

嘉实现金添利货币市场基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2022 年 03 月 24 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	13
4.10 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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20

§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 债券回购融资情况.....	46
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	47
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
8.6 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	48
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	49
8.8 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	49
8.9 投资组合报告附注.....	50
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
9.4 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	51
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议.....	52
11.2 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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	61
11.9 其他重大事件.....	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实现金添利货币市场基金
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
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
报告期末基金份额总额	123,526,327,527.69 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	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。

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	中国银行股份有限公司
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	95566
传真	(010)65215588	(010)66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100005	100818
法定代表人	经雷	刘连舸

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现 收益	2,996,560,744.43	2,388,069,788.40	2,271,703,266.00
本期利润	2,996,560,744.43	2,388,069,788.40	2,271,703,266.00
本期净值收 益率	2.2338%	2.2170%	2.6856%
3.1.2 期末 数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末基金资 产净值	123,526,327,527.69	123,549,672,010.25	96,065,866,818.96
期末基金份 额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
累计净值收 益率	15.0805%	12.5660%	10.1245%

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

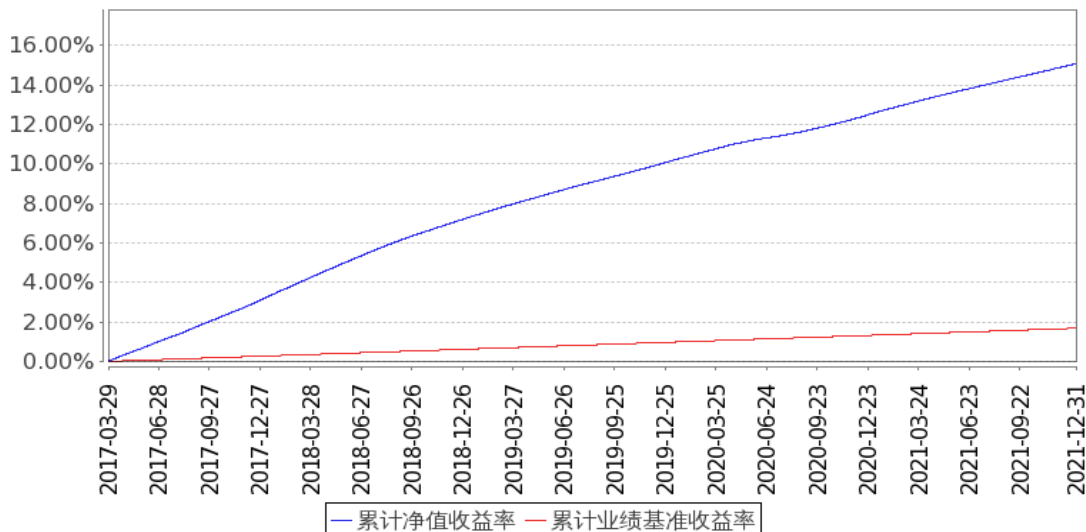
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 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	0.5296%	0.0010%	0.0881%	0.0000%	0.4415%	0.0010%
过去六个月	1.0634%	0.0008%	0.1763%	0.0000%	0.8871%	0.0008%
过去一年	2.2338%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.8838%	0.0008%
过去三年	7.3069%	0.0013%	1.0546%	0.0000%	6.2523%	0.0013%
自基金合同生效起 至今	15.0805%	0.0026%	1.6786%	0.0000%	13.4019%	0.0026%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

