

嘉实快线货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 28 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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。

自 2017 年 2 月 22 日起，本基金名称由“嘉实机构快线货币市场基金”变更为“嘉实快线货币市场基金”。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实快线货币市场基金			
基金简称	嘉实快线货币			
场内简称	嘉实快线（嘉实快线 H 类份额场内简称）			
基金主代码	000917			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2015 年 6 月 25 日			
基金管理人	嘉实基金管理有限公司			
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	39,966,972,954.72 份			
基金合同存续期	不定期			
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所(嘉实快线 H 类份额)			
上市日期	2016 年 1 月 11 日			
下属分级基金的基金简称	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 B	嘉实快线货币 C	嘉实快线货币 H
下属分级基金的交易代码	000917	000918	000919	511960
报告期末下属分级基金的份 额总额	39,966,292,570 .01 份	-	-	680,384.71 份

注:自 2017 年 6 月 21 日起,注册登记机构将本基金每一份 B 类基金份额合并为一份 A 类基金份额,将本基金每一份 C 类基金份额合并为一份 A 类基金份额,注销 B 类、C 类两类基金份额。H 类基金份额设置保持不变。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	朱萍
	联系电话	(010)65215588	021-61618888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95528
传真		(010)65215588	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年				2016 年				2015 年 06 月 25 日（基金合 同生效日）-2015 年 12 月 31 日			
	（ 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日）	（ 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 20 日）	（ 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 20 日）	（ 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日）	嘉实 快线 货币 A	嘉实 快线 货币 B	嘉实 快线 货币 C	嘉实 快线 货币 H	嘉实 快线 货币 A	嘉实 快线 货币 B	嘉实 快线 货币 C	嘉实 快线 货币 H
本期已 实现收	1,169,507,552.40	68,907,309.14	245,016,561.59	8,495,907.75	93,645.4	74,087.5	201,621,	31,299.2	18,603.2	12,586.5	34,607.1	68,338.58

益					86.4 1	40.7 6	545. 50	66.0 7	94.0 1	35.2 4	18.2 1	
本期利 润	1,169,50 7,552.40	68,907, 309.14	245,016 ,561.59	8,495,9 07.75	93,6 45,4	74,0 87,5	201, 621,	31,2 99,2	18,6 03,2	12,5 86,5	34,6 07,1	68,33 8.58
本期净 值收益 率	4.1446%	1.8043%	1.8193%	3.9733%	2.60 63%	2.62 30%	2.66 05%	2.45 14%	1.25 22%	1.16 74%	1.09 21%	0.006 8%
3.1.2 期末数 据和指 标	2017 年末				2016 年末				2015 年末			
期末基 金资产 净值	39,966,2 92,570.0 1	-	-	68,038, 471.37	12,0 59,2 02,2 18.0 3	1,29 8,89 0,51 2.04	8,51 0,84 5,10 8.15	802, 888, 529. 32	21,4 42,9 37,9 18.8 6	178, 648, 895. 55	3,59 0,32 1,22 9.88	1,000 ,068, 338.5 8
期末基 金份额 净值	1.0000	-	-	100.000 0	1.00 00	1.00 00	1.00 00	100. 0000	1.00 00	1.00 00	1.00 00	100.0 000
3.1.3 累计期 末指标	2017 年末				2016 年末				2015 年末			
	2017 年 12 月 31 日	2017 年 6 月 20 日	2017 年 6 月 20 日	2017 年 12 月 31 日								
累计净 值收益 率	8.1970%	5.6943%	5.6698%	6.5294%	3.89 12%	3.82 11%	3.78 17%	2.45 84%	1.25 22%	1.16 74%	1.09 21%	0.006 8%

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) 嘉实快线货币 A、嘉实快线货币 B、嘉实快线货币 C 和嘉实快线货币 H 适用不同的管理费率

和销售费率；（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（4）自 2015 年 12 月 31 日起，本基金收益分配从按月结转份额调整为“每日分配、按日支付”。（5）自 2017 年 6 月 21 日起，注册登记机构将本基金每一份 B 类基金份额合并为一份 A 类基金份额，将本基金每一份 C 类基金份额合并为一份 A 类基金份额，注销 B 类、C 类两类基金份额。H 类基金份额设置保持不变。份额合并后，嘉实快线货币 A 和嘉实快线货币 H 适用不同的销售费率。

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

嘉实快线货币 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
过去三个月	1.1131%	0.0018%	0.0881%	0.0000%	1.0250%	0.0018%
过去六个月	2.1915%	0.0013%	0.1763%	0.0000%	2.0152%	0.0013%
过去一年	4.1446%	0.0014%	0.3500%	0.0000%	3.7946%	0.0014%
自基金合同生效起至今	8.1970%	0.0027%	0.8855%	0.0000%	7.3115%	0.0027%

嘉实快线货币 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
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月	1.8043%	0.0014%	0.1648%	0.0000%	1.6395%	0.0014%
自基金合同生效起至今	5.6943%	0.0025%	0.6993%	0.0000%	4.9950%	0.0025%

嘉实快线货币 C

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

2017年1月 1日至 2017年6月	1.8193%	0.0014%	0.1648%	0.0000%	1.6545%	0.0014%
自基金合同 生效起至今	5.6698%	0.0027%	0.6993%	0.0000%	4.9705%	0.0027%

嘉实快线货币 H

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
过去三个月	1.0338%	0.0018%	0.0881%	0.0000%	0.9457%	0.0018%
过去六个月	2.0408%	0.0013%	0.1763%	0.0000%	1.8645%	0.0013%
过去一年	3.9733%	0.0013%	0.3500%	0.0000%	3.6233%	0.0013%
自基金合同 生效起至今	6.5294%	0.0026%	0.7032%	0.0000%	5.8262%	0.0026%

