

# 嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金 2024 年中期报告

2024 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

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由代董事长签发。

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 2024 年 08 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	35
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....	36
7.7 期末按公允价值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 .....	37
7.8 投资组合报告附注 .....	37
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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 .....	38
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	38
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	40
10.9 其他重大事件 .....	40
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>40</b>
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 .....	40
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>40</b>
12.1 备查文件目录 .....	40
12.2 存放地点 .....	41
12.3 查阅方式 .....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金
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
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
报告期末基金份额总额	112,134,457.44 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。 具体投资策略包括：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、资产支持证券投资策略、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。

### 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	江苏银行股份有限公司
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	95319
传真	(010)65215588	025-58588155
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	南京市中华路 26 号
办公地址	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	南京市中华路 26 号
邮政编码	100020	210001
法定代表人	经雷	葛仁余

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
----------------	---------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	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

## § 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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	137,883,574.05
本期利润	135,674,974.05
加权平均基金份额本期利润	1.1777
本期加权平均净值利润率	1.06%
本期基金份额净值增长率	1.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,348,451,913.47
期末可供分配基金份额利润	12.0253
期末基金资产净值	12,562,197,284.14
期末基金份额净值	112.0280
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.03%

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。

(2) 本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

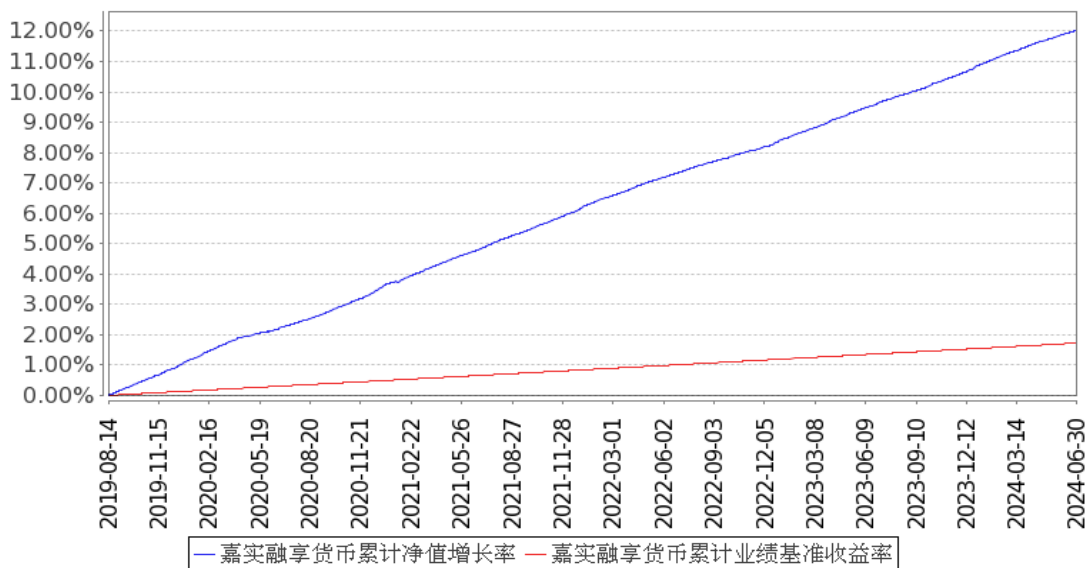
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.16%	0.00%	0.03%	0.00%	0.13%	0.00%
过去三个月	0.49%	0.01%	0.09%	0.00%	0.40%	0.01%
过去六个月	1.05%	0.01%	0.17%	0.00%	0.88%	0.01%

过去一年	2.20%	0.01%	0.35%	0.00%	1.85%	0.01%
过去三年	6.87%	0.01%	1.05%	0.00%	5.82%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.03%	0.01%	1.72%	0.00%	10.31%	0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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  
(2019年08月14日至2024年06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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国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，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2024年6月30日，基金管理人共管理351只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 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		
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、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币基金经理	2019年8月21日	-	16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。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 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 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

2024 年上半年，外部环境复杂严峻，世界经济增长动能偏弱，通胀高位回落但仍具粘性，主要经济体经济增长和货币政策有所分化。我国经济运行延续回升向好态势，但仍面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战。从供给端看，工业和服务业生产边际走弱；从需求端看，制造业和基建投资增速下行，房地产投资持续为负、对固定资产投资形成拖累，社零等消费数据承压；从通胀看，CPI 同比维持 0.2%-0.3%，PPI 同比为负但负值收窄，价格水平低位运行；从经济数据看，上半年 GDP 同比增长 5.0%但呈现前快后慢态势：一季度同比增长 5.3%；二季度同比增长 4.7%，主要经济指标边际走弱，经济修复承压。

