

# 嘉实现金添利货币市场基金 2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 24 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 2023 年 10 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 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	115,946,847,749.61 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	514,507,463.95
2. 本期利润	514,507,463.95
3. 期末基金资产净值	115,946,847,749.61

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

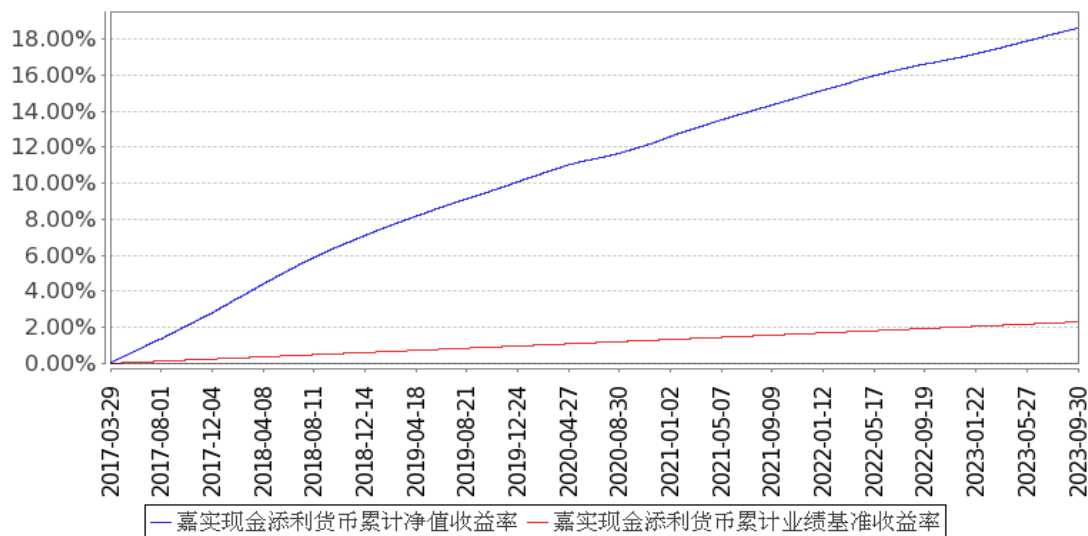
### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.4422%	0.0007%	0.0881%	0.0000%	0.3541%	0.0007%
过去六个月	0.8910%	0.0008%	0.1753%	0.0000%	0.7157%	0.0008%
过去一年	1.6735%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.3235%	0.0009%
过去三年	6.0217%	0.0013%	1.0537%	0.0000%	4.9680%	0.0013%
过去五年	11.4783%	0.0016%	1.7633%	0.0000%	9.7150%	0.0016%
自基金合同 生效起至今	18.6054%	0.0027%	2.3014%	0.0000%	16.3040%	0.0027%

### 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2023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、嘉实活钱包货币、嘉实 6 个月理财债券、嘉实 60 天滚动持有短债、嘉实短债债券、嘉实 90 天滚动持有短债、嘉实 30 天持有期中短债债券基金经理	2017 年 4 月 13 日	-	14 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，现任固收投研体系策略投资总监。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行业协会相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

国际方面，美国通胀水平居高不下，美债收益率迟迟未进入降息通道，9月下旬议息会议传达信号更为鹰派，市场预期美联储将更高的利率维持更长的时间，四季度仍然难以看到美国经济体进入降息周期。中美在经济、金融、贸易三个领域建立工作组，对话领域拓宽，合作的重要性阶段性提升，中长期博弈持续。

国内方面，经济磨底复苏的预期抬升。生产方面，1-8月份，全国规模以上工业增加值同比增长3.9%。内需方面，1-8月份社会消费品零售总额同比增长7.0%。投资方面，1-8月固定资产投资累计同比增长3.2%，其中基建投资累计同比增长8.96%，制造业投资5.9%，房地产开发投资-8.8%。出口同比下滑但幅度放缓，1-8月出口金额累计同比下降5.6%，降幅较前值缩窄0.5个百分点；进口同比下降7.6%。物价水平较为温和，7月和8月，CPI同比分别下跌0.3%和上涨0.1%，PPI同比分别下跌4.4%和3.0%。金融指标方面，社融规模保持稳健增长，7月和8月份同比分别增长8.9%和9.0%，贷款新增量分别为0.35万亿和1.36万亿，对实体融资需求形成有效支持。

债券市场方面，央行货币政策延续稳健基调，6月调降MLF利率10bp之后，8月再次调降15bp至2.50，稳定银行净息差为继续让利实体腾挪空间。美联储加息叠加国内政策利率调整，对汇率

形成一定压制，银行间资金面和情绪面受到一定的扰动。一二线房地产政策陆续放松，一线城市“认房不认贷”政策贯彻后对债市形成冲击，同时 8 月份经济数据显示进一步企稳筑底的迹象，债券市场出现调整。整体来看，1 年期 AAA 存单收益率从 6 月 30 日的 2.42% 上行至 9 月 28 日的 2.44%；10 年期国债收益率从 6 月 30 日的 2.84% 下行至 9 月 28 日的 2.68%。短端上行长端下行，收益率曲线持续平坦化。

报告期间，我们充分分析国内外经济形势变化，紧跟政策风向，合理应对市场波动，在保证流动性安全的同时，把握时点性收益率相对高点，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 0.4422%，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	34,797,891,272.71	28.48
	其中：债券	34,797,891,272.71	28.48
	资产支持证券	-	-
	券	-	-
2	买入返售金融资产	7,628,067,422.09	6.24
	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	79,740,896,924.87	65.27
4	其他资产	18,238.76	0.00
5	合计	122,166,873,858.43	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	7.81	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	6,164,831,853.08	5.32
	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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

### 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	21.77	5.31
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	22.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	26.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	14.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	20.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.06	5.31

### 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	4,069,561,123.52	3.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,141,521,702.84	1.85
	其中：政策性金融债	1,885,358,738.69	1.63

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,766,654,293.17	4.11
6	中期票据	102,481,768.15	0.09
7	同业存单	23,717,672,385.03	20.46
8	其他	-	-
9	合计	34,797,891,272.71	30.01
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	112310268	23 兴业银行 CD268	24,000,000	2,391,915,416.83	2.06
2	112310270	23 兴业银行 CD270	24,000,000	2,391,295,942.21	2.06
3	112311112	23 平安银行 CD112	12,000,000	1,198,849,849.23	1.03
4	112303087	23 农业银行 CD087	8,390,000	831,639,940.80	0.72
5	220216	22 国开 16	7,900,000	802,067,647.80	0.69
6	239946	23 贴现国债 46	7,400,000	738,947,823.15	0.64
7	112308123	23 中信银行 CD123	6,500,000	643,792,195.12	0.56
8	239950	23 贴现国债 50	6,200,000	618,598,410.95	0.53
9	042280448	22 中石油 CP003	6,100,000	618,518,712.05	0.53
10	220023	22 付息国债 23	6,060,000	615,408,832.40	0.53

### 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	0.0459%
报告期内偏离度的最低值	-0.0123%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0264%

#### 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



无。

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，平安银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	18,238.76
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	18,238.76

### 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	118,033,800,151.53
报告期期间基金总申购份额	545,063,953,428.32
报告期期间基金总赎回份额	547,150,905,830.24
报告期期末基金份额总额	115,946,847,749.61

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  
2023 年 10 月 24 日