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

嘉实快线货币A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

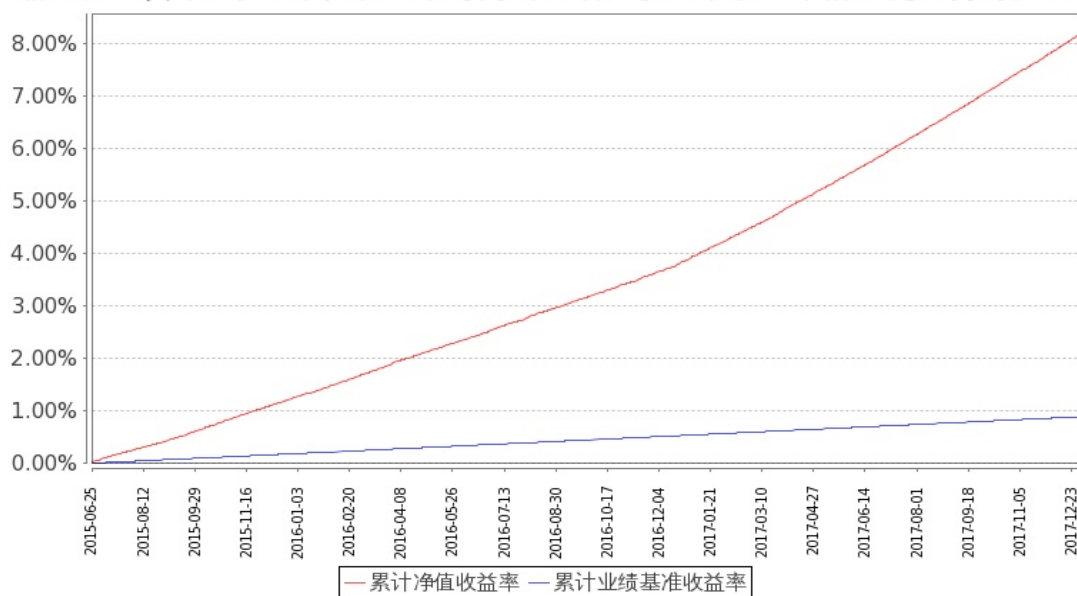


图 1：嘉实快线货币 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015 年 6 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)

嘉实快线货币B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

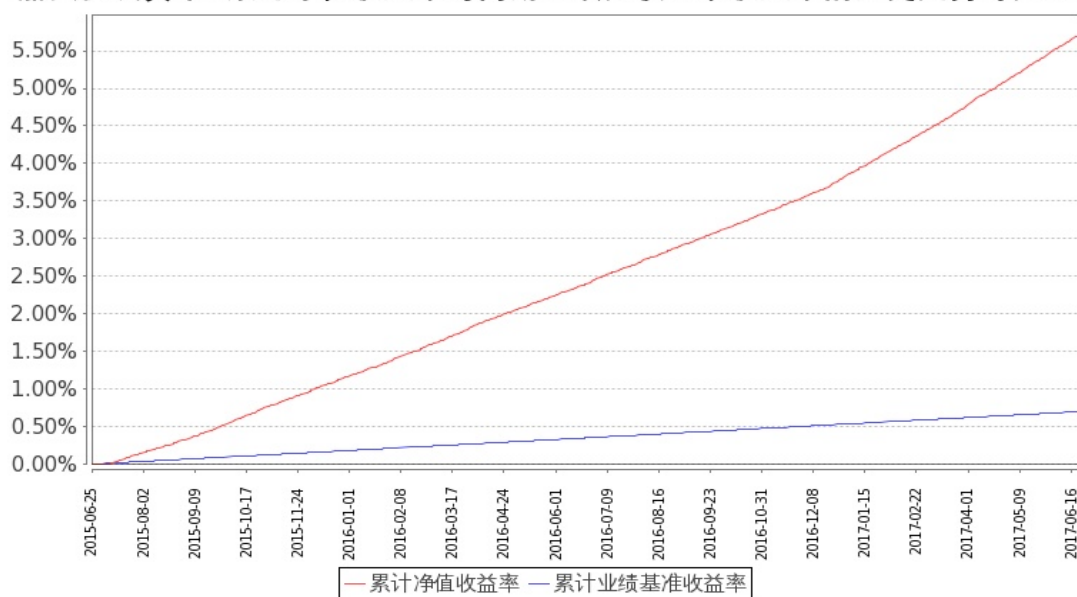


图 2：嘉实机构快线货币 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 6 月 25 日至 2017 年 6 月 20 日)

嘉实快线货币C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

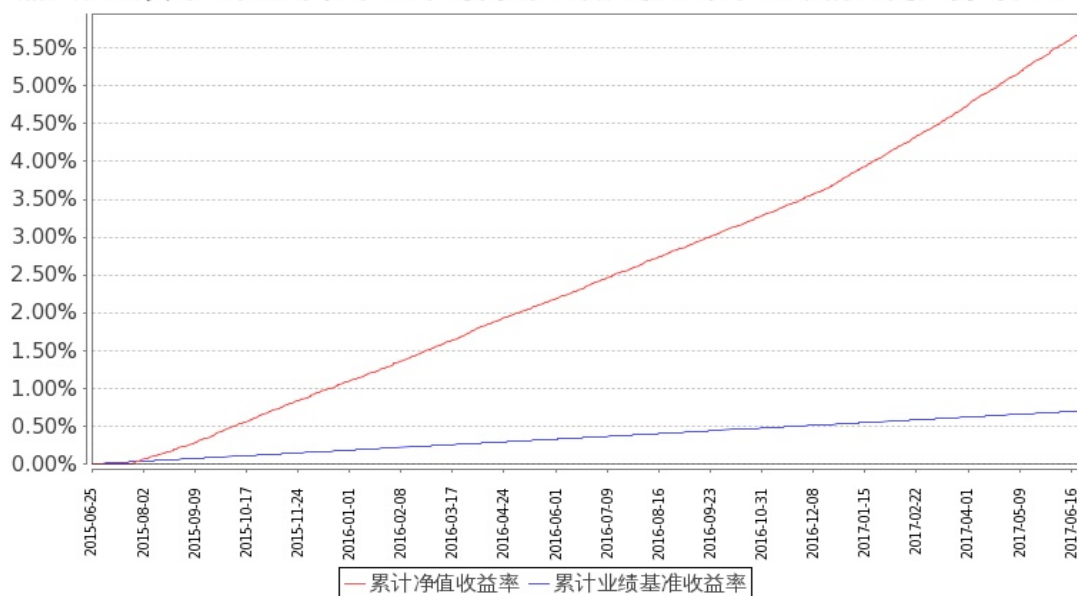


图 3：嘉实机构快线货币 C 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 6 月 25 日至 2017 年 6 月 20 日)