今年上半年，人民币外汇市场平稳运行，在美元指数震荡走强的背景下，人民币对美元汇率呈现温和贬值行情，整体较一篮子货币汇率稳中有升，在全球主要货币中保持较强竞争力。

今年上半年，人民银行坚持稳健的货币政策灵活适度、精准有效，强化逆周期调节，货币政策操作上呈现“总量+结构”双发力格局，综合运用利率、准备金、再贷款等工具，维持流动性合理充裕，支持实体经济，防控金融风险。具体看，2 月央行降准 0.5 个百分点释放万亿资金，下调支农再贷款、支小再贷款和再贴现利率各 0.25 个百分点，为实体经济增长营造良好的货币金融环境。同月，央行引导 5 年期 LPR 利率下调 25BP 至 3.95%，25BP 是历史单次最大降幅，释放积极的“稳增长”政策信号，促进实体部门融资成本下行。

今年上半年短端资产走势：一季度收益率先 1 月平盘震荡、2 月下行、3 月再度震荡的走势，行情关键点是央行降准和下调 LPR 引发的宽松预期、国债和地方政府债发行偏慢及信贷投放平滑背景下的“资产荒”逻辑、以及基本面持续向好叠加稳汇率压力限制利率下行等多重因素。1 月央行宣布降准释放万亿资金，1 年 AAA 同业存单利率从 2.45%下行 5BP 至 2.40%；2 月权益市场调整、降准落地叠加 LPR 大幅调降 25BP，1 年 AAA 同业存单利率下行 18BP 至 2.22%；3 月债市逻辑有所变化，货币政策宽松预期修正，1 年 AAA 同业存单利率在 2.25%中枢震荡。二季度收益率呈现 4 月先下后上 V 型反转、5 月震荡、6 月再度向下突破的走势。4 月上旬，1 年 AAA 同业存单利率从 2.24%下行 24BP 至 2.00%；下旬，1 年 AAA 同业存单利率从 2.00%大幅上行 25BP 至 2.25%、随后在央行 OMO 大量投放下回落至 2.10%。5 月全月围绕 2.10%震荡。进入 6 月，流动性宽松叠加机构配置需求再起，多头情绪反弹，1 年 AAA 同业存单利率从 2.08%向下突破 2.0%关键点位、最低下行 13BP 至 1.95%。以中债估值 AAA 同业存单到期收益率为例，3 个月、6 个月、9 个月、1 年期

限存单从 1 月初的 2.30%、2.41%、2.43%和 2.44%分别下行 51BP、54BP、48BP 和 48BP 至 6 月末的 1.79%、1.87%、1.95%和 1.96%。

2024 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，2024 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

截至本报告期末本基金份额净值为 112.0280 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.05%，业绩比较基准收益率为 0.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，国内经济仍将延续回升向好态势，但下半年经济修复面临诸多不确定性，关键是房地产和财政：一是房地产，稳地产政策持续发力，地产能否企稳及企稳程度；二是财政发力和基建投资，地方债和超长期特别国债发行进度加快，能否形成实物工作量；三是出口，贸易摩擦和地缘政治风险加剧，尤其是美国大选不确定性，是否会对出口造成不利影响；四是市场主体和预期，宏观政策和改革措施能否有效提振居民及企业部门信心和改善收入预期。

下半年国内货币政策在需求不足和经济弱复苏的宏观背景下，政策基调仍将维持宽松。央行货币政策仍需统筹多元目标，内外部平衡及金融稳定是下半年的重点，银行净息差和人民币汇率是制约降息落地时点的主要因素。7 月在美元因通胀回落走弱的窗口期和国内降成本稳息差诉求的共同约束下，人民银行调降 7 天 OMO 利率 10BP 至 1.70%，并引导 1 年期和 5 年期 LPR 利率调降 10BP 至 3.35%和 3.85%，后续大概率还会伴随新一轮的存款利率下调。此外，上半年地方政府债发行进度慢于往年，三季度或是地方政府债发行高峰，采取降准来对冲流动性波动的必要性上升。

