

嘉实现金宝货币市场基金 2019 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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。

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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

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	106,399,373.95 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
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95580
传真	(010) 65215588	010-68858120

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

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日
本期已实现收益	1,097,842.78
本期利润	1,097,842.78
本期净值收益率	1.0122%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 06 月 30 日
期末基金资产净值	106,399,373.95
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2019 年 06 月 30 日
累计净值收益率	8.3968%

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。

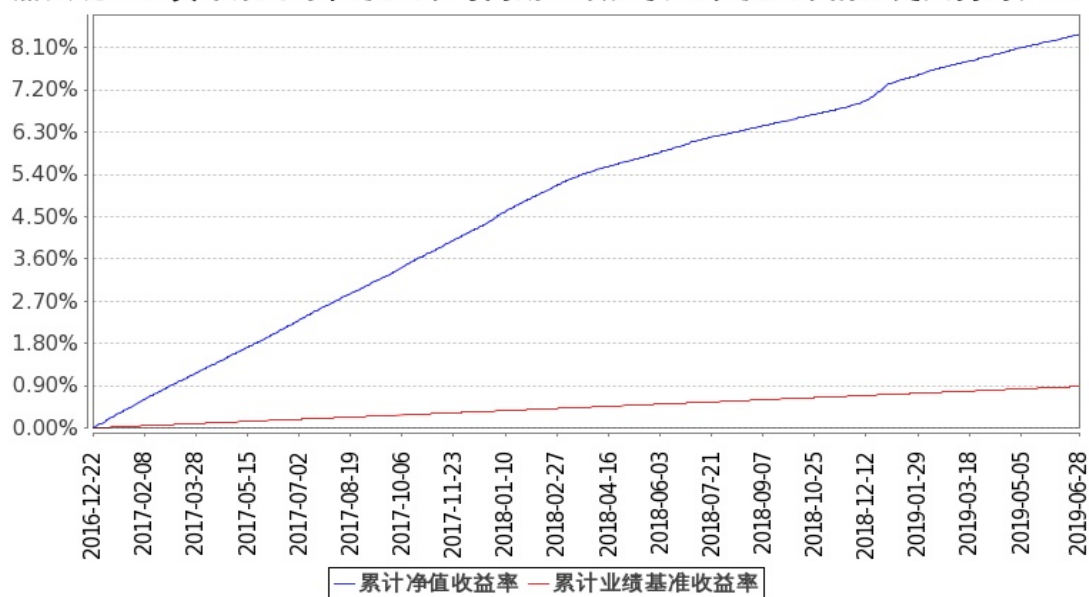
3.2 基金净值表现

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	0.1497%	0.0004%	0.0287%	0.0000%	0.1210%	0.0004%
过去三个月	0.4639%	0.0005%	0.0871%	0.0000%	0.3768%	0.0005%
过去六个月	1.0122%	0.0011%	0.1734%	0.0000%	0.8388%	0.0011%
过去一年	2.1974%	0.0029%	0.3500%	0.0000%	1.8474%	0.0029%
自基金合同生效起至今	8.3968%	0.0034%	0.8855%	0.0000%	7.5113%	0.0034%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2019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。

§ 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、北京怀柔、武汉设有分公司。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2019年6月30日，基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、154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（QDII）混合、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）、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)、嘉实信用债券、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 A/E、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、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、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、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、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、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、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、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债

债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还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		
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、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、嘉实中短债债券、嘉实稳健纯债债券、嘉实汇达中短债债券基金经理	2017 年 5 月 25 日	-	9 年	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。
李瞳	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、	2016 年 12 月 22 日	-	9 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

	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、嘉实中短债债券基金经理				略组。硕士研究生，具有基金从业资格。
张文玥	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、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 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		11 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。

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。

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

今年以来，国内经济面临较大下行压力，以及中美贸易谈判的不确定性有所增加，在这样的背景下央行进行了全面降准、定向中期借贷便利（TMLF）和普惠金融定向降准，流动性总体合理充裕。随后政策托底和地产边际放松的提振效果有所显现，经济小幅回升，流动性边际上收紧。然后地产调控再次收紧，企业融资在年初提前放贷和政策集中发力提振后再次疲弱，同时中美贸易摩擦由持续好转突然升级加剧，经济下行压力再次显现，于是 5 月份央行及时进行了定向降准，超额续作了 MLF，并大量投放逆回购，流动性再次回归合理充裕。5 月底，包商银行突然被监管机构接管，释放出监管层有意打破银行“刚兑”信号，短期对市场信心有所影响，引发交易对手和质押券的重新梳理，以及信用风险偏好的回收，流动性分层现象较为突出。此前，1 年期 AAA 国股存单和城商行存单利差在 10bps 左右；包商事件后，1 年期 AAA 国股存单、AAA 城商行存单、AA+存单发行利率利差明显走阔至 20、30bps。央行而后连续三周进行了大量流动性投放，至 6 月中旬监管部门通过召开座谈会、对锦州银行存单发行进行增信、及时公告处置进度等措施对市场情绪予以平稳，流动性供需基本平衡。