嘉实快线货币H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

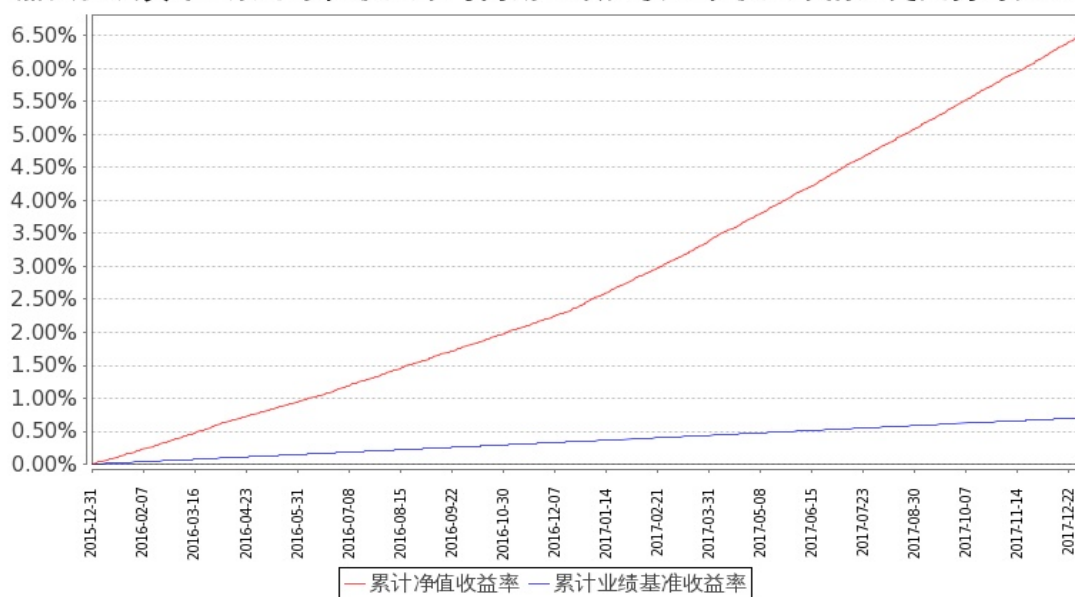
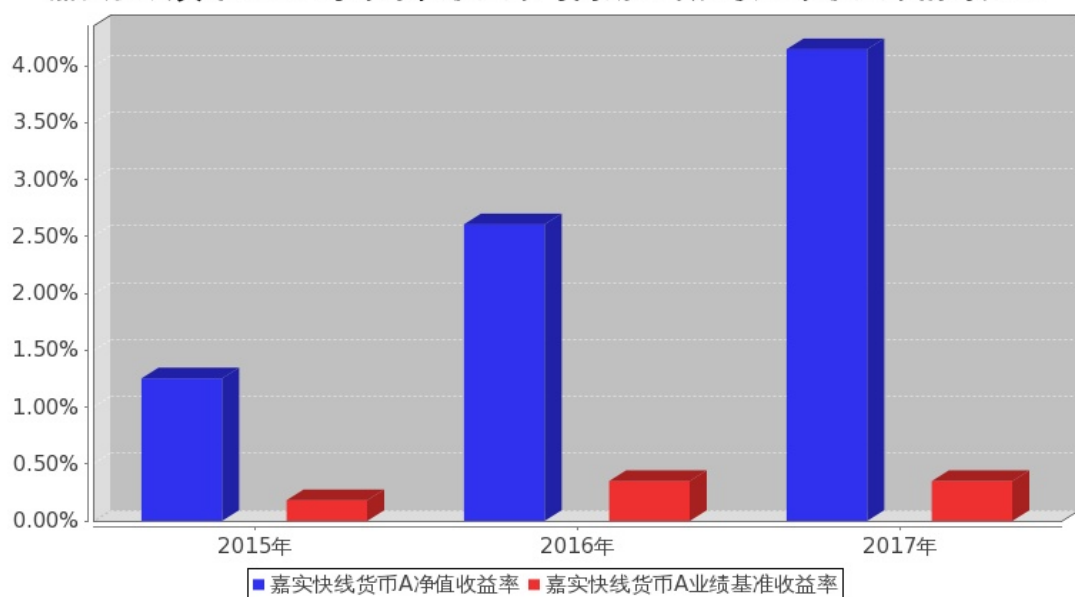


图 4：嘉实快线货币 H 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015 年 12 月 31 日至 2017 年 12 月 31 日)

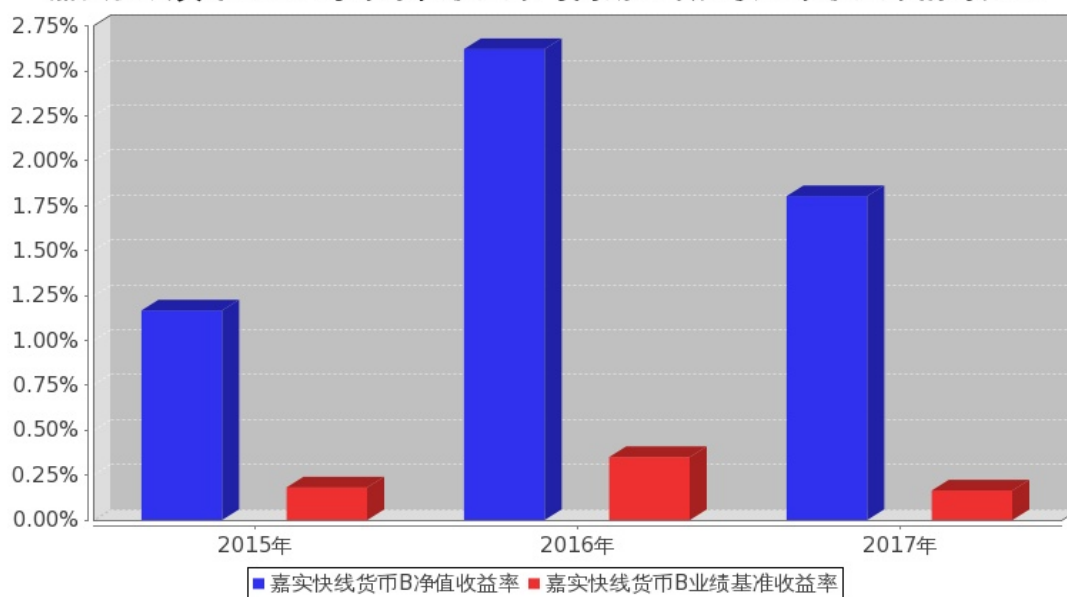
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

