

# 嘉实现金宝货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	43
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 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.....	44
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	45
7.8 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.....	45
7.9 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>

12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实现金宝货币市场基金
基金简称	嘉实现金宝货币
基金主代码	003460
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,515,457,171.44 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金跟踪分析市场资金面变化及投资者交易行为变化，结合宏观和微观研究制定投资策略，谋求在满足安全性、流动性需要的基础上，实现较高的当期收益。
业绩比较基准	按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率
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。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田东辉
	联系电话	(010) 65215588	010-68858113
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-600-8800	95580
传真		(010) 65182266	010-68858120
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	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市建国门北大街8号华润大厦8层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100005	100808
法定代表人		邓红国	李国华

## 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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
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

## 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	139,084,118.16
本期利润	139,084,118.16
本期净值收益率	2.1551%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末基金资产净值	6,515,457,171.44
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
累计净值收益率	2.2708%

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

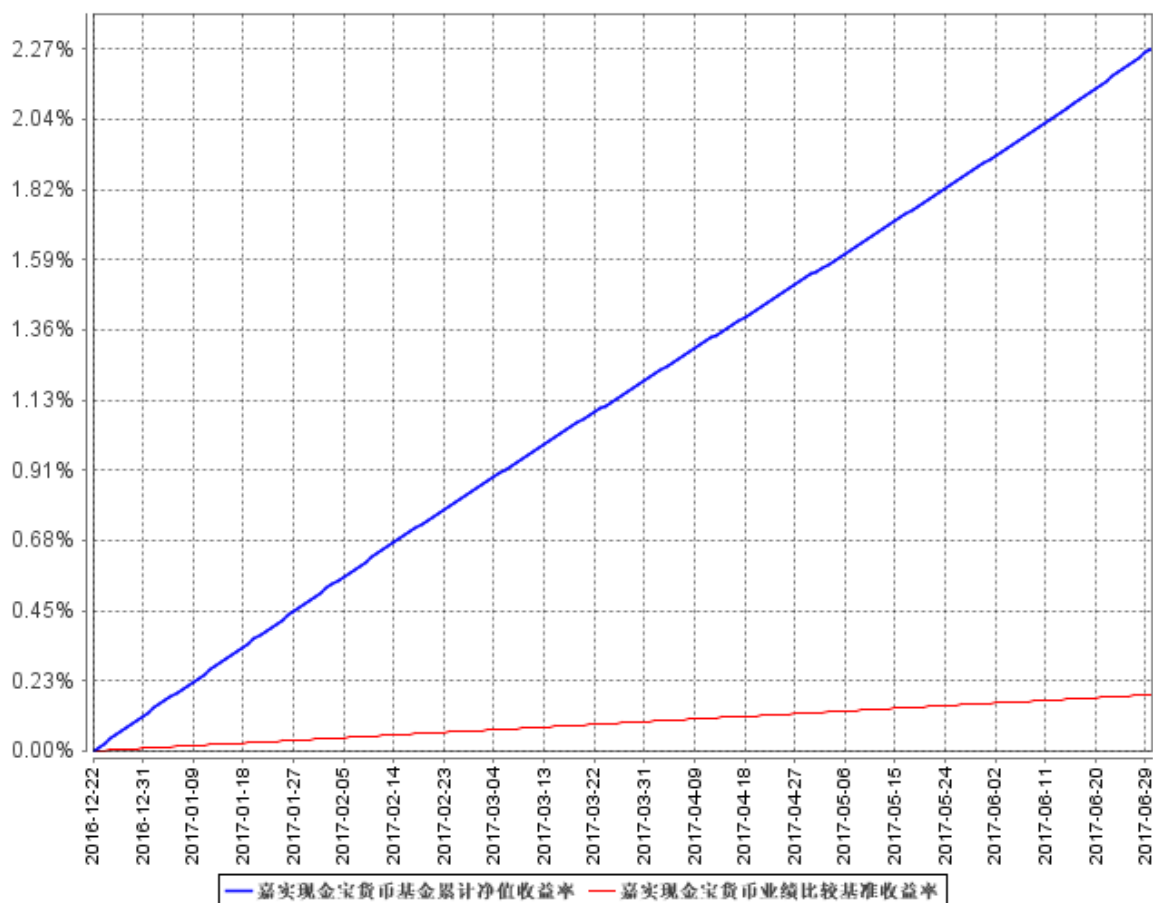
##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3630%	0.0003%	0.0287%	0.0000%	0.3343%	0.0003%
过去三个月	1.0603%	0.0004%	0.0871%	0.0000%	0.9732%	0.0004%
过去六个月	2.1551%	0.0005%	0.1734%	0.0000%	1.9817%	0.0005%
自基金合同 生效起至今	2.2708%	0.0009%	0.1830%	0.0000%	2.0878%	0.0009%