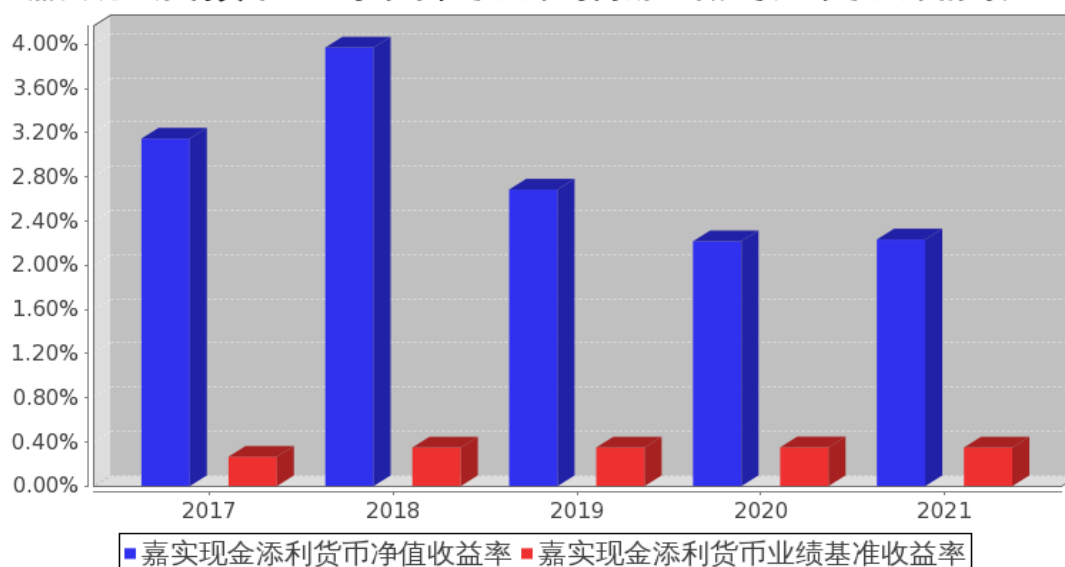
(2017年03月29日至2021年12月31日)



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实现金添利货币基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2021 年	2,996,560,744. 43	-	-	2,996,560,744. 43	-
2020 年	2,388,069,788. 40	-	-	2,388,069,788. 40	-
2019 年	2,271,703,266. 00	-	-	2,271,703,266. 00	-
合计	7,656,333,798. 83	-	-	7,656,333,798. 83	-

§ 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 2021 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 258 只开放式证券投资基金，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 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		
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《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》

见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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

回顾 2021 年，国际经济方面，上半年总体保持复苏态势，但分化加剧。欧美经济复苏势头较好，美国、欧元区二季度 GDP 环比折年率分别达到 6.7%、9.1%，部分新兴经济体受疫情影响大，复苏缓慢。三季度之后，受疫情反复、供应链摩擦加剧、通胀持续攀升等因素影响，全球经济复苏出现波折。美国三季度 GDP 环比折年率降至 2.3%，四季度反弹至 6.9%；欧元区四季度 GDP 环比折年率降至 1.2%；日本三季度 GDP 环比折年率为-3.6%处于收缩区间。受高通胀影响，21 年全球多个国家已开始加息，年内巴西加息 7 次、俄罗斯加息 7 次、韩国加息 2 次等，美联储、欧央行

也做出了政策调整。境外经济体货币政策调整对我国的外溢作用仍需关注，但影响整体有限。

国内经济方面，整体呈现前高后低的态势。21 年宏观经济开局良好，社会消费品零售总额同比增长 33.9%；固定资产投资同比增长 25.6%；出口强劲，贸易顺差同比增 7 倍多；季末社融增速保持在 12.3% 的较高水平。从 4 月开始，经济动能出现弱化，制造业 PMI 自 4 月开始向下运行并于 9 月跌破荣枯线录得 49.6。消费方面，扣除价格因素社会消费品零售总额实际增长一路下滑，8 月下行加速，当月实际增速仅 0.9%，全年实际增长仅 10.7%；固定资产投资中基础设施建设增速疲弱，全年增长仅 0.4%；受政策收紧、恒大事影响，下半年房地产市场加速下滑，房地产开发投资累计增速从 6 月末的 15% 下降至 12 月末的 4.4%，商品房销售面积累计增速从 3 月末的 27.7% 下降至 12 月末的 1.9%；出口保持强劲，贸易顺差全年增长 29%，但可持续性依赖于全球供应链修复进度及疫情防控形势，不确定性较大；4 月起，PPI 开始加速上升，对中下游企业利润形成挤压，煤价 7-10 月飙升，部分区域拉闸限电限制了工业生产；信用扩张受阻，根据央行银行家调查问卷，贷款总体需求指数从 21 年一季度的 77.5% 下滑到四季度的 67.7%，社融增速从 2 月末 13.3% 的高点下降至 12 月末的 10.3%，信用存在收缩压力。

