嘉实快线货币市场基金
2021年第2季度报告

2021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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021年7月20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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 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。

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”。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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）（扩位场内简称：嘉实快线 ETF）	
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	
报告期末基金份额总额	72,025,486,143.52 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。 具体包括：现金流管理策略、组合久期投资策略、个券选择策略、息差策略以及其他金融工具投资策略	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 H

下属分级基金的交易代码	000917	511960
报告期末下属分级基金的份额总额	72,025,381,910.90 份	104,232.62 份

§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（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）	
	嘉实快线货币 A	嘉实快线货币 H
1.本期已实现收益	529,865,409.31	61,074.43
2.本期利润	529,865,409.31	61,074.43
3.期末基金资产净值	72,025,381,910.90	10,423,261.96

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

嘉实快线货币 A

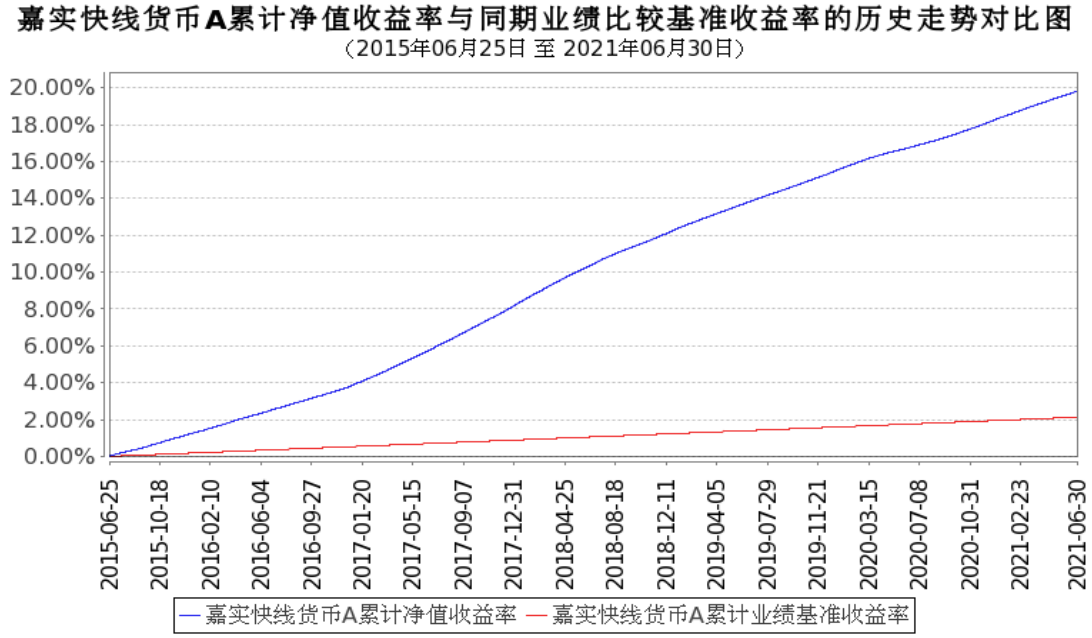
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.6107%	0.0004%	0.0871%	0.0000%	0.5236%	0.0004%
过去六个月	1.2677%	0.0005%	0.1734%	0.0000%	1.0943%	0.0005%
过去一年	2.5237%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	2.1737%	0.0008%
过去三年	8.4692%	0.0014%	1.0546%	0.0000%	7.4146%	0.0014%
过去五年	16.8621%	0.0023%	1.7633%	0.0000%	15.0988%	0.0023%
自基金合同生效起至今	19.8216%	0.0023%	2.1263%	0.0000%	17.6953%	0.0023%