年初以来，资金面总体合理充裕，局部时间边际走紧，松紧程度的波动较大截至 6 月 30 日，由于全面降准、定向降准，以及财政支出力度增大等措施释放较多增量资金，央行公开市场操作净回笼 10451 亿元（含国库现金定存）。其中，逆回购到期 40550 亿元，投放 37750 亿元；MLF 到期 24100 亿元，投放 11400 亿元；TMLF 投放 5249 亿元。年初全面降准和普惠金融定向降准释放增量资金约 5400 亿元，5 月定向降准释放增量资金约 2800 亿元。

2019 年以来货币市场中枢有所下行，半年末银行间隔夜、7 天、1 个月和 3 个月回购加权利率较去年末分别-98bps、-47bps、-11bps 和-27bps 至 1.58%、2.66%、3.41%、3.58%；短端资产价格也有一定幅度下行：3 个月、6 个月和 1 年期 AAA 存单收益率较去年末分别-48bps、-32bps、-30bps 至 2.49%、2.93%和 3.03%。1 年期国债较去年末上行 4bps 至 2.64%；1 年期国开债较去年末持平下行 3bps 至 2.72%。

2019 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券、同业存单和同业存款，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，2019 年上半年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收益率为 1.0122%，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

向后看三季度基本面和政策面对债券市场比较友好。基本面来看，地产投资高位回落、出口消费乏力，基建和社融增速短期内难以快速回升，通胀上行压力也逐步减弱。在此背景下货币政策从宽货币向紧货币的转变将会有所延迟，经济基本面和政策面共同对债券市场形成支撑。但同时三季度债券供给较大，且贸易谈判不确定性一直存在，可能对市场形成一定冲击。四季度基本面可能逐步趋于平稳，政策可能在边际上有所调整。货币政策逐步减少短期操作，预计等量续作 MLF 的降准搭配以 LPR 为贷款报价利率机制降息操作。宽信用的前提是宽货币，故降准旨在维稳资金面，亦不会“大水满贯”；降息旨在进一步降低小微企业融资实际利率。央行货币政策委员会 2019 年二季度例提出“在推动高质量发展中防范化解风险，把握好处置风险的力度和节奏，稳定市场预期”。

包商银行接管事件将会对银行业结构产生深远影响，低等级中小银行同业负债利率中将包含合理的信用利差，其继续通过同业负债去参与其他投资，以此来增加杠杆、增加盈利的行为将逐步收缩，中小银行的同业业务占比也会下降。包商事件后产生流动性分层及杠杆投资模式的变迁，同业存单刚兑的打破督促市场普遍加强交易对手和质押券的风险管理，非银机构赖以生存的加杠杆套利模式会被迫进行调整，双重影响下将直接影响中低评级个券的投资和估值。

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、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 1,097,842.78 元，每日分配，每日支付，合计分配 1,097,842.78 元，符合法律法规的规定和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。

本报告期内，本基金共进行利润分配 109.78 万元。

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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,915,844.01	43,524,401.77
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	59,965,538.72	29,979,302.37
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		59,965,538.72	29,979,302.37
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	39,990,179.99	39,995,259.99
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	671,641.03	1,017,812.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	164,737.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		106,543,203.75	114,681,514.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		509.89	-
应付管理人报酬		15,742.64	16,971.82
应付托管费		6,996.76	7,543.00
应付销售服务费		874.62	942.88

应付交易费用	6.4.7.7	4,019.57	2,773.81
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	115,686.32	259,000.00
负债合计		143,829.80	287,231.51
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	106,399,373.95	114,394,282.68
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		106,399,373.95	114,394,282.68
负债和所有者权益总计		106,543,203.75	114,681,514.19

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 106,399,373.95 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		1,368,697.86	26,475,042.18
1. 利息收入		1,368,697.86	26,469,352.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	190,531.00	8,767,242.92
债券利息收入		647,077.52	9,416,599.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		531,089.34	8,285,509.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	5,689.44
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	5,689.44
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（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	-	-
减：二、费用		270,855.08	2,152,529.99
1. 管理人报酬		97,045.80	1,129,089.51
2. 托管费		43,131.52	506,617.72
3. 销售服务费		5,391.44	63,327.26
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		-	221,810.99
其中：卖出回购金融资产支出		-	221,810.99
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.15	125,286.32	231,684.51
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,097,842.78	24,322,512.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,097,842.78	24,322,512.19