债券市场方面，收益率整体先上后下。21 年 1 月央行退出永煤事件维稳，收紧流动性，叠加 1 月末财政投放滞后，银行间资金价格大幅攀升，1 月 29 日 R001 涨至 6.59%，该轮收紧带动债券市场收益率上行，于 2 月中旬上行至年内高点，10 年国债触及 3.28%，1 年 AAA 存单触及 3.12%，之后进入短时窄幅震荡。货币政策年内逐渐放松，21 年三季度货币政策报告中删除“管好货币总闸门”描述，央行于 7 月、12 月两次全面降准 0.5%，并在 12 月降准后下调主要政策利率，其中 1 年 LPR（贷款基础利率，下同）下调两次合计 15bps，5 年 LPR 下调 5bps，1 年 MLF（中期借贷便利）利率下调 10bps，7 天公开市场逆回购操作利率下调 10bps。财政方面则因专项债发行、项目管理趋严等因素，出现了政府债发行、财政支出同时放缓的现象，一至三季度期间，政府债净融资 4.29 万亿，占全年净融资额 6.82 万亿的 63%，远低于 20 年同期的 81%；政府性基金支出合计 7.14 万亿，同比减少 8.8%，低于预算制定的增 11.2% 的目标，伴随经济下行压力加大，四季度发债及支出开始提速。债券市场在经济下行压力加大、货币政策逐步放松、政府债供给放缓、银行资产欠配负债压力减小等多因素的共同推动下，从 3 月中旬开始下行，10 年国债从高点 3.28% 下行 51bps 至年末的 2.77%；1 年 AAA 存单从 2 月中旬高点的 3.12% 下行 52bps 至年末的 2.6%。

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。

4.4.2 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 2.2338%，业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际经济方面，奥密克戎变异毒株的扩散扰动经济增长，国际货币基金组织在 1 月最新预测中将 22 年全球经济增速下调了 0.5 个百分点至 4.4%。受高通胀困扰，预计主要经济体或加速退出宽松货币政策：美国失业率走低，但通胀持续走高，22 年 1 月 CPI 录得 7.5%，美联储最新声明将于 22 年 3 月结束资产购买计划，并将很快加息，同时发布了缩表指引为加息后的缩表做准备；欧元区面临类似问题，22 年 1 月 HCPI 录得 5.1%，欧央行将于 22 年 3 月停止紧急购债计划(PEPP)，但将短暂增加资产购买计划 (APP)；英国自 21 年 12 月以来已加息 2 次；日本通胀不高，仍实施宽松的货币政策。全球货币环境整体收紧可能对新兴市场产生溢出效应，抬升实际利率水平，阻碍经济复苏，扰动金融市场。

国内经济方面，21 年 12 月中央经济会议明确，我国经济面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，会议要求各地区各部门要担负起稳定宏观经济的责任，各方面要积极推出有利于经济稳定的政策，政策发力适当靠前。中央财经委员会办公室副主任韩文秀解读会议时表示，各方要积极推出有利于经济稳定的政策，慎重出台有收缩效应的政策。22 年党的二十大即将召开，经济、社会大局稳定需求迫切。

展望未来，货币政策方面，将保持充足发力，未来流动性仍将保持合理充裕，但考虑到政策效果显现需要窗口观察期，且全球主要经济体货币政策边际收紧，未来连续降准、降息的空间不大；财政政策方面，22 年已提前下达专项债额度 1.46 万亿，政策发力将前置，去年财政增收也为今年财政支出维持较高强度打下了基础。当前形势下，经济企稳压力较大，在多重政策呵护下，若经济企稳、信贷修复，则债券市场收益率存在一定上行压力，全年收益水平可能前低后高。

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，灵活调整久期，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，新产品新业务从战略规划到具体产品方案、业务模式，在制度流程、投资范围、投资工具、

运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表及调查、专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金每日收益计算并分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

无。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实现金添利货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23944 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实现金添利货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实现金添利货币市场基金(以下简称“嘉实现金添利货币基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了嘉实现金添利货币基金 2021 年</p>