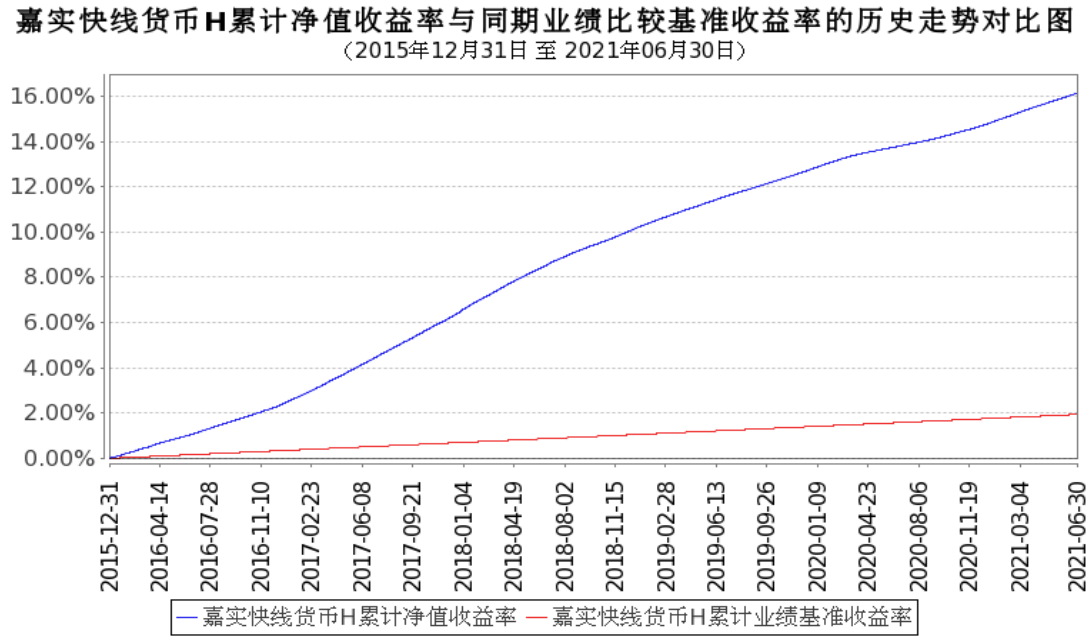
嘉实快线货币 H

阶段	净值收益率①	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	0.5504%	0.0004%	0.0871%	0.0000%	0.4633%	0.0004%
过去六个月	1.1472%	0.0005%	0.1734%	0.0000%	0.9738%	0.0005%
过去一年	2.0359%	0.0011%	0.3500%	0.0000%	1.6859%	0.0011%
过去三年	6.9526%	0.0016%	1.0546%	0.0000%	5.8980%	0.0016%
过去五年	14.8243%	0.0025%	1.7633%	0.0000%	13.0610%	0.0025%
自基金合同	16.1317%	0.0025%	1.9417%	0.0000%	14.1900%	0.0025%

生效起至今						

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





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 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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、嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实活期宝货币、嘉实薪金宝货币、嘉实 3 个月理财债券、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实融享货币基金经理	2015 年 7 月 14 日	-	13 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，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。

注：（1）首任基金经理的 “任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的 “任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 2 季度以来，出口保持强劲，国内经济持续恢复，央行货币政策维持中性，并继续向常态化回归，在结构性政策支持下，社融增速持续下降，而信贷质量维持向好，政策利率保持不变。7 天逆回购和 1 年 MLF 利率分别保持在 2.2%和 2.95%的水平。央行同时继续引导 1 年和 5 年 LPR 利率水平分别维持在 3.85%和 4.65%不变。在可自主决定发行和审核偏严情况下，4 月和 5 月地方专项债发行节奏较缓慢，流动性整体处于稍宽松水平。6 月专项债发行节奏有所加快，流动性边际走紧至适中水平。

2 季度以来，央行公开市场操作表现为净投放。2 季度央行公开市场操作净回笼资金 939 亿元。其中，逆回购到期 6200 亿元，逆回购投放 7200 亿元；MLF 到期 4561 亿元，MLF 投放 4500 亿元。

