

# 嘉实现金添利货币市场基金

## 更新招募说明书摘要

(2018年第2号)

**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**

### 重要提示

嘉实现金添利货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2014年4月28日证监许可[2014]442号文《关于核准嘉实现金添利货币市场基金募集的批复》注册募集，并于2017年3月23日经机构部函[2017]793号《关于嘉实现金添利货币市场基金延期募集备案的回函》确认。本基金基金合同于2017年3月29日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年9月29日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日（未经审计）。



## 一、基金管理人

### （一）基金管理人基本情况

#### 1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
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
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国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，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问，JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JP Morgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今，任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

雷霆先生，总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

万晓西先生，18年证券从业经历，曾任职于中国农业银行黑龙江省分行国际业务部、市场开发处及深圳发展银行国际业务部、资金交易中心，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员，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。2007年6月6日至2009年10月20日任南方现金增利货币基金经理。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，经济学硕士，中国国籍，2013年7月5日至2014年7月16日任嘉实信用债券和嘉实增强收益定期债券基金经理，2013年9月4日至2014年9月19日任嘉实丰益策略定期债券基金经理，2013年12月18日至今任嘉实活期宝货币基金经理，2013年12月11日至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金经理，2014年3月17日至今任嘉实活钱包货币市场基金经理，2014年6月27日至今任嘉实3个月理财债券型证券投资基金经理，2015年6月25日至今任嘉实快线货币基金经理。2017年5月24日至今任嘉实货币、嘉实薪金宝货币基金经理。2017年6月19日至今任嘉实6个月理财债券基金经理。2017年3月29日至今任本基金基金经理。

李瞳先生，硕士研究生，9年证券从业经历。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。2015年1月28日至今任嘉实活钱包货币基金经理。2015年5月14日至今任嘉实安心货币、嘉实理财宝7天债券基金经理，2016年1月28日至今任嘉实货币、嘉实活期宝货币基金经理，2016年4月21日至今任嘉实快线货币基金经理，2016年12月22日至今任嘉实现金宝货币基金经理。2017年5月24日至今任嘉实超短债债券基金经理。2017年5月25日至今任嘉实宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券基金经理。2017年4月13日至今本基金基金经理。

李金灿先生，硕士研究生，具有基金从业资格，9年证券从业经历。曾任 Futex Trading Ltd 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担任债券交易员。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。2015年6月9日至今任嘉实超短债债券和嘉实宝基金经理，2016年1月28日至今任嘉实薪金宝货币基金经理，2016年2月5日至今任嘉实机构快线货币基金经理，2016年7月23日至今任嘉实安心货币和嘉实理财宝7天债券基金经理，2016年12月27日至今任嘉实增益宝货币基金经理，2017年5月24日至今任嘉实1个

月理财债券基金经理，2017年5月25日至今任嘉实活期宝货币、嘉实现金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实活钱包货币基金经理，2017年6月29日至今任嘉实6个月理财债券基金经理，2017年5月25日至今任本基金基金经理。

(2) 历任基金经理

无。

3、债券投资决策委员会

债券投资决策委员会的成员包括：公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系策略组组长王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及养老金固收投资组长王怀震先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、

基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2018 年 6 月 30 日，中国银行已托管 674 只证券投资基金，其中境内基金 638 只，QDII 基金 36 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街 7 号北京万豪中心 D 座 12 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵佳		

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心 2 期 53 层 09-11 单元		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	邵琦		

##### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	王启明		

##### （4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层		
电话	(0755) 84362200	传真	(0755) 25870663



联系人	陈寒梦
-----	-----

## (5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室		
电话	(0532) 66777997	传真	(0532) 66777676
联系人	胡洪峰		

## (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城2幢1001A室		
电话	(0571) 88061392	传真	(0571) 88021391
联系人	王振		

## (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路137号信合广场801A单元		
电话	0591-88013670	电话	0591-88013670
联系人	吴志锋		

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路288号新世纪广场A座4202室		
电话	(025) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	徐莉莉		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心50层05-06A单元		
电话	(020) 88832125	传真	(020) 81552120
联系人	周炜		

## 2、代销机构

## (1) 中国银行股份有限公司

办公地址	中国北京市复兴门内大街1号		
注册地址	北京市复兴门内大街1号		
法定代表人	陈四清		
电话	(010)66596688	传真	(010)66594946
网址	http://www.boc.cn	客服电话	95566

## (2) 四川天府银行股份有限公司

办公地址	四川省南充市顺庆区滨江中路一段97号26栋		
注册地址	四川省南充市涪江路1号		
法定代表人	黄光伟	联系人	樊海波
电话	028-67676033	传真	028-67676033
网址	http://www.tf.cn		