	12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实现金添利货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	嘉实现金添利货币基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实现金添利货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实现金添利货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实现金添利货币基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实现金添利货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是

	<p>否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实现金添利货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实现金添利货币市场基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	57,217,871,402.86	72,874,277,431.97
结算备付金		293,788,381.82	209,438,095.24
存出保证金		7,348.91	1,717.39
交易性金融资产	7.4.7.2	73,124,831,499.57	54,048,038,438.34
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		71,011,931,499.57	50,692,185,438.34
资产支持证券投资		2,112,900,000.00	3,355,853,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	9,174,000,907.00	7,991,131,915.14
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	834,902,194.53	779,046,718.82
应收股利		-	-
应收申购款		9,000.00	463.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		140,645,410,734.69	135,901,934,780.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		13,350,040,319.93	7,790,710,482.57
应付证券清算款		3,697,792,333.30	4,500,000,000.00
应付赎回款		10,949.15	489,586.05
应付管理人报酬		32,987,282.19	30,253,473.89
应付托管费		5,497,880.36	5,042,245.68
应付销售服务费		24,190,673.59	22,185,880.88
应付交易费用	7.4.7.7	662,645.26	672,835.05
应交税费		831,348.42	1,028,461.08
应付利息		6,800,695.71	1,640,805.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	269,079.09	239,000.00
负债合计		17,119,083,207.00	12,352,262,770.37
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	123,526,327,527.69	123,549,672,010.25
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		123,526,327,527.69	123,549,672,010.25
负债和所有者权益总计		140,645,410,734.69	135,901,934,780.62

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 123,526,327,527.69 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实现金添利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年 12月31日	2020年1月1日至2020年 12月31日
一、收入		4,068,051,434.47	3,287,115,932.84
1. 利息收入		4,057,958,415.04	3,263,282,631.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,073,378,093.10	1,579,801,211.40
债券利息收入		1,585,770,894.46	1,494,278,581.32
资产支持证券利息收入		106,463,789.40	27,968,457.25
买入返售金融资产		292,345,638.08	161,234,381.26

收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,093,019.43	23,833,301.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,199,701.77	23,833,301.61
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-2,106,682.34	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		1,071,490,690.04	899,046,144.44
1. 管理人报酬	-	407,730,975.64	325,991,381.20
2. 托管费	-	67,955,162.67	54,331,896.85
3. 销售服务费	-	299,002,715.55	239,060,346.16
4. 交易费用	7.4.7.19	-	2,625.00
5. 利息支出		295,378,786.76	277,835,597.02
其中：卖出回购金融资产支出		295,378,786.76	277,835,597.02
6. 税金及附加		953,360.67	1,400,549.31
7. 其他费用	7.4.7.20	469,688.75	423,748.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,996,560,744.43	2,388,069,788.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,996,560,744.43	2,388,069,788.40

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实现金添利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	123,549,672,010.25	-	123,549,672,010.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,996,560,744.43	2,996,560,744.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,344,482.56	-	-23,344,482.56
其中：1.基金申购款	2,195,818,820,369.96	-	2,195,818,820,369.96
2.基金赎回款	-2,195,842,164,852.52	-	-2,195,842,164,852.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-2,996,560,744.43	-2,996,560,744.43
五、期末所有者权益(基金净值)	123,526,327,527.69	-	123,526,327,527.69
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	96,065,866,818.96	-	96,065,866,818.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,388,069,788.40	2,388,069,788.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	27,483,805,191.29	-	27,483,805,191.29
其中：1.基金申购款	1,403,587,233,251.48	-	1,403,587,233,251.48
2.基金赎回款	-1,376,103,428,060.19	-	-1,376,103,428,060.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-2,388,069,788.40	-2,388,069,788.40