2 季度银行间市场隔夜和 7 天回购利率均值分别为 2.03%和 2.24%，较今年 1 季度均值 2.05%和 2.41%分别下行了 2bps 和下降了 17bps。2 季度债券市场收益率整体先下行再缓慢上行，2 季末 1 年期和 10 年期国开债收益率分别收于 2.43%和 3.08%，较今年 1 季度末 2.58%和 3.19%下行了 15bps 和 11bps。2 季度信用债市场收益率先下后上，随后季末迅速下行。1 年期 AAA 级短融收益率由 1 季度末的 3.02%下行至 2.86%，再上行至 6 月下旬的 3.03%，2 季末回落至 2.97%。1 年期 AAA 存单收益率由季初的 2.99%下行至最低 2.81%，再上行至 6 月下旬的 2.92%，2 季末回落至 2.81%。

2021 年 2 季度，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，2 季度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。

4.5 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 0.6107%；嘉实快线货币 H 的基金份额净值收益率为 0.5504%；业绩比较基准收益率为 0.0871%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	25,657,040,170.25	31.26

	其中：债券	24,711,040,170.25	30.10
	资产支持证券	946,000,000.00	1.15
2	买入返售金融资产	17,997,752,934.15	21.93
	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	36,293,834,204.96	44.22
4	其他资产	2,134,358,630.45	2.60
5	合计	82,082,985,939.81	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		1.68
	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	6,334,964,242.49	8.79
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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	43.93	12.87
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天（含）—60 天	12.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	11.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	33.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		110.98	12.87

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	59,720,482.98	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,957,029,468.58	5.49
	其中：政策性金融债	3,836,181,957.44	5.33
4	企业债券	50,491,510.81	0.07
5	企业短期融资券	3,725,783,016.57	5.17
6	中期票据	60,255,738.52	0.08
7	同业存单	16,857,759,952.79	23.40
8	其他	-	-
9	合计	24,711,040,170.25	34.30
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，附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。

5.6 报告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

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	210201	21 国开 01	12,400,000	1,240,001,801.78	1.72

2	190202	19 国开 02	9,900,000	993,156,047.87	1.38
3	112015357	20 民生银行 CD357	5,000,000	498,398,461.60	0.69
4	112115015	21 民生银行 CD015	4,800,000	476,171,444.91	0.66
5	112180802	21 广州农村商业银行 CD047	4,500,000	448,277,927.12	0.62
6	112121239	21 渤海银行 CD239	4,500,000	444,212,266.04	0.62
7	112199681	21 成都农商银行 CD094	4,000,000	398,808,924.07	0.55
8	112121091	21 渤海银行 CD091	4,000,000	397,918,588.77	0.55
9	112120167	21 广发银行 CD167	4,000,000	397,713,524.70	0.55
10	112182909	21 广州农村商业银行 CD069	4,000,000	394,763,011.25	0.55

5.7 “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	0.0269%
报告期内偏离度的最低值	0.0094%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0201%

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%。

5.8 报告期末按摊余成本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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	169822	致远 02A2	5,000,000	500,000,000.00	0.69
2	169177	3 欲晓 A02	1,200,000	120,000,000.00	0.17
3	189484	15 欲晓 A1	1,200,000	120,000,000.00	0.17
4	189650	长兴 03A1	980,000	98,000,000.00	0.14
5	189246	长兴 02A1	780,000	78,000,000.00	0.11
6	179987	致远 07A1	300,000	30,000,000.00	0.04

注：报告期末，本基金仅持有上述 6 支资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

5.9.2 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

（1）2021年1月8日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】67号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规事实，于2020年12月25日作出行政处罚决定，罚款4880万元。

2020年7月14日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2020〕43号），对中国民生银行股份有限公司违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资；为“四证”不全的房地产项目提供融资等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第四十六条第（一）、（五）项，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条规定和相关审慎经营规则，没收违法所得296.47万元，罚款10486.47万元，罚没合计10782.94万元。