### 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

嘉实现金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



图：嘉实现金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

(2016年12月22日至2017年6月30日)

注1：本基金基金合同生效日2016年12月22日至报告期末未满1年。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。

注2：2017年5月25日，本基金管理人发布《关于增聘嘉实现金宝货币基金经理的公告》，增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务，与基金经理张文玥女士、李瞳先生共同管理本基金。

## § 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 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、129 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、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、嘉实优质企业混合、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、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债

券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接。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		
张文玥	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实宝、嘉实 1 个月理财债券、嘉实 3 个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券基金经理	2016 年 12 月 22 日	-	9 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，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士，具有基金从业资格。
李瞳	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实理	2016 年 12 月 22 日	-	8 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

	财宝 7 天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实快线货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币基金经理				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。硕士研究生，具有基金从业资格。
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实 3 个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实 6 个月理财债券基金经理	2017 年 5 月 25 日	-	7 年	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。硕士研究生，CFA、具有基金从业资格。

注：（1）基金经理李瞳、张文玥的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理李金灿的任职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；（3）本基金基金经理张文玥女士因休产假超过 30 日，在其休假期间，本基金暂由共同管理的基金经理李金灿先生及李瞳先生代为履行基金经理职责。该事项已于 2017 年 7 月 5 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

## 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、《嘉实现金宝货币市场基金招募说明书》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

2017 年上半年全球经济整天呈现温和复苏的态势，全球主要经济体贸易回暖，美联储进行年内二次加息，英法两国大选扰动欧洲市场，日本经济持续复苏，与此同时，包括美联储“缩表”带来的风险对全球经济产生新的不确定性。

国内经济整体呈现平稳增长，GDP 同比增速 6.9%，政府积极实施稳增长措施、继续推进深化改革和执行稳健的货币政策，经济表现较好，但仍存在下行压力。具体来看，工业增加值平稳增长，上半年同比增速均值为 6.91%，低于去年同比增速均值 6.04%；“克强指数”今年前五个月均值为 15.09%，明显高于去年均值 7.24%；中国制造业采购经理指数（PMI）站上荣枯线，上半年均值为 51.47%，略低于去年均值 50.32%。以投资、消费和出口为代表的“三驾马车”增速表现有所差异，固定资产投资呈现小幅回落态势，上半年累计同比增速均值为 8.84%，低于去年均值 9.01%，其中房地产开发投资相对平稳，上半年累计同比增速均值为 8.92%，高于去年均值 6%，基础设施投资小幅增长，上半年累计同比增速均值为 18.33%，高于去年均值 16.68%，民间固定资产投资增长较好，上半年累计同比增速为 7.05%，高于去年均值 3.66%；社会消费品零售总额表现向好，上半年同比增速均值为 10.56%，高于去年均值 9.55%；受国际市场需求回暖影响，出口形势整体好转，出口金额上半年同比增速均值分别为 8.08%，明显高于去年均值-7.60%。另外，上

半年全国居民消费价格总水平同比增速均值为 1.41%，低于去年均值 2.01%；上半年 PPI 同比增速为 6.62%，高于去年均值-1.31%。从金融数据来看，货币供应量从高位回落，M2 上半年同比增速均值为 10.42%，低于去年均值 12.04%；社会融资规模处于高位，上半年新增规模均值为 1.86 万亿元，高于去年均值 1.48 万亿元；新增人民币贷款处于高位，上半年新增均值为 1.33 万亿元，高于去年均值 1.05 万亿元。上半年人民币汇率呈现先稳后升走势，CNY 上半年累计升值 2.4%，CNH 上半年累计升值 2.72%，上半年央行外汇资产新增为-4272 万亿元，较去年同期大幅减少约 8000 亿元，跨境资金流出规模有所收敛。

为兼顾维稳人民币汇率和去杠杆进程，央行货币政策整体有所收紧，2017 年上半年央行两次上调公开市场操作利率，无降准操作，主要通过公开市场操作向市场适度补充流动性，上半年公开市场操作（含 MLF）累计仅净投放资金 122 亿元，PSL 累计净投放资金 3585 亿元，SLF 累计净回笼资金 844 亿元。银行间市场资金利率整体上行，2017 年半年末隔夜、7 天、1 个月和 3 个月回购加权利率较去年末分别+78BP、+126BP、+150BP 和-35BP；银行间市场国债收益率曲线也维持平稳，2017 半年末国债收益率曲线 1 年、3 年、5 年、7 年和 10 年期收益率较去年末分别+81BP、+71BP、+64BP、+62BP 和+56BP，10 年期与 1 年期国债期限利差为 11BP，较去年末缩小 25BP。