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	123,549,672,010.25	-	123,549,672,010.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实现金添利货币市场基金(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[2014]442号《关于核准嘉实现金添利货币市场基金募集的批复》核准,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《嘉实现金添利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,《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》于2017年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为400,808,917.72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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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>》、中国证券投资基金业协会(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》、《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时,基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施,使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额。当日申购的基金份额自登记机构确认之日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自登记机构确认之日起，不享有基金的收益分配权益。本基金每份基金份额享有同等分配权。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	1,871,402.86	1,277,431.97
定期存款	57,216,000,000.00	72,873,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	2,273,000,000.00
存款期限1-3个月	500,000,000.00	3,500,000,000.00
存款期限3个月以上	56,716,000,000.00	67,100,000,000.00
其他存款	-	-
合计	57,217,871,402.86	72,874,277,431.97

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)

债券	交易所市场	270,500,274.93	270,063,000.00	-437,274.93	-0.0004
	银行间市场	70,741,431,224.64	70,779,799,000.00	38,367,775.36	0.0311
	合计	71,011,931,499.57	71,049,862,000.00	37,930,500.43	0.0307
资产支持证券		2,112,900,000.00	2,120,565,370.00	7,665,370.00	0.0062
合计		73,124,831,499.57	73,170,427,370.00	45,595,870.43	0.0369
项目		上年度末 2020年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	6,068,022.73	6,045,000.00	-23,022.73	-0.0000
	银行间市场	50,686,117,415.61	50,718,014,600.00	31,897,184.39	0.0258
	合计	50,692,185,438.34	50,724,059,600.00	31,874,161.66	0.0258
资产支持证券		3,355,853,000.00	3,355,853,000.00	-	-
合计		54,048,038,438.34	54,079,912,600.00	31,874,161.66	0.0258

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,700,000,000.00	-
银行间市场	474,000,907.00	-
合计	9,174,000,907.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,304,800,000.00	-
银行间市场	686,331,915.14	-
合计	7,991,131,915.14	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	6,331.71	671.95

应收定期存款利息	374,907,047.85	563,528,052.31
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	132,204.80	94,247.10
应收债券利息	424,875,402.93	201,711,769.60
应收资产支持证券利息	30,910,070.02	12,502,885.46
应收买入返售证券利息	4,071,133.92	1,209,091.60
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3.30	0.80
合计	834,902,194.53	779,046,718.82

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	662,645.26	672,835.05
合计	662,645.26	672,835.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	79.09	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	269,000.00	239,000.00
合计	269,079.09	239,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,549,672,010.25	123,549,672,010.25
本期申购	2,195,818,820,369.96	2,195,818,820,369.96
本期赎回（以“-”号填列）	-2,195,842,164,852.52	-2,195,842,164,852.52
- 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	123,526,327,527.69	123,526,327,527.69

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-	-	-
本期利润	2,996,560,744.43	-	2,996,560,744.43
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,996,560,744.43	-	-2,996,560,744.43
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	258,597.15	20,554,039.30
定期存款利息收入	2,068,660,886.10	1,557,080,880.88
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,458,548.50	2,166,200.72
其他	61.35	90.50
合计	2,073,378,093.10	1,579,801,211.40

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,199,701.77	23,833,301.61

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	12,199,701.77	23,833,301.61

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成交总额	118,709,858,189.37	166,704,008,291.96
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	117,813,577,885.73	165,537,339,641.69
减：应收利息总额	884,080,601.87	1,142,835,348.66
买卖债券差价收入	12,199,701.77	23,833,301.61

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成 交总额	4,030,975,870.21	875,272,713.98
减：卖出资产支持证 券成本总额	3,987,853,000.00	866,047,000.00
减：应收利息总额	45,229,552.55	9,225,713.98
资产支持证券投资收 益	-2,106,682.34	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	2,500.00
银行间市场交易费用	-	125.00
合计	-	2,625.00

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	140,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	171,956.55	156,098.90
债券托管账户维护费	34,800.00	36,000.00
其他	2,932.20	1,650.00
合计	469,688.75	423,748.90

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	407,730,975.64	325,991,381.20
其中：支付销售机构的客户维护费	12,658,225.25	21,237,744.90

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 0.30% 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×0.30%/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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	67,955,162.67	54,331,896.85

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。

7.4.10.2.3 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
	2021年1月1日至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	嘉实现金添利货币
嘉实基金管理有限公司	279,416,668.30
中国银行	19,552,810.07
嘉实财富	25.55
合计	298,969,503.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	嘉实现金添利货币