2020年7月15日，中国银行保险监督管理委员会广东监管局发布行政处罚信息公开表（粤银保监罚决字【2020】27号），对广发银行股份有限公司贷款分类、从业人员处罚信息报送、信用卡“财智金”业务贷后管理严重违反审慎经营规则等违法违规事实，于2020年7月7日作出行政处罚决定，罚款220万元。2020年9月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】14号），对广发银行股份有限公司向关系人发放信用贷款等违法违规事实，于2020年6月29日作出行政处罚决定，没收违法所得511.53万元，罚款8771.53万元，罚没合计9283.06万元。

2021年5月21日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2021】13号），对渤海银行股份有限公司地方政府购买服务项目贷款不合规等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，于2021年5月17日作出行政处罚决定，罚款9720万元。

本基金投资于“19国开02（190202）”、“21国开01（210201）”、“20民生银行CD357（112015357）”、“21民生银行CD015（112115015）”、“21广发银行CD167（112120167）”、“21渤海银行CD091（112121091）”、“21渤海银行CD239（112121239）”的决策程序说明：基于对19国开02、21国开01、20民生银行CD357、21民生银行CD015、21广发银行CD167、21渤海银行CD091、

21 渤海银行 CD239 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“19 国开 02”、“21 国开 01”、“20 民生银行 CD357”、“21 民生银行 CD015”、“21 广发银行 CD167”、“21 渤海银行 CD091”、“21 渤海银行 CD239”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他三名证券发行主体无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。

5.9.3 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	307,714,034.04
4	应收申购款	1,826,564,596.41
5	其他应收款	80,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,134,358,630.45

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 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 H
报告期期初基金份额总额	79,319,522,150.41	111,795.40
报告期期间基金总申购份额	39,517,187,091.67	7,597.75
报告期期间基金总赎回份额	46,811,327,331.18	15,160.53
报告期期末基金份额总额	72,025,381,910.90	104,232.62

注：报告期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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	基金转换入	2021-04-09	500,000,000.00	500,000,000.00	-
2	申购	2021-04-09	400,000,000.00	400,000,000.00	-
3	红利再投资	2021-04-15	4,904,292.98	-	-

4	红利再投资	2021-04-15	18,001.74	-	-
5	赎回	2021-04-20	-220,000,000.00	-220,000,000.00	-
6	赎回	2021-04-22	-1,200,000,000.00	-1,200,000,000.00	-
7	申购	2021-04-30	880,000,000.00	880,000,000.00	-
8	申购	2021-05-12	300,000,000.00	300,000,000.00	-
9	红利再投资	2021-05-17	4,302,786.19	-	-
10	红利再投资	2021-05-17	18,163.42	-	-
11	赎回	2021-05-19	-130,000,000.00	-130,000,000.00	-
12	赎回	2021-05-21	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-
13	赎回	2021-05-25	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-
14	赎回	2021-05-31	-50,000,000.00	-50,000,000.00	-
15	赎回	2021-05-31	-80,000,000.00	-80,000,000.00	-
16	赎回	2021-06-02	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
17	申购	2021-06-04	300,000,000.00	300,000,000.00	-
18	红利再投资	2021-06-15	3,782,394.66	-	-
19	红利再投资	2021-06-15	16,098.45	-	-
20	申购	2021-06-21	100,000,000.00	100,000,000.00	-
21	赎回	2021-06-22	-700,000,000.00	-700,000,000.00	-
22	基金转换出	2021-06-29	-1,000,000,000.00	-1,000,000,000.00	-
23	基金转换出	2021-06-30	-400,000,000.00	-400,000,000.00	-
合计			-1,706,958,262.56	-1,720,000,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（1）中国证监会关于准予嘉实机构快线货币市场基金注册的批复文件；

（2）《嘉实快线货币市场基金基金合同》；

（3）《嘉实快线货币市场基金招募说明书》；

（4）《嘉实快线货币市场基金基金托管协议》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实快线货币市场基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2021 年 7 月 20 日