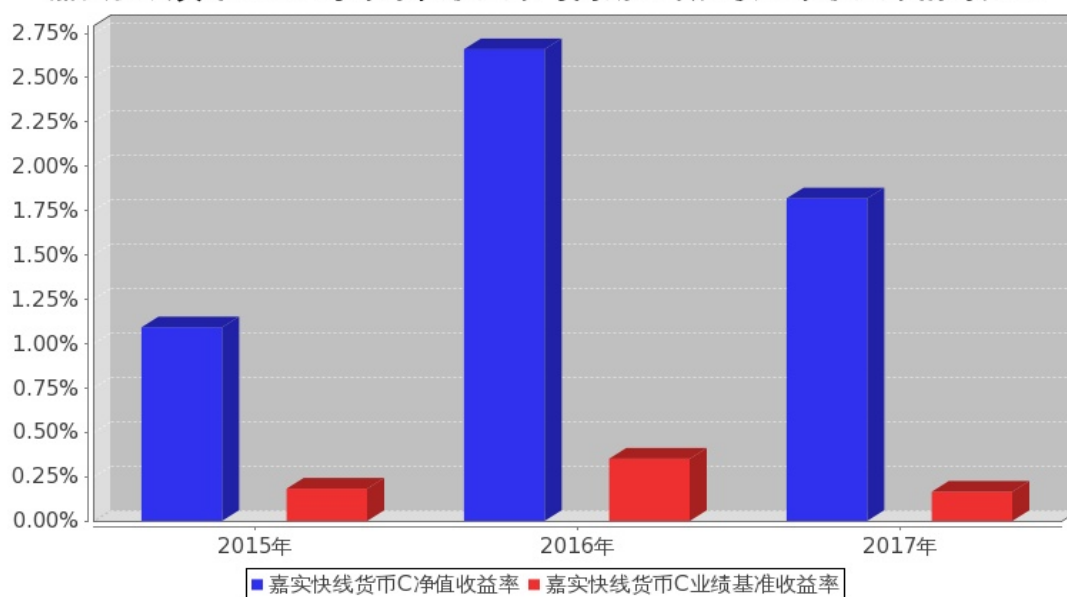
嘉实快线货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



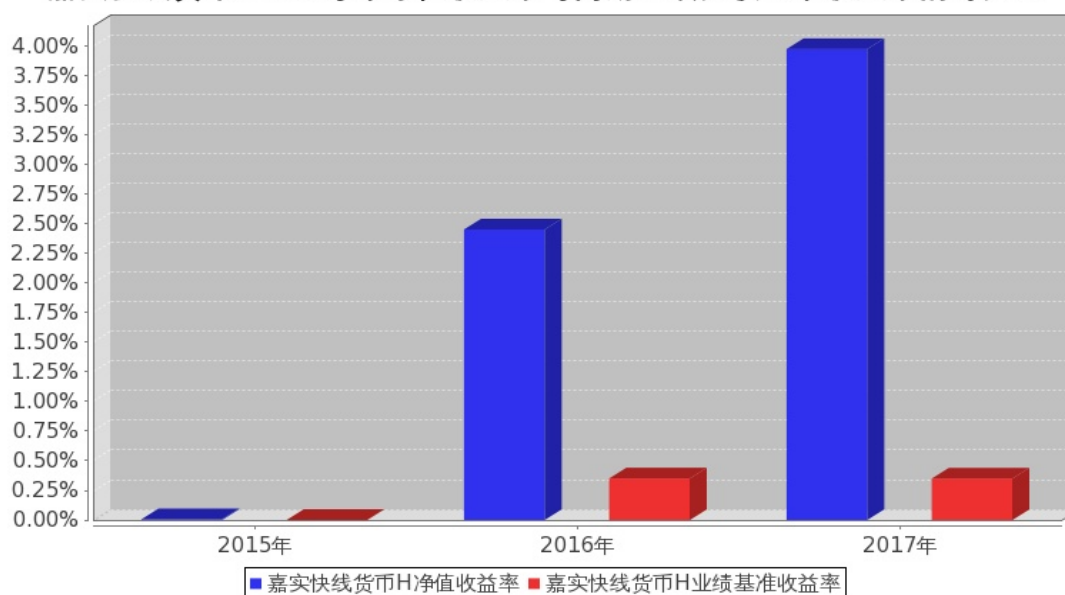
嘉实快线货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实快线货币C基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实快线货币H基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：（1）：嘉实快线货币 A、嘉实快线货币 B、嘉实快线货币 C 基金合同生效日为 2015 年 6 月 25 日，2015 年度的相关数据根据当年实际存续期（2015 年 6 月 25 日至 2015 年 12 月 31 日）计算；（2）：嘉实快线货币 H 基金 2015 年度的相关数据根据当年实际存续期 2015 年 12 月 31 日计算；（3）：嘉实快线货币 B、嘉实快线货币 C 基金 2017 年度的相关数据根据当年实际存续期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 20 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

嘉实快线货币 A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2017 年	1,169,507,552.40	-	-	1,169,507,552.40	-
2016 年	93,645,486.41	-	-	93,645,486.41	-
2015 年	6,919,639.75	1,696,424.40	9,987,229.86	18,603,294.01	-
合计	1,270,072,678.56	1,696,424.40	9,987,229.86	1,281,756,332.82	-

嘉实快线货币 B

年度	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	年度利润分配合计	备注
2017 年	68,907,309.14	-	-	68,907,309.14	-
2016 年	74,087,540.76	-	-	74,087,540.76	-
2015 年	9,672,293.26	2,054,416.24	859,825.74	12,586,535.24	-
合计	152,667,143.16	2,054,416.24	859,825.74	155,581,385.14	-

嘉实快线货币 C

年度	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	年度利润分配合计	备注
2017 年					
2016 年					
2015 年					
合计					

2017 年	245,016,561.59	-	-	245,016,561.59	-
2016 年	201,621,545.50	-	-	201,621,545.50	-
2015 年	40,898,353.36	4,555,820.45	-10,847,055.60	34,607,118.21	-
合计	487,536,460.45	4,555,820.45	-10,847,055.60	481,245,225.30	-

