

嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金 2020 年第 2 季度报告

2020 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：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 18 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实融享货币
基金主代码	007696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 14 日
报告期末基金份额总额	16,010,956.22 份
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	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
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。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020 年 4 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	7,913,429.40
2. 本期利润	6,969,905.73

3. 加权平均基金份额本期利润	0.4455
4. 期末基金资产净值	1,637,039,176.24
5. 期末基金份额净值	102.2449

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；（2）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

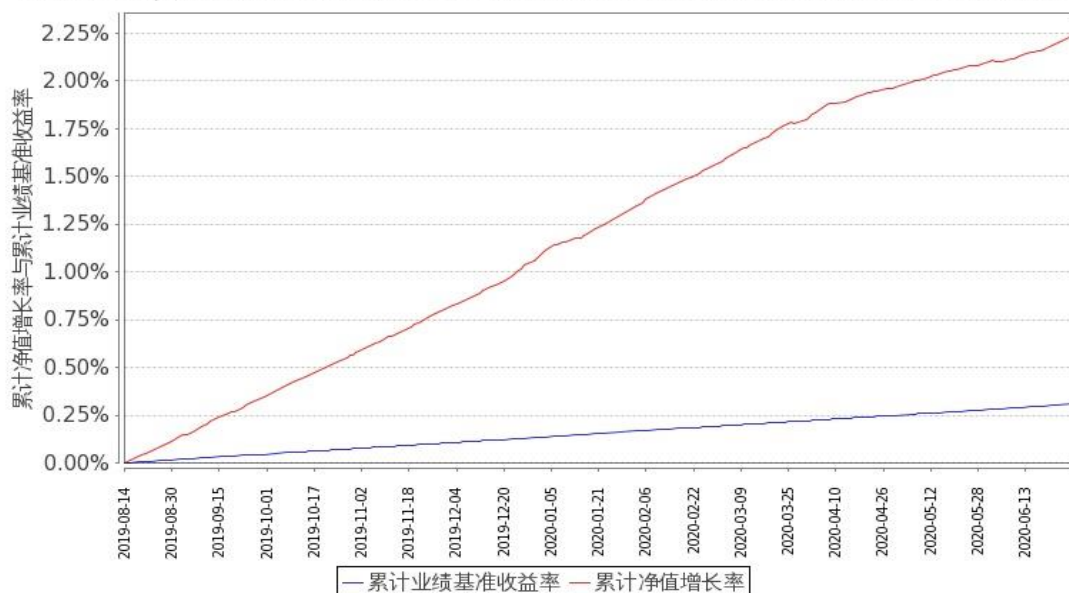
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	0.44%	0.01%	0.09%	0.00%	0.35%	0.01%
过去六个月	1.16%	0.01%	0.17%	0.00%	0.99%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.24%	0.01%	0.31%	0.00%	1.93%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

嘉实融享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：嘉实融享货币基金份额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
(2019年8月14日至2020年6月30日)

注：本基金基金合同生效日2019年8月14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6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金

合同（十三（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币基金经理	2019 年 8 月 21 日	-	12 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。

4.2 管理人对报告期内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、《嘉实融享浮动净值型发起式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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年二季度，受疫情影响叠加经济封锁措施，多国经济严重下滑，全球经济增长受阻。近期国际货币基金组织(IMF)发布了最新《世界经济展望》报告，报道预测今年全球经济将出现-4.9%的负增长。其中，发达经济体中，预测美国经济增长为-8%，欧洲经济增长为 10.2%，日本经济增长为-5.8%；新兴市场和发展中国家中，预测中国经济增长为 1%，印度经济增长为-4.5%，俄罗斯经济增长为-6.6%。

