

嘉实现金添利货币市场基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

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

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实现金添利货币
基金主代码	004501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	137,097,303,836.10 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	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。 具体投资策略包括：资产配置策略、组合久期投资策略、银行存款投资策略、利用短期市场机会的灵活策略。
业绩比较基准	人民币活期存款税后利率
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	中国银行股份有限公司

§ 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	744,171,642.30
2. 本期利润	744,171,642.30
3. 期末基金资产净值	137,097,303,836.10

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

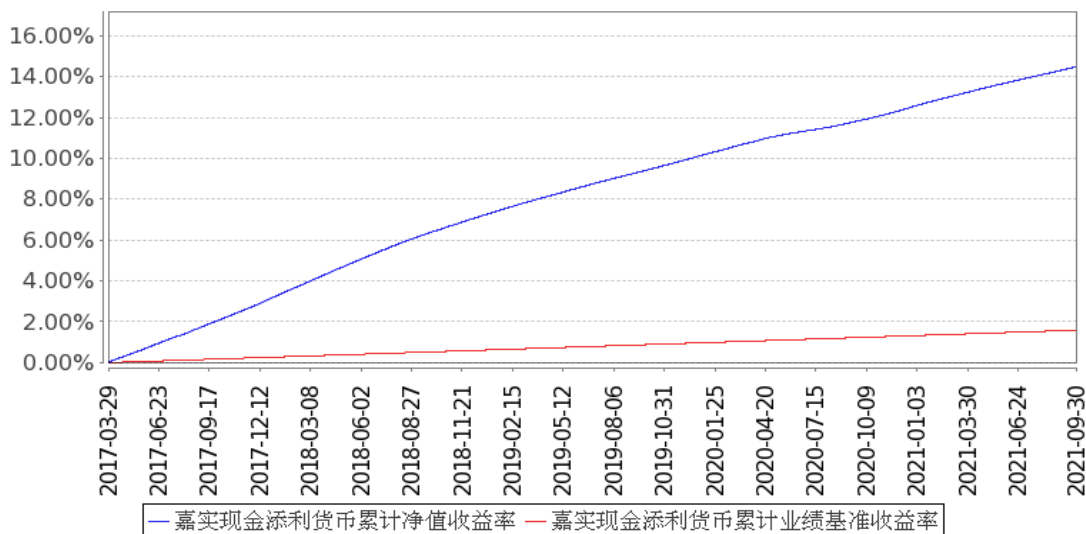
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.5310%	0.0006%	0.0881%	0.0000%	0.4429%	0.0006%
过去六个月	1.0865%	0.0005%	0.1753%	0.0000%	0.9112%	0.0005%
过去一年	2.3289%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.9789%	0.0009%
过去三年	7.5954%	0.0014%	1.0546%	0.0000%	6.5408%	0.0014%
自基金合同 生效起至今	14.4742%	0.0026%	1.5891%	0.0000%	12.8851%	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

嘉实现金添利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

(2017年03月29日至2021年09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		
李瞳	本基金、嘉实超短债债券、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实中短债债券、嘉实 60 天滚动持有短债、嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起基金经理	2017 年 4 月 13 日	-	12 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，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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、《嘉实现金添利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

三季度经济仍有韧性，但景气边际下行势头明显。对外贸易表现走弱，随着全球产业链不断恢复出口面临压力，半年以来的出口同比增速高位下行。地产行业政策持续高压态势，受行业融资环境全面收缩、核心城市集中供地、行业信用风险事件等因素影响，地产销售、土地购置、新开工各项数据增速回落。基础设施建设方面政策态度明显积极，要求今年底明年初形成实物工作量，不过当前整体仍然处于加码融资的蓄力状态。制造业也面临较大挑战，PMI 数据、工业增加值数据双双走弱，制造业投资增速在延续上半年强势之后触顶回落。在全球流动性宽松、供需错配、“碳中和”政策的背景下，三季度工业品价格坚挺，PPI 数据维持高位。但消费端乏力以及食品价格低位等因素使得 CPI 数据尚未呈现明显上行趋势，PPI 向 CPI 传导不畅、两者差值处于历史高位。

货币政策方面即肯定当前国内经济恢复增长，也关注到外部环境严峻、国内经济恢复不稳固和不均衡，坚持稳字当头、流动性合理充裕。基于税期、MLF 到期、地方债融资等方面考虑，中国人民银行在 7 月 15 日下调金融机构存款准备金率。在公开市场操作方面，维持了稳定的逆回购利率水平。货币政策亦坚持长期以来强调的结构性导向，重点关注区域间协调发展，加大力度支持科技创新、小微企业、绿色发展、制造业等领域。在当前货币政策态度下资金利率水平基本维

持稳定，波动中枢维持在公开市场操作利率水平附近。但我们也注意到地方债净融资规模处于历史高位以及非银杠杆明显提高，资金利率的波动区间下沿有所抬升。

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

本报告期基金份额净值收益率为 0.5310%，业绩比较基准收益率为 0.0881%。

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	61,474,269,551.99	40.32
	其中：债券	58,607,159,451.99	38.44
	资产支持证券	2,867,110,100.00	1.88
2	买入返售金融资产	8,151,101,260.00	5.35
	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	81,646,307,881.61	53.55
4	其他资产	1,187,997,374.48	0.78
5	合计	152,459,676,068.08	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	9.39	
	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	10,047,030,529.47	7.33
	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	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