嘉实快线货币 H

年度	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	年度利润分配合计	备注
2017 年	8,495,907.75	-	-	8,495,907.75	-
2016 年	31,299,266.07	-	-	31,299,266.07	-
2015 年	68,338.58	-	-	68,338.58	-
合计	39,863,512.40	-	-	39,863,512.40	-

§ 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 12 月 31 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、141 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、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实稳愉债券、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实稳悦纯债债券、嘉实致博纯债债券、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票。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	2015 年 7 月 14 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

	1 个月理财债券、嘉实 3 个月理财债券、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券基金经理				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。
万晓西	本基金、嘉实货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实 3 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实 6 个月理财债券基金经理，公司固定收益业务体系短端 alpha 策略组组长	2015 年 6 月 25 日	-	17 年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理，第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理，民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理，2013 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系短端 alpha 策略组组长，中国国籍。
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、嘉实现金宝货币、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	2016 年 4 月 21 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、	2016 年 2 月 5 日	-	8 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

	嘉实 3 个月理财债券、嘉实现金宝货币、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				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）基金经理万晓西的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理张文玥、李金灿、李瞳的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；（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万晓西先生、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）本基金基金经理张文玥女士已结束休假，自 2018 年 1 月 12 日起恢复履行基金经理职务。该事项已于 2018 年 1 月 12 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遵规守信情况的说明

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、《嘉实快线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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投

资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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，央行主导下货币政策保持稳健中性，货币市场收益率波动性增加，债券市场利率整体上行。宏观经济数据显示，2017 年整体经济呈现平稳增长，供给侧改革和去产能过程收到明显成效，CPI 保持低位运行，PPI 冲高后回落，房地产市场继续遭到政策打压，工业增速数据波动较大。从国际上看，全球经济增长势头有所加强，2017 年美联储加息三次，欧元区经济环境改善，英国通胀形势向好，英国央行加息，日本通胀有所回升，全球货币收紧预期升温，美元指数表现较弱，美债收益率整体上行，人民币贬值压力有所缓解。针对上述宏观经济环境，央行更加注重货币政策执行的前瞻性、针对性和灵活性，完善宏观审慎政策框架，根据经济和市场运行情况，运用公开市场操作和各类创新工具对市场资金面进行预调微调。中央经济工作会议明确下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在首要位置，未来金融领域的监管过程仍将延续，资金面也存在多重不确定因素，央行切实管住货币供给总闸门，整体货币市场整体处于紧平衡状态。2017 年央行上调公开市场逆回购操作利率和 MLF 利率三次共 0.25%，其中 12 月央行上调了 0.05%。对于 12 月利率上调的原因，央行强调了“目前货币市场利率显著高于公开市场操作利率，

此次公开市场操作利率小幅上行可适度收窄二者之间的利差，有助于修复市场扭曲，理顺货币政策传导机制。”2017 央行公开市场逆回购、MLF、国库现金等净投放 11192 亿，为了调节市场流动性缺口。2017 年以来货币政策实实在在的贯彻了“稳健中性”，保持灵活性，避免了某一阶段资金面持续收紧或宽松引发市场对稳健中性货币政策取向的误读。由于银行 MPA 考核，全年非银机构融资难度较大，市场资金利率波动性上升。2017 年全年银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 2.72%和 3.35%，较 2016 年均值 2.11%和 2.55%分别上行 0.61%和 0.80%。2017 年债券市场剧烈波动，收益率整体上行。4 季末 1 年期和 10 年期国开债收益率分别收于 4.68%和 4.82%，较 2016 年底 3.18%和 3.68%大幅上行。2017 年信用债市场在资金紧张和估值上行压力推动下，收益率也跟随利率债上扬。2017 年末 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率由 2016 年末的 3.91%升至 5.22%，同期中评级的 AA+级短融收益率则由 4.17%上行至 5.50%。在一级市场债券发行利率明显高于 1 年期贷款基准利率 4.35%的情况下，部分高资质债券发行人取消发行计划，转而寻求银行的贷款资金支持，2017 年整体信用债发行净增量比 2016 年降低。

2017 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；灵活配置逆回购、银行存单、债券和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制银行存款和债券资产配置比例，组合保持中性久期，在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险；谨慎筛选组合投资个券，严控信用风险；灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看，2017 年本基金成功应对了市场和规模波动，投资业绩平稳，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

本报告期嘉实快线货币 A 的基金份额净值收益率为 4.1446%，嘉实快线货币 H 的基金份额净值收益率为 3.9733%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 20 日，嘉实快线货币 B 的基金份额净值收益率为 1.8043%，嘉实快线货币 C 的基金份额净值收益率为 1.8193%，同期业绩比较基准收益率为 0.1648%。

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 2018 年，宏观经济、货币政策和短期资金面仍是影响货币市场的主要因素。整体看，全球主要经济体增长形势较好。美国经济稳步复苏，美联储加息节奏和美元走势是影响市场的关键因素；特朗普推动的减税政策可能会提升美国经济复苏的幅度，还对全球经济增长格局带来长期深远影响；欧洲和日本经济增长较好，通胀回升空间更大，市场对于其未来缩减 QE 和加息预期空间更大；新兴经济体将受益于大宗商品价格上升和汇率升值的好处，预期主要货币汇率需要

一段时间达成再平衡；由此带来的影响将错综复杂。而国内经济运行也面临多重问题和挑战，预计 2017 年 GDP 实际增速在 6.5%到 7.0%区间运行，贡献主要来自于棚改货币化、出口增长和去产能导致 PPI 走出通缩并形成阶段性正反馈效应。但是增长过程中的结构性失衡依然存在，需要继续深化供给侧改革。中央政治局会议明确要防范化解重大风险，要使宏观杠杆率得到有效控制，中央经济工作会议提出打好防范化解重大风险攻坚战，重点是防控金融风险，针对上述国内外经济形势和货币环境，预计 2018 年在央行的主导下，货币政策将会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性，根据实体经济增长情况和市场变动，综合运用公开市场操作和各类创新工具进行调整和指导，以支持实体经济增长势头。2018 年整体金融市场去杠杆过程将延续，监管文件的出台和实施，会使得市场资金面波动概率增加。央行公开市场操作、回购利率和各种定向或创新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。2018 年受基数、天气原因和油价等因素影响，预期通胀有上行趋势。非标融资将受到更大的限制，企业将会更加倚赖直接融资，债市供给维持高位，这些方面的政策投资者均要重点关注。