嘉实基金管理有限公司	216,785,021.09
中国银行	22,247,232.63
嘉实财富	2,071.84
合计	239,034,325.56

注：本基金的销售服务费年费率为 0.22%，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：日应销售服务费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.10.3 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 2021年1月1日至2021年12月31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
中国银行股份有限公司	-	-	-	-	56,267,822,000.00	5,491,060.91
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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
中国银行股份有限公司	1,149,557,116.02	299,764,024.59	-	-	91,082,816,000.00	7,160,899.46

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.19	0.19
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	-	-

报告期末持有的基金份额	0.19	0.19
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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	
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	1,871,402.86	258,597.15	1,277,431.97	20,554,039.30
中国银行股份有限公司_定期	11,500,000,000.00	312,392,499.42	-	57,150,902.71

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
2,996,560,744.43	-	-	2,996,560,744.43	-

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
183092	欲晓23A1	2021年12月20日	2022年1月17日	新发未上市	100.00	100.00	930,000	93,000,000.00	93,000,000.00	-
193207	永乐8优	2021年12月28日	2022年1月18日	新发未上市	100.00	100.00	250,000	25,000,000.00	25,000,000.00	-
193282	永乐7优	2021年12月20日	2022年1月5日	新发未上市	100.00	100.00	490,000	49,000,000.00	49,000,000.00	-
193793	明远04A1	2021年11月17日	2022年1月12日	新发未上市	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-
136840	惠和09A	2021年12月16日	2022年01月14日	新发未上市	100.00	100.00	290,000	29,000,000.00	29,000,000.00	-
136836	鹏程14A1	2021年12月22日	2022年01月14日	新发未上市	100.00	100.00	500,000	50,000,000.00	50,000,000.00	-
136876	惠和11A	2021年12月28日	2022年02月07日	新发未上市	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-
136886	惠和12A	2021年12月29日	2022年02月07日	新发未上市	100.00	100.00	380,000	38,000,000.00	38,000,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 13,350,040,319.93 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
112103031	21 农业银行 CD031	2022 年 1 月 4 日	99.43	1,000,000	99,433,026.72
112103049	21 农业银行 CD049	2022 年 1 月 4 日	99.10	2,386,000	236,452,443.29
112108044	21 中信银行 CD044	2022 年 1 月 4 日	99.57	3,000,000	298,724,641.52
112108050	21 中信银行 CD050	2022 年 1 月 4 日	99.53	2,747,000	273,397,023.28
112109093	21 浦发银行 CD093	2022 年 1 月 4 日	99.57	5,435,000	541,143,998.63
112110102	21 兴业银行 CD102	2022 年 1 月 4 日	100.00	11,236,000	1,123,600,000.00
112111160	21 平安银行 CD160	2022 年 1 月 4 日	100.00	5,618,000	561,800,000.00
112111252	21 平安银行 CD252	2022 年 1 月 4 日	100.00	2,084,000	208,400,000.00
112112155	21 北京银行 CD155	2022 年 1 月 4 日	99.68	2,128,000	212,122,109.87
190202	19 国开 02	2022 年 1 月 4 日	100.04	13,700,000	1,370,492,466.49
1928005	19 浦发银行小微债 01	2022 年 1 月 4 日	100.37	5,264,000	528,360,775.21
210201	21 国开 01	2022 年 1 月 4 日	100.01	3,467,000	346,749,414.05
219933	21 贴现国债 33	2022 年 1 月 4 日	99.87	1,800,000	179,762,121.78
112110102	21 兴业银行 CD102	2022 年 1 月 5 日	100.00	5,320,000	532,000,000.00
112110285	21 兴业银行 CD285	2022 年 1 月 5 日	100.00	2,128,000	212,800,000.00
112111016	21 平安银行 CD016	2022 年 1 月 5 日	100.00	17,792,000	1,779,200,000.00
112111131	21 平安银	2022 年 1 月 5 日	100.00	5,320,000	532,000,000.00