## (3) 嘉实财富管理有限公司

住所	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
----	---------------------------

办公地址	上海市浦东新区世纪大道八号国金中心二期 53 楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	http://www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

## (4) 中民财富基金销售(上海)有限公司

办公地址	上海市黄浦区老太平弄 88 号 A、B 单元		
注册地址	上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元		
法定代表人	弭洪军	联系人	茅旦青
电话	021-33355392	传真	021-63353736
网址	http://www.cmiwm.com	客服电话	400-876-5716

## (5) 上海挖财基金销售有限公司

住所	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室		
办公地址	上海浦东杨高南路 799 号 3 号楼 5 楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室		
法定代表人	冷飞	联系人	李娟
电话	021-50810687	传真	021-58300279
网址	http://www.wacaijijin.com	客服电话	021-50810673

## (6) 南京途牛金融信息服务有限公司

办公地址	南京市玄武区玄武大道 699-32 号		
注册地址	南京市玄武区玄武大道 699-1 号		
法定代表人	宋时琳	联系人	王旋
电话	025-86853960 025-86853969	传真	025-86853969
网址	http://www.tuniufu.com		

## (二) 登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	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
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层
法定代表人	赵学军
联系人	彭鑫

电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼		
负责人	廖海	联系人	刘佳
电话	(021) 51150298-827	传真	(021) 51150398
经办律师	刘佳、张兰		

## (四) 审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	薛竞、张勇		

#### 四、基金的名称

本基金名称：嘉实现金添利货币市场基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

#### 八、基金的投资策略

##### 1、资产配置策略

在严谨深入的研究分析基础上，本基金综合考量市场资金面走向、存款银行的信用资质，以及各类资产的风险、收益率水平、流动性特征等，确定各类资产的配置比例。

##### 2、组合久期投资策略

根据对市场收益率水平变化趋势的判断，本基金动态调整组合久期，以谋求控制风险，增加或锁定收益。当预期市场收益率水平上升时，本基金适当降低组合久期；当预期市场收益率水平下降时，本基金适当增加组合久期。

##### 3、银行存款投资策略

本基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整体利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。

#### 4、利用短期市场机会的灵活策略

由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

#### 5、投资决策

##### (1) 决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
- 2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；
- 3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

##### (2) 决策程序

- 1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
- 2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。
- 3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。
- 4) 交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。
- 5) 监察稽核部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款税后利率

活期存款是具备最高流动性的存款，本基金期望通过科学严谨的管理，使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益，因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前2日在中国证监会指定媒体上刊登公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	16,538,333,552.93	36.48
	其中：债券	16,413,333,552.93	36.21
	资产支持证券	125,000,000.00	0.28
2	买入返售金融资产	2,399,237,200.00	5.29
	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	26,031,440,945.22	57.42
4	其他资产	365,294,351.33	0.81
5	合计	45,334,306,049.48	100.00

## 2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	13.62	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,492,661,947.41	11.01
	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%。

## 3. 基金投资组合平均剩余期限

### 1.3.1 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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

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。

### 1.3.2 报告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	21.54	11.01
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	19.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	22.93	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	10.15	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

5	120天(含)—397天(含)	35.74	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.17	11.01

#### 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。

#### 5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,110,175,598.97	5.17
	其中: 政策性金融债	2,110,175,598.97	5.17
4	企业债券	70,452,399.07	0.17
5	企业短期融资券	3,421,515,441.32	8.38
6	中期票据	351,049,045.50	0.86
7	同业存单	10,460,141,068.07	25.63
8	其他	-	-
9	合计	16,413,333,552.93	40.21
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。

#### 6. 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111821179	18 渤海银行 CD179	8,000,000	795,068,715.84	1.95
2	111811130	18 平安银行 CD130	7,000,000	695,698,983.18	1.70
3	170410	17 农发 10	6,400,000	640,167,179.84	1.57
4	111808108	18 中信银行 CD108	5,000,000	499,073,978.27	1.22
5	111816126	18 上海银行 CD126	5,000,000	499,055,520.77	1.22
6	111818147	18 华夏银行 CD147	5,000,000	495,987,677.36	1.22
7	111816177	18 上海银行 CD177	5,000,000	495,970,822.51	1.22
8	111898439	18 长沙银行 CD120	5,000,000	495,926,201.47	1.21
9	111895466	18 厦门国际银行 CD073	5,000,000	493,689,670.98	1.21
10	111818179	18 华夏银行 CD179	5,000,000	489,737,133.01	1.20

#### 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	0.0819%
报告期内偏离度的最低值	0.0038%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0330%