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	37.49	11.15
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	25.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	25.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	110.34	11.15

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	1,572,884,946.56	1.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,800,578,692.70	6.42
	其中：政策性金融债	5,397,810,618.03	3.94

4	企业债券	20,057,590.63	0.01
5	企业短期融资券	3,160,958,108.80	2.31
6	中期票据	1,028,860,249.40	0.75
7	同业存单	44,023,819,863.90	32.11
8	其他	-	-
9	合计	58,607,159,451.99	42.75
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。

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	112011331	20 平安银行 CD331	35,400,000	3,540,046,923.85	2.58
2	112010546	20 兴业银行 CD546	30,000,000	3,000,000,000.00	2.19
2	112110102	21 兴业银行 CD102	30,000,000	3,000,000,000.00	2.19
4	112111024	21 平安银行 CD024	25,000,000	2,500,000,000.00	1.82
5	210201	21 国开 01	23,200,000	2,321,543,137.58	1.69
6	112010512	20 兴业银行 CD512	20,000,000	2,000,000,000.00	1.46
6	112010526	20 兴业银行 CD526	20,000,000	2,000,000,000.00	1.46
6	112111016	21 平安银行 CD016	20,000,000	2,000,000,000.00	1.46
6	112111123	21 平安银行 CD123	20,000,000	2,000,000,000.00	1.46
10	112110022	21 兴业银行 CD022	15,000,000	1,500,000,000.00	1.09
10	112111010	21 平安银行 CD010	15,000,000	1,500,000,000.00	1.09
10	112111126	21 平安银行 CD126	15,000,000	1,500,000,000.00	1.09
10	112111131	21 平安银行 CD131	15,000,000	1,500,000,000.00	1.09

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	0.0341%
报告期内偏离度的最低值	-0.0088%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0124%

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	179201	华元 02A2	2,000,000	177,060,000.00	0.13
2	189968	明远 02A1	1,600,000	160,000,000.00	0.12
3	169996	8 欲晓 A02	1,540,000	154,000,000.00	0.11
4	179245	欲晓 9A02	1,350,000	135,000,000.00	0.10
5	136052	万科 22 优	1,200,000	120,000,000.00	0.09
6	137518	20 合信 06	1,000,000	100,000,000.00	0.07
6	137737	链融 41A1	1,000,000	100,000,000.00	0.07
8	137303	鹏程 7A1	990,000	99,000,000.00	0.07
8	137677	惠和 01A	990,000	99,000,000.00	0.07
8	137682	惠和 02A	990,000	99,000,000.00	0.07
8	137691	21 合信 09	990,000	99,000,000.00	0.07
8	137709	诚意 5A1	990,000	99,000,000.00	0.07
8	137710	21 合信 10	990,000	99,000,000.00	0.07

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，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

2020 年 10 月 27 日，宁波银保监局发布行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字（2020）66 号），平安银行股份有限公司因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，于 2020 年 10 月 16 日被处以罚款人民币 100 万元。

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。

2021 年 8 月 20 日，中国人民银行银罚字（2021）26 号对兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日作出行政处罚决定，罚款合计 5 万元。

本基金投资于“20 平安银行 CD331（112011331）”、“21 平安银行 CD010（112111010）”、“21 平安银行 CD016（112111016）”、“21 平安银行 CD024（112111024）”、“21 平安银行 CD123（112111123）”、“21 平安银行 CD126（112111126）”、“21 平安银行 CD131（112111131）”、“21 国开 01（210201）”、“20 兴业银行 CD512（112010512）”、“20 兴业银行 CD526（112010526）”、“20 兴业银行 CD546（112010546）”、“21 兴业银行 CD022（112110022）”、“21 兴业银行 CD102（112110102）”的决策程序说明：基于对 20 平安银行 CD331、21 平安银行 CD010、21 平安银行 CD016、21 平安银行 CD024、21 平安银行 CD123、21 平安银行 CD126、21 平安银行 CD131、21 国开 01、20 兴业银行 CD512、20 兴业银行 CD526、20 兴业银行 CD546、21 兴业银行 CD022、21 兴业银行 CD102 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“20 平安银行 CD331”、“21 平安银行 CD010”、“21 平安银行 CD016”、“21 平安银行 CD024”、“21 平安银行 CD123”、“21 平安银行 CD126”、“21 平安银行 CD131”、“21 国开 01”、“20 兴业银行 CD512”、“20 兴业银行 CD526”、“20 兴业银行 CD546”、“21 兴业银行 CD022”、“21 兴业银行 CD102”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,443.65
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,187,990,930.83
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,187,997,374.48

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

报告期期初基金份额总额	139,556,432,646.17
报告期期间基金总申购份额	590,315,713,427.37
报告期期间基金总赎回份额	592,774,842,237.44
报告期期末基金份额总额	137,097,303,836.10

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

无。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实现金添利货币市场基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》；
- (3) 《嘉实现金添利货币市场基金托管协议》；
- (4) 《嘉实现金添利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) 报告期内嘉实现金添利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 10 月 26 日