2020 年二季度，随着“疫情”多政策出台落地、“疫情”常态化和复工复产逐渐恢复，国内经济形势亦呈现修复向好趋势，部分月度指标有所上升或回落幅度收窄。2020 年二季度 PMI 全站 在荣枯线以上。2020 年 4 月至 5 月，我国规模以上工业增加值均值同比实际增长 4.15%，比上季 度高 14.58%；4 月至 5 月固定资产投资均值同比增速为-8.3%，比上季度高 5.23%；4 月至 5 月社 会消费品零售总额均值同比增速为-5.15%，比上季度高 6.95%；4 月至 5 月出口金额均值同比增 速为 0.05%，高于一季度的-7.9%。另外，4 月至 5 月社会融资规模同比增速均值为 12.25%，高于 上季度的 10.97%。

2020 年二季度在岸人民币汇率贬值 0.27%，离岸人民币汇率贬值 0.33%，4 月至 5 月央行外汇 资产下降 276 亿元。

进入二季度以来，随着经济逐渐修复、势头向好，央行应对“疫情”的总量性宽松政策转为 “直达”实体的精灌结构性宽松政策，政策宽松幅度和节奏上明显调整，资金中枢利率抬升并向 政策利率靠拢，市场流动性重归“合理充裕”，债市收益率整体低位快速回升。

在此期间，我们紧跟央行政策风向和操作节奏，合理应对缴税和节假日等时点因素和人民币 汇率阶段性波动，保证流动性安全的同时，把握时点性收益相对高点，积极调整组合，保持了基 金的流动性安全和收益平稳增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 102.2449 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.44%，业 绩比较基准收益率为 0.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	598,397,000.00	36.54
	其中：债券	561,397,000.00	34.28

	资产支持证券	37,000,000.00	2.26
2	买入返售金融资产	646,976,045.96	39.51
	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	381,122,395.74	23.28
4	其他资产	10,976,384.26	0.67
5	合计	1,637,471,825.96	100.00

5.2 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	6.54	
	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	-	-
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

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。

5.3.2 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	76.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) — 60 天	11.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) — 90 天	3.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天 (含) — 120 天	4.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天（含）—397 天（含）	3.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.36	-

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	79,767,000.00	4.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,066,000.00	6.11
6	中期票据	20,464,000.00	1.25
7	同业存单	361,100,000.00	22.06
8	其他	-	-
9	合计	561,397,000.00	34.29
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	111910274	19 兴业银行 CD274	1,500,000	145,485,000.00	8.89
2	111911113	19 平安银行 CD113	1,000,000	97,050,000.00	5.93
3	209920	20 贴现国债 20	500,000	49,845,000.00	3.04
4	012000551	20 邮政 SCP001	400,000	40,036,000.00	2.45
5	072000086	20 中泰证券 CP001	400,000	40,028,000.00	2.45
6	112097143	20 宁波银行 CD066	400,000	39,852,000.00	2.43
7	112010133	20 兴业银行 CD133	400,000	39,844,000.00	2.43
8	209917	20 贴现国债 17	300,000	29,922,000.00	1.83
9	101451007	14 滨建投 MTN001	200,000	20,464,000.00	1.25
10	012001088	20 越秀集团 SCP003	200,000	20,002,000.00	1.22

5.7 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	168002	4 如日 A03	300,000	30,000,000.00	1.83
2	168001	4 如日 A02	70,000	7,000,000.00	0.43

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

5.8.2 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。

5.8.3 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	10,976,384.26
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,976,384.26

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	14,048,351.69
报告期期间基金总申购份额	1,962,604.53
报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	16,010,956.22

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	100,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	100,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.62

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	100,000.00	0.62	100,000.00	0.62	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	100,000.00	0.62	100,000.00	0.62	3 年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2020/04/01 至 2020/06/30	13,948,351.69	1,962,604.53	-	15,910,956.22	99.38
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 4 月 8 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》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 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》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》；
- (3) 《嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金托管协议》；
- (4) 《嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金公告的各项原稿。

10.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

10.3 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

2020 年 7 月 18 日