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、存单和债券投资，谨慎选择组合的信用券种持仓，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、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及 2015 年 12 月 23 日公告的《关于嘉实机构快线货币市场基金增设场

内份额并相应修订基金合同部分条款的公告》第十七部分（二）基金收益分配原则的规定，本期 A 类基金份额已实现收益为 1,169,507,552.40 元，合计分配 1,169,507,552.40 元；B 类基金份额已实现收益为 68,907,309.14 元，合计分配 68,907,309.14 元；C 类基金份额已实现收益为 245,016,561.59 元，合计分配 245,016,561.59 元；H 类基金份额已实现收益为 8,495,907.75 元，合计分配 8,495,907.75 元，符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对嘉实快线货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对嘉实快线货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

嘉实快线货币市场基金 2017 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师许薛竞、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2018)第 22378 号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 嘉实机构快线货币市场基金

报告截止日: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	23,247,982,297.47	7,343,157,589.05
结算备付金		222,127,272.73	31,115,000.00
存出保证金		20,421.48	-
交易性金融资产	7.4.7.2	13,705,720,092.73	3,027,826,418.21
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,684,500,092.73	3,027,826,418.21
资产支持证券投资		21,220,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	9,735,589,352.76	11,456,569,949.15
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	317,757,754.08	49,099,910.71
应收股利		-	-
应收申购款		23,837,752.15	768,438,134.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	80,000.00	80,000.00
资产总计		47,253,114,943.40	22,676,287,002.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,203,081,436.09	-

应付证券清算款		3,000,000,000.00	-
应付赎回款		2,157,349.72	163,111.00
应付管理人报酬		6,660,668.25	2,423,684.34
应付托管费		2,664,267.30	1,208,069.38
应付销售服务费		459,799.56	118,866.53
应付交易费用	7.4.7.7	415,592.72	117,903.21
应交税费		-	-
应付利息		2,885,370.89	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	459,417.49	429,000.00
负债合计		7,218,783,902.02	4,460,634.46
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	40,034,331,041.38	22,671,826,367.54
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		40,034,331,041.38	22,671,826,367.54
负债和所有者权益总计		47,253,114,943.40	22,676,287,002.00

注： 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，嘉实快线货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 39,966,292,570.01 份；嘉实快线货币 H 基金份额净值 100.0000 元，基金份额总额 680,384.71 份。基金份额总额合计为 39,966,972,954.72 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实快线货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		1,704,292,480.80	474,800,944.66
1. 利息收入		1,706,198,763.39	469,997,160.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	830,029,001.81	274,803,411.33
债券利息收入		529,439,747.25	150,589,189.33
资产支持证券利息收入		1,527,986.65	-
买入返售金融资产收入		345,202,027.68	44,604,560.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,906,282.59	4,803,783.80

其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-1,906,282.59	4,803,783.80
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)	7.4.7.13	-	-
减：二、费用		212,365,149.92	74,147,105.92
1. 管理人报酬		58,705,016.50	31,622,197.16
2. 托管费		25,652,649.94	15,568,431.09
3. 销售服务费		3,691,109.02	2,338,102.63
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		123,733,208.14	23,936,486.68
其中：卖出回购金融资产 支出		123,733,208.14	23,936,486.68
6. 其他费用	7.4.7.15	583,166.32	681,888.36
三、利润总额(亏损总额以“- ”号填列)		1,491,927,330.88	400,653,838.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)		1,491,927,330.88	400,653,838.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实机构快线货币市场基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31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)	22,671,826,367.54	-	22,671,826,367.54
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期净利润)	-	1,491,927,330.88	1,491,927,330.88

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)	17,362,504,673.84	-	17,362,504,673.84
其中：1. 基金申购款	285,419,217,228.99	-	285,419,217,228.99
2. 基金赎回款	-268,056,712,555.15	-	-268,056,712,555.15
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)	-	-1,491,927,330.88	-1,491,927,330.88
五、期末所有者权益(基金净值)	40,034,331,041.38	-	40,034,331,041.38
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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)	26,211,976,382.87	-	26,211,976,382.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	400,653,838.74	400,653,838.74
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)	-3,540,150,015.33	-	-3,540,150,015.33
其中：1. 基金申购款	243,590,095,088.30	-	243,590,095,088.30
2. 基金赎回款	-247,130,245,103.63	-	-247,130,245,103.63
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)	-	-400,653,838.74	-400,653,838.74
五、期末所有者权益(基金净值)	22,671,826,367.54	-	22,671,826,367.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 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。

7.4.3 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司

7.4.4 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。

7.4.4.1 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12月31日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016年12月31日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	58,705,016.50	31,622,197.16
其中：支付销售机构的客户维护费	430,068.63	272,773.78

注：（1）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该类份额的基金资产净值的年管理费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其中本基金的A类基金份额和H类基金份额年管理费率为0.25%，B类基金份额年管理费率为0.22%，C类基金份额年管理费率为0.18%。

其计算公式为：每类基金份额日管理人报酬=该类基金份额前一日基金资产净值×该类基金份额

年管理费率/当年天数。

(2) 根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实快线货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2017 年 6 月 20 日表决通过了《关于嘉实快线货币市场基金合并基金份额设置并降低基金费率的议案》，对原场外份额 A 类、B 类、C 类基金份额的表述全部修订为 A 类基金份额并删除原合同中关于份额升级的描述，基金管理人 A 类基金份额和 H 类基金份额年管理费率调整为 0.15%，自表决通过日次日起执行。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,652,649.94	15,568,431.09

注：(1) 支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值

0.10%/0.06%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×该日适用费率 / 当年天数。

(2) 根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实快线货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2017 年 6 月 20 日表决通过了《关于嘉实快线货币市场基金合并基金份额设置并降低基金费率的议案》，基金托管人的托管费率由 0.10%调整为 0.06%，自表决通过日次日起执行。

7.4.4.2.3 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				
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 B	嘉实快线货币 C	嘉实快线货币 H	合计
嘉实基金管理有限 公司	2,672,821.91	165,467.62	618,593.51	124,939.81	3,581,822.85
浦发银行	1,167.50	36.46	155.40	-	1,359.36
嘉实财富	3,389.92	-	-	-	3,389.92
合计	2,677,379.33	165,504.08	618,748.91	124,939.81	3,586,572.13
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间				