本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；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；控制债券整体仓位。整体看，本基金成功应对了市场波动，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

本报告期基金份额净值增长率为 2.1551%，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

国际货币基金组织近期发布《世界经济展望报告》更新内容，认为全球经济持续复苏，今明两年增速预计分别为 3.5%和 3.6%，与 4 月份预测值一致。报告预计，发达经济体今年经济增速为 2%，与 4 月份预测值持平；明年增速较 4 月份预测值下调 0.1 个百分点至 1.9%。其中，美国经济今明两年预计均增长 2.1%，较 4 月份预测值分别下调 0.2 和 0.4 个百分点。IMF 指出，美国经济今年第一季度表现较弱，并且美国政府酝酿推出的扩张性财政政策力度可能不及预期，是调低美国增速预期的主要原因。考虑到欧元区今年第一季度经济增长好于预期且政治不确定性有所下降，IMF 将欧元区今明两年经济增速预期分别上调 0.2 和 0.1 个百分点至 1.9%和 1.7%。IMF 将日本今年经济增速预期上调 0.1 个百分点至 1.3%，明年增速预期维持在 0.6%不变。预计新兴经济体和发

展中国家今年经济增长 4.6%，比 4 月份预测值高出 0.1 个百分点，明年增速预期维持在 4.8% 不变。

从国内经济来看，稳定和防风险将是经济运行主基调，国内经济可能面临下行压力，预计消费品零售增幅基本平稳，房地产和基建投资存在不确定性，出口整体维持向好。IMF 将中国今明两年经济增长预期分别上调 0.1 和 0.2 个百分点至 6.7% 和 6.4%。

预计 2017 年下半年货币政策维持“紧平衡”但节奏有所放缓，着眼于防范系统性风险，延续去杠杆进程，维稳人民币汇率，国内流动性仍存缺口需央行通过公开市场适时补充，另外地方政府债务置换下半年进程加快，一定程度上需货币政策予以支持。预计 2017 年下半年财政政策或受财政收入减缓影响，财政政策对经济支撑力或有所弱化。

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、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、合规等部门负责人组成，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但不限于上海、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十六部分（二）基金收益分配原则“3. “每日分配、按日支付”。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，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付；5. 本基金每日进行收益计算并分配时，每日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 139,084,118.16 元，每日分配，每日支付，合计分配 139,084,118.16 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实现金宝货币市场基金（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、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：嘉实现金宝货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,876,110,699.07	3,216,255,569.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	390,038,993.67	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		390,038,993.67	-
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	2,216,375,284.56	160,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	34,300,097.89	3,924,474.66
应收股利		-	-
应收申购款		119,019.95	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,516,944,095.14	3,380,180,044.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		196,023.27	-
应付管理人报酬		808,626.34	144,154.11
应付托管费		359,389.47	64,068.50
应付销售服务费		44,923.70	8,008.56
应付交易费用	6.4.7.7	21,284.93	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	56,675.99	-
负债合计		1,486,923.70	216,231.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	6,515,457,171.44	3,379,963,813.40
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,515,457,171.44	3,379,963,813.40
负债和所有者权益总计		6,516,944,095.14	3,380,180,044.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，嘉实现金宝货币基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,515,457,171.44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		149,265,360.95
1.利息收入		149,265,852.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	116,691,304.01
债券利息收入		12,532,755.50
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		20,041,792.72
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-491.28
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	-491.28
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（损失以“-”号填列）		-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-
<b>减：二、费用</b>		10,181,242.79
1. 管理人报酬		5,852,236.16
2. 托管费		2,600,993.79
3. 销售服务费		325,124.21
4. 交易费用	6.4.7.14	-
5. 利息支出		1,338,512.64
其中：卖出回购金融资产支出		1,338,512.64
6. 其他费用	6.4.7.15	64,375.99

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		139,084,118.16
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		139,084,118.16

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 22 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	3,379,963,813.40	-	3,379,963,813.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	139,084,118.16	139,084,118.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,135,493,358.04	-	3,135,493,358.04
其中：1.基金申购款	11,358,517,493.31	-	11,358,517,493.31
2.基金赎回款	-8,223,024,135.27	-	-8,223,024,135.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-139,084,118.16	-139,084,118.16
五、期末所有者权益（基金净值）	6,515,457,171.44	-	6,515,457,171.44