	行 CD131	日			
112111256	21 平安银行 CD256	2022 年 1 月 5 日	100.00	4,680,000	468,000,000.00
112110031	21 兴业银行 CD031	2022 年 1 月 6 日	100.00	10,000,000	1,000,000,000.00
112110102	21 兴业银行 CD102	2022 年 1 月 6 日	100.00	7,554,000	755,400,000.00
112111016	21 平安银行 CD016	2022 年 1 月 6 日	100.00	2,208,000	220,800,000.00
112111024	21 平安银行 CD024	2022 年 1 月 6 日	100.00	8,146,000	814,600,000.00
112111126	21 平安银行 CD126	2022 年 1 月 6 日	100.00	4,820,000	482,000,000.00
112111252	21 平安银行 CD252	2022 年 1 月 6 日	100.00	12,298,000	1,229,800,000.00
112111256	21 平安银行 CD256	2022 年 1 月 6 日	100.00	202,000	20,200,000.00
112117062	21 光大银行 CD062	2022 年 1 月 6 日	99.47	900,000	89,521,154.65
112117068	21 光大银行 CD068	2022 年 1 月 6 日	99.40	63,000	6,262,128.57
112111123	21 平安银行 CD123	2022 年 1 月 7 日	100.00	4,495,000	449,500,000.00
合计				145,791,000	14,572,521,304.06

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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 risk 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	510,527,269.87	1,070,445,669.52
A-1 以下	-	-
未评级	10,413,130,879.73	4,586,068,694.02
合计	10,923,658,149.60	5,656,514,363.54

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	3,731,299,649.46	1,329,478,683.96
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	3,731,299,649.46	1,329,478,683.96

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	2,112,900,000.00	3,355,853,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	2,112,900,000.00	3,355,853,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.6 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	50,097,140,570.50	37,363,278,435.42
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	50,097,140,570.50	37,363,278,435.42

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.3 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同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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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					
银行存款	48,817,871,402.86	8,400,000,000.00	-	-	57,217,871,402.86
结算备付金	293,788,381.82	-	-	-	293,788,381.82
存出保证金	7,348.91	-	-	-	7,348.91
交易性金融资产	72,355,461,255.10	769,370,244.47	-	-	73,124,831,499.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	9,174,000,907.00	-	-	-	9,174,000,907.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	834,902,194.53	834,902,194.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,000.00	9,000.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	130,641,129,299.56	9,169,370,244.47	-	-834,911,194.53	140,645,410,734.69
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	13,350,040,319.93	-	-	-	13,350,040,319.93
应付证券清算款	-	-	-	3,697,792,333.30	3,697,792,333.30
应付赎回款	-	-	-	10,949.15	10,949.15
应付管理人报酬	-	-	-	32,987,282.19	32,987,282.19
应付托管费	-	-	-	5,497,880.36	5,497,880.36
应付销售服务费	-	-	-	24,190,673.59	24,190,673.59
应付交易费用	-	-	-	662,645.26	662,645.26
应付税费	-	-	-	831,348.42	831,348.42
应付利息	-	-	-	6,800,695.71	6,800,695.71
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	269,079.09	269,079.09
负债总计	13,350,040,319.93	-	-	3,769,042,887.07	17,119,083,207.00
利率敏感度缺口	117,291,088,975.76	9,169,370,244.47	-	-2,934,131,692.54	123,526,327,527.69
上年度末 2020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					
银行存款	60,527,277,431.97	12,347,000,000.00	-	-	72,874,277,431.97
结算备付金	209,438,095.24	-	-	-	209,438,095.24
存出保证金	1,717.39	-	-	-	1,717.39
交易性金融资产	51,771,919,670.34	2,276,118,768.00	-	-	54,048,038,438.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,991,131,915.14	-	-	-	7,991,131,915.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	779,046,718.82	779,046,718.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	463.72	463.72
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	120,499,768,830.08	14,623,118,768.00	-	-779,047,182.54	135,901,934,780.62
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	7,790,710,482.57	-	-	-	7,790,710,482.57