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

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 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

本基金自生效之日起已运作满三年，报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；存在连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形，时间范围为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现嘉实基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,583,559,499.89	4,929,074,679.11
结算备付金		19,520,975.50	45,004,575.29
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,265,943,296.59	4,190,495,007.89
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,265,943,296.59	4,190,495,007.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,742,858,759.29	3,928,630,706.85
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		13,611,882,531.27	13,093,204,969.14
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,047,269,401.38	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,492,048.37	1,550,329.86
应付托管费		497,349.47	516,776.65
应付销售服务费		99,469.91	103,355.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	326,978.00	427,721.77
负债合计		1,049,685,247.13	2,598,183.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	11,213,453,772.57	11,808,186,334.93
未分配利润	6.4.7.12	1,348,743,511.57	1,282,420,450.57
净资产合计		12,562,197,284.14	13,090,606,785.50
负债和净资产总计		13,611,882,531.27	13,093,204,969.14

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 112.0280 元，基金份额总额 112,134,457.44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		152,353,044.97	97,369,382.99
1. 利息收入		110,504,063.10	66,337,364.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	66,138,136.40	31,913,685.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		44,365,926.70	34,423,679.52
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,057,581.87	30,451,159.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	44,057,581.87	30,451,159.36
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,208,600.00	580,859.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		16,678,070.92	10,108,409.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,602,728.04	5,756,717.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,200,909.34	1,918,905.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	640,181.91	383,781.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,093,022.97	1,921,963.11
其中：卖出回购金融资产支出		3,093,022.97	1,921,963.11
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	337.86
8. 其他费用	6.4.7.23	141,228.66	126,704.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		135,674,974.05	87,260,973.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		135,674,974.05	87,260,973.17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		135,674,974.05	87,260,973.17

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,808,186,334.93	-	1,282,420,450.57	13,090,606,785.50
二、本期期初净资产	11,808,186,334.93	-	1,282,420,450.57	13,090,606,785.50
三、本期增减变动额（减少以“-”	-594,732,562.3	-	66,323,061.00	-528,409,501.36

号填列)	6			
(一)、综合收益总额	-	-	135,674,974.05	135,674,974.05
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-594,732,562.36	-	-69,351,913.05	-664,084,475.41
其中：1. 基金申购款	2,065,269,300.47	-	234,571,024.12	2,299,840,324.59
2. 基金赎回款	-2,660,001,862.83	-	-303,922,937.17	-2,963,924,800.00
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	11,213,453,772.57	-	1,348,743,511.57	12,562,197,284.14
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,004,196,958.66	-	503,949,141.58	6,508,146,100.24
二、本期期初净资产	6,004,196,958.66	-	503,949,141.58	6,508,146,100.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,091,220,658.11	-	370,380,485.06	3,461,601,143.17
(一)、综合收益总额	-	-	87,260,973.17	87,260,973.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	3,091,220,658.11	-	283,119,511.89	3,374,340,170.00
其中：1. 基金申购款	3,851,221,400.	-	348,778,599.86	4,200,000,000.0

	14			0
2. 基金赎回款	-760,000,742.0 3	-	-65,659,087.97	-825,659,830.00
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	9,095,417,616. 77	-	874,329,626.64	9,969,747,243.4 1

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

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1228号《关于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》注册,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》于2019年8月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实融享浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收

入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,501,833,133.46
等于：本金	1,501,028,699.77
加：应计利息	804,433.69
减：坏账准备	-
定期存款	3,081,726,366.43
等于：本金	3,070,000,000.00
加：应计利息	11,726,366.43
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	500,153,749.99
存款期限 1-3 个月	900,409,277.80
存款期限 3 个月以上	1,681,163,338.64
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,583,559,499.89

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,234,202,110.00	30,017,296.59	4,265,943,296.59	1,723,890.00
	合计	4,234,202,110.00	30,017,296.59	4,265,943,296.59	1,723,890.00
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	4,234,202,110.00	30,017,296.59	4,265,943,296.59	1,723,890.00	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,742,858,759.29	-
合计	4,742,858,759.29	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	204,650.34
其中：交易所市场	-
银行间市场	204,650.34
应付利息	-
预提费用	122,327.66
合计	326,978.00