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 22 日，无上年度可比期间数据。

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>张公允</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 基金基本情况

嘉实现金宝货币市场基金(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”)证监许可[2016]1933 号《关于准予嘉实现金宝货币市场基金注册的批复》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《嘉实现金宝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 3,200,010,260.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1717 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实现金宝货币市场基金基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,200,010,260.00 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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实现金宝货币市场基金基金合同》的有关规定,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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及法律法规或中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为:按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率。

### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实现金宝货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。

对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期

权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每份基金份额享有同等分配权，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，为投资人每日计算当日收益并分配。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方



式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资人可通过赎回基金份额获得现金收益;若当日净收益大于零时,则为投资人增加相应的基金份额,若当日净收益等于零时,则保持投资人基金份额不变;基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零,若当日净收益小于零时,则缩减投资人基金份额。基金份额持有人在全额赎回其持有的本基金份额时,基金管理人自动将该基金份额持有人的未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人;基金份额持有人部分赎回其持有的基金份额时,未付收益为正时,未付收益不进行支付;未付收益为负时,其剩余的基金份额需足以弥补其当前未付收益为负时的损益,否则将自动按比例结转当前未付收益,再进行赎回款项结算。当日申购的基金份额自下一个工作日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起,不享有基金的收益分配权益。

#### 6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,110,699.07
定期存款	3,874,000,000.00

其中：存款期限 1-3 个月	1,807,000,000.00
存款期限 1 个月以内	377,000,000.00
存款期限 3 个月及以上	1,690,000,000.00
其他存款	-
合计：	3,876,110,699.07

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 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	390,038,993.67	389,992,000.00	-46,993.67	-0.0007%
	合计	390,038,993.67	389,992,000.00	-46,993.67	-0.0007%

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（2017 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 2017 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	2,216,375,284.56	-
交易所市场买入返售 金融资产款	-	-
合计	2,216,375,284.56	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本期末（2017 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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	662.45
应收定期存款利息	20,482,944.14
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	8,577,516.10
应收买入返售证券利息	5,238,975.20
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	34,300,097.89

**6.4.7.6 其他资产**

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 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	21,284.93
合计	21,284.93

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	56,675.99
应付指数使用费	-
其他	-
合计	56,675.99

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,379,963,813.40	3,379,963,813.40
本期申购	11,358,517,493.31	11,358,517,493.31
本期赎回(以“-”号填列)	-8,223,024,135.27	-8,223,024,135.27
本期末	6,515,457,171.44	6,515,457,171.44

注 1：申购含转换入份额、红利再投份额，赎回含转换出份额。

注 2：本基金于 2016 年 12 月 20 日至 2016 年 12 月 21 日向社会公开募集，截至 2016 年 12 月 22 日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,200,010,260.00 元，嘉实现金宝货币基金募集期间有效认购资金未产生利息，以上实收基金折合为 3,200,010,260.00 份嘉实现金宝货币基金份额。

**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	139,084,118.16	-	139,084,118.16
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	-139,084,118.16	-	-139,084,118.16
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	48,521.81
定期存款利息收入	116,631,946.95
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,835.25
其他	-
合计	116,691,304.01

#### 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,088,158,870.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,059,898,401.62
减：应收利息总额	28,260,960.00

买卖债券差价收入	-491.28
----------	---------

#### 6.4.7.13 其他收入

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无其他收入。

#### 6.4.7.14 交易费用

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	-
债券托管账户维护费	14,587.42
银行划款手续费	-
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	200.00
合计	64,375.99

### 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

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

#### 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方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（2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,852,236.16
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.18% 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 × 0.18% / 当年天数。



**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,600,993.79

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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×0.08% / 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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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	325,124.21
合计	325,124.21

注：本基金销售服务费年费率为 0.01%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/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**

本期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**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**

本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,040,698,462.76	46.67%

注：上年度末（2016 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	2,110,699.07	48,521.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按适用利率计息。

#### 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 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
139,084,118.16	-	-	139,084,118.16	-

#### 6.4.12 期末（2017 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（2017 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

本期末（2017 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。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、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

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

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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

### 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。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行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，不投资于信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券(上年度末：无)。