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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	114,394,282.68	-	114,394,282.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,097,842.78	1,097,842.78
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)	-7,994,908.73	-	-7,994,908.73
其中：1. 基金申购款	3,868,915.15	-	3,868,915.15
2. 基金赎回	-11,863,823.88	-	-11,863,823.88

回款			
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）	-	-1,097,842.78	-1,097,842.78
五、期末所有者权益（基金净值）	106,399,373.95	-	106,399,373.95
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	2,673,385,810.68	-	2,673,385,810.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,322,512.19	24,322,512.19
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）	-2,559,094,937.01	-	-2,559,094,937.01
其中：1. 基金申购款	129,425,596.42	-	129,425,596.42
2. 基金赎回款	-2,688,520,533.43	-	-2,688,520,533.43
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）	-	-24,322,512.19	-24,322,512.19
五、期末所有者权益（基金净值）	114,290,873.67	-	114,290,873.67

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：

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

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

本基金本报告期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
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

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（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018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 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	97,045.80	1,129,089.51
其中：支付销售机构的客户维护费	17.77	38.63

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,131.52	506,617.72

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。

6.4.4.2.3 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	嘉实现金宝货币
嘉实基金管理有限公司	5,388.42
合计	5,388.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	嘉实现金宝货币
嘉实基金管理有限公司	63,309.69
合计	63,309.69

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。

6.4.4.3 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	上年度可比期间					
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 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
邮储银行	269,865,271.45	-	-	-	-	-

注：本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 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。

6.4.4.4 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
报告期初持有的基金份额	95,232.62	100,032,118.21
报告期内申购/买入总份额	538.08	1,634,658.66
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	95,770.70	101,666,776.00
报告期末持有的基金份额	-	0.87
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

注：本报告期内（2019年1月1日至2019年6月30日），基金管理人于2019年3月7日赎回本基金份额95,770.70份。上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），基金管理人期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

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

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	99,135,080.09	93.17	100,941,116.46	88.24

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 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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

中国邮政储蓄银行股份有限公司_活期	5,915,844.01	18,286.82	3,739,188.83	22,040.09
-------------------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

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(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018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(2019年06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(2019年6月30日)，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

本期末(2019年6月30日)，本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末(2019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	59,965,538.72	56.28
	其中：债券	59,965,538.72	56.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	39,990,179.99	37.53
	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	5,915,844.01	5.55
4	其他各项资产	671,641.03	0.63
5	合计	106,543,203.75	100.00

7.2 债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过

资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	8
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	40
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

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	99.50	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	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	-	-
	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	99.50	-

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	19,983,682.09	18.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,005,124.37	18.80
	其中: 政策性金融债	20,005,124.37	18.80

4	企业债券		-	-
5	企业短期融资券		-	-
6	中期票据		-	-
7	同业存单		19,976,732.26	18.78
8	其他		-	-
9	合计		59,965,538.72	56.36
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	180209	18 国开 09	200,000	20,005,124.37	18.80
2	199914	19 贴现国债 14	200,000	19,983,682.09	18.78
3	111807188	18 招商银行 CD188	200,000	19,976,732.26	18.78

注:报告期末, 本基金仅持有上述 3 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	0.0148%
报告期内偏离度的最低值	-0.0151%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0059%

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名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 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 1.0000 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 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。

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	671,641.03
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	671,641.03

§ 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 (%)
687	154,875.36	100,958,369.55	94.89	5,441,004.40	5.11

8.2 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	基金类机构	99,135,080.09	93.17
2	保险类机构	1,036,868.93	0.97
3	保险类机构	713,723.68	0.67
4	个人	349,438.26	0.33
5	个人	257,147.51	0.24
6	个人	252,037.81	0.24
7	个人	128,177.88	0.12
8	个人	121,362.89	0.11
9	个人	112,353.15	0.11
10	个人	110,644.65	0.10

8.3 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	45,479.25	0.04

8.4 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	0~10
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	114,394,282.68
本报告期基金总申购份额	3,868,915.15
减：本报告期基金总赎回份额	11,863,823.88
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	106,399,373.95

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，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

2019年2月2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2019年2月2日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

2019年6月6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》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019年6月12日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

（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

报告期内，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	-	-	-	-	-

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。

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	-	-	40,000,000.00	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%。

§ 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	2019/01/01 至 2019/06/30	100,941,116.46	1,193,963.63	3,000,000.00	99,135,080.09	93.17
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。

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

2019 年 08 月 29 日