9,119,499.26

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	21,257,188.88	15,919,637.30

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		
	嘉实货币 A	嘉实货币 B	合计
嘉实基金管理有限公司	5,282,532.77	473,806.73	5,756,339.50
中国银行	14,455,673.08	42,117.20	14,497,790.28
合计	19,738,205.85	515,923.93	20,254,129.78
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		
	嘉实货币 A	嘉实货币 B	合计
嘉实基金管理有限公司	2,201,532.81	669,707.76	2,871,240.57
中国银行	7,582,393.95	55,529.19	7,637,923.14
合计	9,783,926.76	725,236.95	10,509,163.71

注：（1）嘉实货币 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	149,943,750.00	192,025,788.49	-	-	14,302,180,000.00	2,758,421.02
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	-	-	-	-	16,894,300,000.00	2,791,467.35

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	
	嘉实货币 A	嘉实货币 B
基金合同生效日（2005 年 3 月 18 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	5,010,858.35
期间申购/买入总份额	-	122,538.70
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	5,133,397.05
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.04%

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	嘉实货币 A	嘉实货币 B

基金合同生效日（2005年3月18日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	103.18	190,880,337.42
期间申购/买入总份额	4,819,599.89	206,876,305.29
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	4,819,597.75
期末持有的基金份额	4,819,703.07	392,937,044.96
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.03%	2.91%

注：（1）本报告期内（2015年1月1日至2015年6月30日），本基金管理人期间申购/买入总份额含红利再投份额。

（2）上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日），本基金管理人期间申购/买入总份额含红利再投份额及自动升降级调增份额，期间赎回/卖出总份额含自动升降级调减份额。

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

嘉实货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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
立信投资有限责任公司	406,270.86	0.00%	550,053.17-	0.00%-

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	11,244,419.07	3,075,069.28	2,154,160,610.34	194,519.64

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），本基金无存于中国银行的定期存款，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2,929,741.67；上期末（2014年6月30日）无存于中国银行的定期存款，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 166,666.67。

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

截至本报告期末 2015 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 3,145,856,957.07 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
041566002	15 淮南矿业 CP001	2015 年 7 月 2 日	99.94	2,000,000	199,880,649.37
041559004	15 沙钢 CP001	2015 年 7 月 2 日	99.97	1,100,000	109,968,863.41
130241	13 国开 41	2015 年 7 月 1 日	100.31	200,000	20,061,989.02
100236	10 国开 36	2015 年 7 月 1 日	100.12	8,670,000	868,010,734.09
130215	13 国开 15	2015 年 7 月 1 日	99.64	1,600,000	159,428,520.73
130233	13 国开 33	2015 年 7 月 1 日	99.79	1,000,000	99,793,069.68
110221	11 国开 21	2015 年 7 月 1 日	99.29	1,200,000	119,151,442.22
140357	14 进出 57	2015 年 7 月 1 日	100.05	500,000	50,025,574.74
140223	14 国开 23	2015 年 7 月 1 日	100.10	900,000	90,093,328.59
150211	15 国开 11	2015 年 7 月 1 日	100.43	5,000,000	502,157,732.90
011582001	15 太钢 SCP001	2015 年 7 月 1 日	99.96	1,490,000	148,944,470.58
011599087	15 广晟	2015 年 7 月	99.93	630,000	62,958,592.54

	SCP002	1 日			
041455030	14 嘉公路 CP001	2015 年 7 月 1 日	99.99	200,000	19,997,615.76
130306	13 进出 06	2015 年 7 月 1 日	99.85	3,100,000	309,544,045.80
150403	15 农发 03	2015 年 7 月 1 日	99.71	3,000,000	299,133,106.41
140444	14 农发 44	2015 年 7 月 1 日	100.07	500,000	50,037,006.96
140443	14 农发 43	2015 年 7 月 1 日	100.10	1,000,000	100,096,746.79
合计				32,090,000	3,209,283,489.59

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	27,194,810,863.85	60.77
	其中：债券	27,164,810,863.85	60.70
	资产支持证券	30,000,000.00	0.07
2	买入返售金融资产	-	-
	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	16,504,810,919.07	36.88
4	其他各项资产	1,049,768,963.04	2.35
	合计	44,749,390,745.96	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	12.40	
	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	3,145,856,957.07	7.57

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	144
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	147
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	86

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 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	9.11	7.57
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.10	-
4	90 天(含)—180 天	32.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	36.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.21	7.57

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	3,220,716,170.68	7.75
	其中：政策性金融债	3,220,716,170.68	7.75
4	企业债券	435,465,787.81	1.05
5	企业短期融资券	23,508,628,905.36	56.60
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
	合计	27,164,810,863.85	65.40
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	40,123,978.04	0.10

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	100236	10 国开 36	11,900,000	1,191,387,282.09	2.87
2	011599045	15 中油股 SCP001	8,000,000	800,506,552.94	1.93
3	011599189	15 中油股 SCP002	8,000,000	799,184,125.25	1.92
4	011474007	14 陕煤化 SCP007	5,000,000	503,796,149.88	1.21
5	150211	15 国开 11	5,000,000	502,157,732.90	1.21
6	071503007	15 中信 CP007	5,000,000	499,901,029.60	1.20
7	011599135	15 龙源 SCP001	5,000,000	499,039,312.19	1.20
8	058031	05 中信债 1	4,060,000	405,547,998.28	0.98
9	071503004	15 中信 CP004	4,000,000	399,997,791.21	0.96
10	011599145	15 深能源 SCP001	3,500,000	349,823,286.64	0.84

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	75
报告期内偏离度的最高值	0.4521%
报告期内偏离度的最低值	0.1485%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2759%

7.7 期末按摊余成本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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	1489210	14 京元 2A1	300,000	30,000,000.00	0.07
---	---------	-----------	---------	---------------	------

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只资产支持证券。

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	-
3	应收利息	521,741,235.30
4	应收申购款	525,722,173.07
5	其他应收款	2,305,554.67
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	1,049,768,963.04

§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
嘉实货 币 A	352,857	84,376.38	549,400,720.30	1.85%	29,223,395,904.12	98.15%
嘉实货 币 B	361	32,581,939.84	9,932,922,716.46	84.45%	1,829,157,567.07	15.55%
合计	353,211	117,592.25	10,482,323,436.76	25.24%	31,052,553,471.19	74.76%

注：(1) 嘉实货币 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货币 A 份额占嘉实货币 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实货币 A 份额占嘉实货币 A 总份额比例；

(2) 嘉实货币 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货币 B 份额占嘉实货币 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实货币 B 份额占嘉实货币 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 持有本基金	嘉实货币 A	23,186,123.74	0.08%
	嘉实货币 B	10,823,965.14	0.09%
	合计	34,010,088.88	0.08%

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	嘉实货币 A	>=100
	嘉实货币 B	>=100
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开 放式基金	嘉实货币 A	0~10
	嘉实货币 B	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉实货币 A	嘉实货币 B
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	33,525,756,657.56	12,755,616,789.53
本报告期基金总申购份额	98,577,096,769.62	14,367,561,851.76
减:本报告期基金总赎回份额	102,330,056,802.76	15,361,098,357.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,772,796,624.42	11,762,080,283.53

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了现场检查。

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	
国泰君安证券股份有限公司	1	23,274,600,000.00	100.00%	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2015年8月29日