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。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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于开放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不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间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 2017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	3,876,110,699.07	-	-	-	3,876,110,699.07
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	390,038,993.67	-	-	-	390,038,993.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,216,375,284.56	-	-	-	2,216,375,284.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	34,300,097.89	34,300,097.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	119,019.95	119,019.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,482,524,977.30	-	-	34,419,117.84	6,516,944,095.14
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	196,023.27	196,023.27
应付管理人报酬	-	-	-	808,626.34	808,626.34
应付托管费	-	-	-	359,389.47	359,389.47
应付销售服务费	-	-	-	44,923.70	44,923.70
应付交易费用	-	-	-	21,284.93	21,284.93
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	56,675.99	56,675.99
负债总计	-	-	-	1,486,923.70	1,486,923.70
利率敏感度缺口	6,482,524,977.30	-	-	-32,932,194.14	6,515,457,171.44
上年度末 2016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	3,216,255,569.91	-	-	-	3,216,255,569.91
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	160,000,000.00	-	-	-	160,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,924,474.66	3,924,474.66
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,376,255,569.91	-	-	3,924,474.66	3,380,180,044.57
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	144,154.11	144,154.11
应付托管费	-	-	-	64,068.50	64,068.50
应付销售服务费	-	-	-	8,008.56	8,008.56
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	216,231.17	216,231.17
利率敏感度缺口	3,376,255,569.91	-	-	3,708,243.49	3,379,963,813.40

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 2017 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(2016 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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券，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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 390,038,993.67 元，无属于第一、第三层次的余额（上年度末：无）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

##### (d) 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。

## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	390,038,993.67	5.98
	其中:债券	390,038,993.67	5.98
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,216,375,284.56	34.01
	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	3,876,110,699.07	59.48
4	其他各项资产	34,419,117.84	0.53
5	合计	6,516,944,095.14	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	0.72	
	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	-	-
	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%。

## 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	36
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

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。

### 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	59.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	28.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	11.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.49	-

## 7.4 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。

## 7.5 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	390,038,993.67	5.99
	其中：政策性金融债	390,038,993.67	5.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	390,038,993.67	5.99
10	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。

## 7.6 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	120233	12 国开 33	1,200,000	120,070,710.34	1.84
2	160419	16 农发 19	1,100,000	109,945,733.28	1.69
3	150417	15 农发 17	900,000	90,016,906.18	1.38
4	100217	10 国开 17	700,000	70,005,643.87	1.07

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 支债券。

**7.7 “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	0.0049%
报告期内偏离度的最低值	-0.0040%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0017%

**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%。

**7.8 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。

**7.9 投资组合报告附注****7.9.1**

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。

**7.9.2**

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。

**7.9.3 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	34,300,097.89
4	应收申购款	119,019.95

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,419,117.84

## § 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
2,745	2,373,572.74	6,398,471,321.01	98.20%	116,985,850.43	1.80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	948,220.60	0.01%

### 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 22 日）基金份额总额	3,200,010,260.00
本报告期期初基金份额总额	3,379,963,813.40
本报告期基金总申购份额	11,358,517,493.31
减：本报告期基金总赎回份额	8,223,024,135.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	6,515,457,171.44

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额、红利再投份额，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情况

2017 年 5 月 25 日, 本基金管理人发布《关于增聘嘉实现金宝货币基金经理的公告》, 增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务, 与基金经理李瞳先生、张文玥女士共同管理本基金。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

报告期内本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙), 为本基金的审计机构。

### 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
恒泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增

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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
恒泰证券股 份有限公司	-	-	1,614,000,000.00	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	关于嘉实现金宝货币市场基金收益支付的公告（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 1 月 16 日
2	关于嘉实现金宝货币市场基金收益支付的公告（2017 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 2 月 15 日
3	关于嘉实现金宝货币市场基金收益支付的公告（2017 年第 3 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 3 月 15 日
4	关于嘉实现金宝货币市场基金收益支付的公告（2017 年第 4 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 4 月 17 日
5	关于嘉实现金宝货币市场基金收益支付的公告（2017 年第 5 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 5 月 15 日
6	关于增聘嘉实现金宝货币基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 5 月 25 日
7	关于嘉实现金宝货币市场基金收益支付的公告（2017 年第 6 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 15 日
8	嘉实现金宝货币市场基金开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2017 年 6 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/02/17 至 2017/06/30	-	5,061,877,141.38	2,021,178,678.62	3,040,698,462.76	46.67%
	2	2017/04/13 至 2017/04/13, 2017/06/09 至 2017/06/13	-	1,509,217,304.54	500,000,000.00	1,009,217,304.54	15.49%
	3	2017/01/01 至 2017/03/23	3,000,000,000.00	2,041,495,541.45	5,041,495,541.45	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会关于准予嘉实现金宝货币市场基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实现金宝货币市场基金基金合同》；
- (3) 《嘉实现金宝货币市场基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实现金宝货币市场基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实现金宝货币市场基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

- (1) 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日