#### 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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	149553	宁远 04A1	1,250,000	125,000,000.00	0.31

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只资产支持证券。

### 9. 投资组合报告附注

#### 1.9.1 基金计价方法说明

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。

#### 1.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

#### 1.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	328,122,290.69
4	应收申购款	37,172,060.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	365,294,351.33

## 十二、基金的业绩

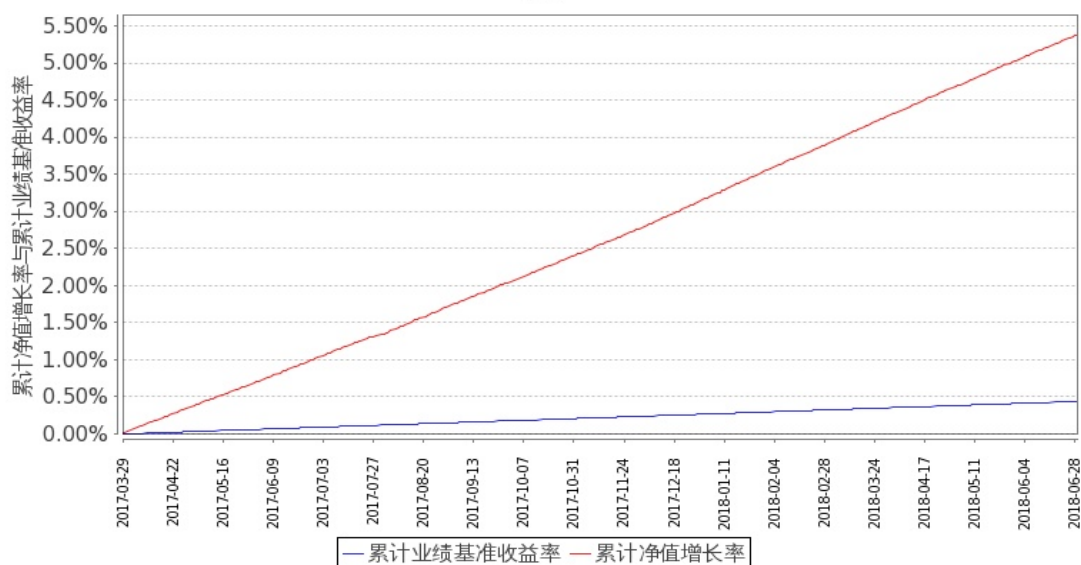
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 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 3月29日 (基金合同 生效日)至 2017年 12月31日	3.1472%	0.0016%	0.2665%	0.0000%	2.8807%	0.0016%
2018年上半 年	2.1724%	0.0011%	0.1734%	0.0000%	1.9990%	0.0011%

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

嘉实现金添利货币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图：嘉实现金添利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

(2017年3月29日至2018年6月30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。

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金的销售服务费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金的开户费用、账户维护费用；
- （10）基金的登记结算费用；
- （11）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.3%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### （3）基金销售服务费

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用。本基金年销售服务费率为 0.22%。本基金可以对不同基金份额类别设定不同的销售服务费率，经与相关销售机构协商（如果需要），报中国证监会备案，并在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

目前，本基金设置单一基金份额类别，销售服务费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构，专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述“1、基金费用的种类”中第（4）—（11）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （二）与基金销售有关的费用

#### 1、申购、赎回的费率

本基金不收取申购费用和赎回费用。但发生以下任一情形时除外：

- （1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银

行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，本基金对当日单个基金份额持有人申请赎回（含转出）基金份额超过基金总份额1%以上的赎回（含转出）申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于本基金利益最大化的情形除外。

（2）如本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，当投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用。

## 2、转换费

本基金与嘉实货币 A/B、嘉实快线货币 A、嘉实安心货币 A/B 互转时，不收取转换费用。但发生以下任一情形时除外：

（1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，本基金对当日单个基金份额持有人申请赎回（含转出）基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回（含转出）申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于本基金利益最大化的情形除外。

（2）如本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，当投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用。

注：嘉实安心货币、嘉实快线货币基金 A、嘉实货币基金、嘉实现金添利货币有单日单个基金账户的累计申购（转入）限制，具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

- 1.在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
- 2.在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
- 3.在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。
- 4.在“五、相关服务机构”部分：更新了相关代销机构信息。
- 5.在“八、基金份额的申购与赎回”部分：根据相关公告更新了赎回费的相关内容。
- 6.在“九、基金的转换”部分：增加了相关基金转换的内容
- 7.在“十、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
- 8.在“十一、基金的业绩”部分：基金业绩更新至2018年第二季度末。
- 9.在“二十三、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2018年3月29日至2018年9月29日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2018年11月10日