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,081,776.12	11,808,186,334.93
本期申购	20,652,681.32	2,065,269,300.47
本期赎回（以“-”号填列）	-26,600,000.00	-2,660,001,862.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	112,134,457.44	11,213,453,772.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,279,834,957.84	2,585,492.73	1,282,420,450.57
本期期初	1,279,834,957.84	2,585,492.73	1,282,420,450.57
本期利润	137,883,574.05	-2,208,600.00	135,674,974.05
本期基金份额交易产生的变动数	-69,266,618.42	-85,294.63	-69,351,913.05
其中：基金申购款	234,623,222.23	-52,198.11	234,571,024.12
基金赎回款	-303,889,840.65	-33,096.52	-303,922,937.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,348,451,913.47	291,598.10	1,348,743,511.57

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	23,349,448.84
定期存款利息收入	42,534,653.59
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	254,033.97
其他	-
合计	66,138,136.40

#### 6.4.7.14 股票投资收益

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	44,482,211.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-424,630.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	44,057,581.87

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	13,692,677,106.82

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,549,149,410.00
减：应计利息总额	143,860,426.82
减：交易费用	91,900.00
买卖债券差价收入	-424,630.00

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,208,600.00
股票投资	-
债券投资	-2,208,600.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,208,600.00

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	62,655.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	205.00
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	696.00
合计	141,228.66

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 8 月 29 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 38.0000 元。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人

#### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,602,728.04	5,756,717.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	9,602,728.04	5,756,717.73

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 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×0.15%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,200,909.34	1,918,905.92

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	嘉实融享货币	
嘉实基金管理有限公司	640,181.91	
合计	640,181.91	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	嘉实融享货币	
嘉实基金管理有限公司	383,781.14	
合计	383,781.14	

注：本基金的销售服务费年费率为0.01%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。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。

#### 6.4.10.3 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

本期						
2024年1月1日至2024年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2023年1月1日至2023年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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

江苏银行股份有限公司	49,416,543.37	-	-	-	-	-
------------	---------------	---	---	---	---	---

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
报告期初持有的基金份额	-	100,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	100,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2024年6月30日		2023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 (%)
江苏银行	112,134,457.44	100.00	118,081,776.12	100.00

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
江苏银行股份有限公司_活期	1,028,966.76	88,614.37	516,908,548.81	5,644,870.70

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 8 月 29 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 38.0000 元。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,047,269,401.38 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112303179	23 农业银行 CD179	2024 年 7 月 1 日	99.79	1,056,000	105,377,782.40
112317188	23 光大银行 CD188	2024 年 7 月 1 日	99.78	1,000,000	99,775,118.03
112317287	23 光大银行 CD287	2024 年 7 月 1 日	99.76	1,000,000	99,757,343.07
112317292	23 光大银行 CD292	2024 年 7 月 1 日	99.75	611,000	60,946,914.17
112318198	23 华夏银行 CD198	2024 年 7 月 1 日	99.78	1,000,000	99,775,118.03
112403045	24 农业银行 CD045	2024 年 7 月 1 日	99.13	1,000,000	99,128,898.91
112404031	24 中国银行 CD031	2024 年 7 月 1 日	98.63	1,000,000	98,631,219.05
112405139	24 建设银行 CD139	2024 年 7 月 1 日	99.77	75,000	7,482,716.25
112408112	24 中信银行 CD112	2024 年 7 月 1 日	98.62	1,000,000	98,616,352.88
112408122	24 中信银行 CD122	2024 年 7 月 1 日	98.58	1,000,000	98,575,231.51
112409100	24 浦发银行 CD100	2024 年 7 月 1 日	98.63	983,000	96,948,541.44
112409103	24 浦发银行 CD103	2024 年 7 月 1 日	98.62	333,000	32,839,666.46

112412060	24 北京银行 CD060	2024 年 7 月 1 日	99.78	1,258,000	125,527,217.74
合计				11,316,000	1,123,382,119.94

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	4,265,943,296.59	4,190,495,007.89
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	4,265,943,296.59	4,190,495,007.89

注：评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)以及根据份额持有人集中度情况调整投资组合的方式来实现。