	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 B	嘉实快线货币 C	嘉实快线货币 H	合计
嘉实基金管理有限 公司	333,989.92	259,280.47	759,231.58	916,112.27	2,268,614.24
浦发银行	6.72	7.54	37.64	-	51.90
嘉实财富	1,986.29	-	-	-	1,986.29
合计	335,982.93	259,288.01	759,269.22	916,112.27	2,270,652.43

注：（1）本基金 A 类、B 类、C 类基金份额的销售服务费年率均为 0.01%，H 类基金份额的销售服务费为 0.25%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法：各类别基金份额日销售服务费 = 各类别基金份额前一日资产净值 × 各类别基金份额适用的销售服务费率 / 当年天数。

（2）根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实机构快线货币市场基金销售服务费优惠活动的公告》，自 2016 年 7 月 4 日至 2017 年 7 月 4 日止期间，本基金 H 类基金份额销售服务费年费率由 0.25% 变更为 0.01%。

（3）根据《嘉实基金管理有限公司关于嘉实快线货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2017 年 6 月 21 日起，嘉实快线 A、B、C 类份额全部修订为 A 类份额，销售服务率为 0.01%，H 类份额销售服务率为 0.25%。

7.4.4.3 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

银行间市场 交易的 各关联方名 称	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日					
	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
浦发银行	756,215,492.34	-	-	-	8,336,910,000.00	1,014,717.52

注：上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 B	嘉实快线货币 C	嘉实快线货币 H
期初持有的基金份额	-	-	201,107,743.19	-
期间申购/买入总份额	4,150,402,898.52	1,061,352,933.52	672,857,445.95	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	3,480,448,488.21	1,061,352,933.52	873,965,189.14	-
期末持有的基金份额	669,954,410.31	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.68%	-	-	-
项目	上年度可比期间			
	2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日			
	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 B	嘉实快线货币 C	嘉实快线货币 H
期初持有的基金份额	-	-	714,430.18	-
期间申购/买入总份额	1,076,857,956.89	1,077,457,757.06	781,166,006.00	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,076,857,956.89	1,077,457,757.06	580,772,692.99	-
期末持有的基金份额	-	-	201,107,743.19	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	2.36%	-

注：本报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日），基金管理人持有的嘉实机构快线货币 A 级、B 级、C 级基金份额期间申购/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。

7.4.4.4.2 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

嘉实快线货币 A

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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 (%)
嘉实资本	9,929,437.37	0.02	-	-

嘉实快线货币 C

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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 (%)

嘉实资本	-	-	9,537,498.62	0.11
------	---	---	--------------	------

7.4.4.5 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 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	2,019,982,297.47	73,950,721.82	723,157,589.05	36,638,918.23

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，活期银行存款按适用利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。（2）本期末（2017年12月31日），本基金由浦发银行保管的银行存款余额含定期存款 2,000,000,000.00 元，本期（2017年1月1日至2017年12月31日），由浦发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 12,931,249.99 元；上年度末（2016年12月31日），本基金由浦发银行保管的银行存款余额含定期存款 100,000,000.00 元，上年度可比期间（2016年1月1日至2016年12月31日），由浦发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 22,809,779.48 元。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2017年1月1日至2017年12月31日）及上年度可比期间（2016年1月1日至2016年12月31日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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（2017年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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 4,203,081,436.09 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
111718427	17 华夏银行 CD427	2018 年 1 月 2 日	98.16	2,000,000.00	196,320,341.86

111720215	17 广发银行 CD215	2018 年 1 月 2 日	99.03	1,100,000.00	108,927,535.57
111720215	17 广发银行 CD215	2018 年 1 月 3 日	99.03	4,130,000.00	408,973,383.55
111720215	17 广发银行 CD215	2018 年 1 月 9 日	99.03	4,130,000.00	408,973,383.55
111720215	17 广发银行 CD215	2018 年 1 月 10 日	99.03	4,130,000.00	408,973,383.55
111712296	17 北京银行 CD296	2018 年 1 月 10 日	97.92	1,000,000.00	97,924,592.20
111712299	17 北京银行 CD299	2018 年 1 月 10 日	97.90	1,000,000.00	97,903,171.70
111718460	17 华夏银行 CD460	2018 年 1 月 10 日	97.91	1,000,000.00	97,911,343.29
111720215	17 广发银行 CD215	2018 年 1 月 10 日	99.03	1,500,000.00	148,537,548.51
111781301	17 南京银行 CD139	2018 年 1 月 10 日	97.60	810,000.00	79,057,535.93
111781455	17 南京银行 CD142	2018 年 1 月 10 日	98.73	2,000,000.00	197,454,581.99
111781456	17 南京银行 CD143	2018 年 1 月 10 日	97.67	1,000,000.00	97,669,517.75
170204	17 国开 04	2018 年 1 月 3 日	99.91	2,000,000.00	199,824,373.68
170301	17 进出 01	2018 年 1 月 3 日	99.96	3,000,000.00	299,889,231.93
170401	17 农发 01	2018 年 1 月 3 日	99.99	5,530,000.00	552,972,158.06
150406	15 农发 06	2018 年 1 月 3 日	100.02	22,000.00	2,200,417.43
170301	17 进出 01	2018 年 1 月 4 日	99.96	901,000.00	90,066,732.66
170401	17 农发 01	2018 年 1 月 4 日	99.99	4,150,000.00	414,979,105.96
150401	15 农发 01	2018 年 1 月 2 日	100.01	1,600,000.00	160,022,172.71
150406	15 农发 06	2018 年 1 月 2 日	100.02	441,000.00	44,108,367.53
160406	16 农发 06	2018 年 1 月 2 日	99.96	1,000,000.00	99,957,037.63
170203	17 国开 03	2018 年 1 月 2 日	99.97	1,000,000.00	99,972,477.04
合计				43,444,000.00	4,312,618,394.08

7.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末（2017 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	13,705,720,092.73	29.00
	其中：债券	13,684,500,092.73	28.96
	资产支持证 券	21,220,000.00	0.04
2	买入返售金融资产	9,735,589,352.76	20.60
	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	23,470,109,570.20	49.67
4	其他各项资产	341,695,927.71	0.72
5	合计	47,253,114,943.40	100.00

8.2 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	9.07	
	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	4,203,081,436.09	10.50
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