本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与

债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计

资产					
货币资金	4,152,208,436.10	431,351,063.79	-	-	4,583,559,499.89
结算备付金	19,520,975.50	-	-	-	19,520,975.50
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	3,279,358,956.39	986,584,340.20	-	-	4,265,943,296.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,742,858,759.29	-	-	-	4,742,858,759.29
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,193,947,127.28	1,417,935,403.99	-	-	13,611,882,531.27
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,047,269,401.38	-	-	-	1,047,269,401.38
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,492,048.37	1,492,048.37
应付托管费	-	-	-	497,349.47	497,349.47
应付销售服务费	-	-	-	99,469.91	99,469.91
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	326,978.00	326,978.00
负债总计	1,047,269,401.38	-	-	2,415,845.75	1,049,685,247.13
利率敏感度缺口	11,146,677,725.90	1,417,935,403.99	-	-2,415,845.75	12,562,197,284.14
上年度末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	4,595,511,109.78	333,563,569.33	-	-	4,929,074,679.11
结算备付金	45,004,575.29	-	-	-	45,004,575.29

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	4,072,267,642.65	118,227,365.24	-	-	4,190,495,007.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,928,630,706.85	-	-	-	3,928,630,706.85
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,641,414,034.57	451,790,934.57	-	-	13,093,204,969.14
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,550,329.86	1,550,329.86
应付托管费	-	-	-	516,776.65	516,776.65
应付销售服务费	-	-	-	103,355.36	103,355.36
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	427,721.77	427,721.77
负债总计	-	-	-	2,598,183.64	2,598,183.64
利率敏感度缺口	12,641,414,034.57	451,790,934.57	-	-2,598,183.64	13,090,606,785.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）



	市场利率上升 25 个基点	-3, 222, 545. 94	-2, 276, 572. 18
	市场利率下降 25 个基点	3, 230, 163. 76	2, 279, 769. 35

#### 6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

无。

##### 6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	-	-
业绩比较基准下降 5%	-	-	

#### 6. 4. 14 公允价值

##### 6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	4,265,943,296.59	4,190,495,007.89
第三层次	-	-
合计	4,265,943,296.59	4,190,495,007.89

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	4,265,943,296.59	31.34
	其中：债券	4,265,943,296.59	31.34
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	4,742,858,759.29	34.84
	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	4,603,080,475.39	33.82
4	其他各项资产	-	-
5	合计	13,611,882,531.27	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	2.52	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,047,269,401.38	8.34
	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%。

## 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	56
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	21

### 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。

### 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	58.27	8.33
	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	18.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
5	120 天（含）—397 天（含）	14.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	108.00	8.33

#### 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,265,943,296.59	33.96
8	其他	-	-
9	合计	4,265,943,296.59	33.96
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 7.6 期末按公允价值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：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112303179	23 农业银行 CD179	3,000,000	299,368,700.00	2.38
2	112493002	24 徽商银行 CD016	2,500,000	249,335,693.68	1.98
3	112412060	24 北京银行 CD060	2,000,000	199,566,323.91	1.59
4	112492724	24 宁波银行 CD005	2,000,000	199,493,891.21	1.59
5	112492425	24 杭州银行 CD019	1,000,000	99,803,728.57	0.79

6	112317188	23 光大银行 CD188	1,000,000	99,775,118.03	0.79
6	112318198	23 华夏银行 CD198	1,000,000	99,775,118.03	0.79
7	112405139	24 建设银行 CD139	1,000,000	99,769,550.00	0.79
8	112498719	24 重庆农村 商行 CD051	1,000,000	99,764,550.00	0.79
9	112317287	23 光大银行 CD287	1,000,000	99,757,343.07	0.79
10	112317292	23 光大银行 CD292	1,000,000	99,749,450.36	0.79

**7.7 期末按公允价值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。

## 7.8 投资组合报告附注

### 7.8.1 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。

### 7.8.2 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，中国光大银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、北京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。

### 7.8.3 期末其他各项资产构成

无。

### 7.8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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 (%)
1	112,134,457.44	112,134,457.44	100.00	-	-

### 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	银行类机构	112,134,457.44	100.00

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 8 月 14 日) 基金份额总额	210,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	118,081,776.12
本报告期基金总申购份额	20,652,681.32
减：本报告期基金总赎回份额	26,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	112,134,457.44

## § 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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 (%)	
长江证券股份有限公司	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；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

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 (%)
长江证券股份有限公司	-	-	20,001,481,000.00	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%。

### 10.9 其他重大事件

无。

## § 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	2024-01-01 至 2024-06-30	118,081,776.12	20,652,681.32	26,600,000.00	112,134,457.44	100.00

**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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 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

## 12.3 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

2024 年 8 月 30 日