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。

8.3.2 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	57.99	17.99

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	9.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	19.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	117.18	17.99

8.4 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。

8.5 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	698,711,090.10	1.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,559,721,416.15	6.39
	其中：政策性金融债	2,559,721,416.15	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,049,970,028.15	2.62
6	中期票据	70,266,804.14	0.18
7	同业存单	9,305,830,754.19	23.24
8	其他	-	-
9	合计	13,684,500,092.73	34.18
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。

8.6 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：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	111715502	17 民生银行 CD502	15,000,000	1,494,336,651.57	3.73
2	111720215	17 广发银行 CD215	15,000,000	1,485,375,485.05	3.71
3	170401	17 农发 01	9,900,000	989,950,156.38	2.47
4	111770785	17 重庆银行 CD189	6,000,000	594,252,583.68	1.48
5	111716283	17 上海银行 CD283	5,000,000	499,008,759.90	1.25
6	111785465	17 天津银行 CD197	5,000,000	494,014,954.80	1.23
7	111710686	17 兴业银行 CD686	4,200,000	414,663,986.35	1.04
8	170301	17 进出 01	4,000,000	399,852,309.24	1.00
9	111786132	17 天津银行 CD210	4,000,000	399,499,088.07	1.00
10	111781304	17 徽商银行 CD111	4,000,000	399,211,969.75	1.00

8.7 “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	0.0244%
报告期内偏离度的最低值	-0.0297%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0068%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1789164	17 惠益 1A1	1,000,000	21,220,000.00	0.05

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，嘉实快线货币 A 类基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元，嘉实快线货币 H 类基金份额账面净值始终保持为 100.00 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。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.9.3 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	20,421.48
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	317,757,754.08
4	应收申购款	23,837,752.15
5	其他应收款	80,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	341,695,927.71

§9 基金份额持有人信息

9.1 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(%)
嘉实快线货币 A	26,092	1,531,745.08	38,747,417,580.37	96.95	1,218,874,989.64	3.05
嘉实快线	-	-	-	-	-	-

货币 B						
嘉实快线货币 C	-	-	-	-	-	-
嘉实快线货币 H	417	1,631.62	114,743.12	16.86	565,641.59	83.14
合计	26,509	1,507,675.62	38,747,532,323.49	96.95	1,219,440,631.23	3.05

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

(2) 嘉实快线货币 H: 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快线货币 H 份额占嘉实快线货币 H 总份额比例、个人投资者持有嘉实快线货币 H 份额占嘉实快线货币 H 总份额比例。

9.2 期末上市基金前十名持有人

嘉实快线货币 H

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	李强	98,255.00	14.44
2	莫顺红	83,939.00	12.34
3	杨水生	52,790.00	7.76
4	深圳市前海睿晟资产管理有限公司一方舟对冲套利一号私募证券投资基金	30,964.00	4.55
5	深圳鑫域股权投资企业(有限合伙)	29,991.00	4.41
6	张远	28,609.00	4.20
7	黄晓峰	15,626.00	2.30
8	深圳宏泰源资产管理有限公司一宏泰一号私募证券投资基金	15,351.00	2.26
9	陈铁华	13,612.00	2.00
10	周坤明	11,313.00	1.66

注：上述基金持有人份额均为场内份额。

9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	银行类机构	6,124,818,704.39	15.32
2	银行类机构	4,075,951,802.84	10.20
3	银行类机构	2,028,164,009.56	5.07
4	银行类机构	1,811,742,851.01	4.53

5	银行类机构	1,563,707,816.85	3.91
6	其他机构	1,508,753,229.04	3.78
7	券商类机构	1,504,356,862.02	3.76
8	银行类机构	1,333,538,019.61	3.34
9	银行类机构	1,018,718,173.64	2.55
10	银行类机构	810,410,310.60	2.03

9.4 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	嘉实快线货币 A	22,163,684.45	0.06
	嘉实快线货币 B	-	-
	嘉实快线货币 C	-	-
	嘉实快线货币 H	-	-
	合计	22,163,684.45	0.06

9.5 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	嘉实快线货币 A	>=100
	嘉实快线货币 B	0
	嘉实快线货币 C	0
	嘉实快线货币 H	0
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实快线货币 A	10~50
	嘉实快线货币 B	0
	嘉实快线货币 C	0
	嘉实快线货币 H	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 B	嘉实快线货币 C	嘉实快线货币 H
----	----------	----------	----------	----------

基金合同生效日 (2015年6月 25日)基金份额 总额	230,338,805.42	-	-	-
本报告期期初基 金份额总额	12,059,202,218.03	1,298,890,512.04	8,510,845,108.15	8,028,885. 29
本报告期基金总 申购份额	207,588,618,863.94	46,800,899,704.86	31,005,235,152.44	244,635.07
减:本报告期基 金总赎回份额	179,681,528,511.96	48,099,790,216.90	39,516,080,260.59	7,593,135. 65
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	39,966,292,570.01	-	-	680,384.71

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级调增份额,总赎回份额含转换出及基金份额自动降级调减份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本次基金份额持有人大会以通讯方式召开,由权益登记日(权益登记日为2017年5月19日)登记在册的本基金基金份额持有人对本次会议议案进行表决,大会表决投票时间从2017年5月19日起至2017年6月19日17:00止,会议审议通过了《关于嘉实快线货币市场基金合并基金份额设置并降低基金费率的议案》。2017年6月21日,本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于嘉实快线货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,该决议自2017年6月20日起生效。

11.2 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12月26日本基金管理人发布公告,牛成立先生为公司联席董事长,赵学军先生为公司董事长并代行公司总经理职权。邓红国先生因任期届满不再担任公司董事长职务。

(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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 150,000.00 元，该审计机构已连续 3 年为本基金提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证	1	-	-	-	-	-

券有限公司						
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	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。

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。

3. 报告期内, 本基金退租以下交易单元: 中信证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	299,248,543.26	100.00%	339,853,179,000.00	100.00%	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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%。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2017/06/29 至 2017/07/03	-	9,031,964,405.08	8,531,964,405.08	500,000,000.00	1.25
	2	2017/07/18 至 2017/07/18	-	4,032,550,022.49	4,032,550,022.49	-	-
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连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临

转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018年3月21日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2018年3月21日起经雷先生担任公司总经理。自经雷先生任公司总经理职务之日起，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

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

2018年03月28日