应付证券清算款	-	-	-	4,500,000,000.00	4,500,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	489,586.05	489,586.05
应付管理人报酬	-	-	-	30,253,473.89	30,253,473.89
应付托管费	-	-	-	5,042,245.68	5,042,245.68
应付销售服务费	-	-	-	22,185,880.88	22,185,880.88
应付交易费用	-	-	-	672,835.05	672,835.05
应付税费	-	-	-	1,028,461.08	1,028,461.08
应付利息	-	-	-	1,640,805.17	1,640,805.17
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	239,000.00	239,000.00
负债总计	7,790,710,482.57	-	-	4,561,552,287.80	12,352,262,770.37
利率敏感度缺口	112,709,058,347.51	14,623,118,768.00	-	-3,782,505,105.26	123,549,672,010.25

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

7.4.13.4.3.2 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		
	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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	-	-
	业绩比较基准下降 5%	-	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 73,124,831,499.57 元，无属于第三层次的余额。（上年度末：无属于第一层次的余额，第二层次 54,048,038,438.34 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 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。

本基金报告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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	73,124,831,499.57	51.99
	其中：债券	71,011,931,499.57	50.49
	资产支持证券	2,112,900,000.00	1.50
2	买入返售金融资产	9,174,000,907.00	6.52
	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	57,511,659,784.68	40.89
4	其他各项资产	834,918,543.44	0.59
5	合计	140,645,410,734.69	100.00

8.2 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	10.25	
	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	13,350,040,319.93	10.81

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

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。

8.3.2 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	34.31	13.80
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	23.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	15.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	27.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	113.18	13.80

8.4 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。

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,077,461,709.16	0.87

2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,828,229,190.55	5.53
	其中：政策性金融债	5,182,371,420.85	4.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,723,658,149.60	8.68
6	中期票据	2,285,441,879.76	1.85
7	同业存单	50,097,140,570.50	40.56
8	其他	-	-
9	合计	71,011,931,499.57	57.49
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。

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112110102	21 兴业银行 CD102	30,000,000	3,000,000,000.00	2.43
2	112010546	20 兴业银行 CD546	27,000,000	2,700,000,000.00	2.19
3	112111024	21 平安银行 CD024	25,000,000	2,500,000,000.00	2.02
4	210201	21 国开 01	23,200,000	2,320,330,662.26	1.88
5	112111016	21 平安银行 CD016	20,000,000	2,000,000,000.00	1.62
5	112111123	21 平安银行 CD123	20,000,000	2,000,000,000.00	1.62
5	112111252	21 平安银行 CD252	20,000,000	2,000,000,000.00	1.62
8	112112155	21 北京银行 CD155	20,000,000	1,993,628,852.15	1.61
9	112110022	21 兴业银行 CD022	15,000,000	1,500,000,000.00	1.21
9	112111010	21 平安银行 CD010	15,000,000	1,500,000,000.00	1.21

9	112111126	21 平安银行 CD126	15,000,000	1,500,000,000.00	1.21
9	112111131	21 平安银行 CD131	15,000,000	1,500,000,000.00	1.21

8.7 “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	0.0466%
报告期内偏离度的最低值	-0.0307%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0111%

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%。

8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	193896	欲晓 22A1	1,820,000	182,000,000.00	0.15
2	136052	万科 22 优	1,200,000	120,000,000.00	0.10
3	193654	20 欲晓 A1	1,020,000	102,000,000.00	0.08
4	137737	链融 41A1	1,000,000	100,000,000.00	0.08
5	137677	惠和 01A	990,000	99,000,000.00	0.08
5	137682	惠和 02A	990,000	99,000,000.00	0.08
5	137691	21 合信 09	990,000	99,000,000.00	0.08
5	137709	诚意 5A1	990,000	99,000,000.00	0.08
5	137710	21 合信 10	990,000	99,000,000.00	0.08
6	183092	欲晓 23A1	930,000	93,000,000.00	0.08
7	137724	链融 40A1	800,000	80,000,000.00	0.06
7	193254	明远 03A1	800,000	80,000,000.00	0.06
8	193175	17 欲晓 A1	760,000	76,000,000.00	0.06
9	137675	南链优 12	650,000	65,000,000.00	0.05
10	137689	国链 29A1	600,000	60,000,000.00	0.05
10	137765	南链优 13	600,000	60,000,000.00	0.05

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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

(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。

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。

2021 年 9 月 30 日，北京银保监局发布行政处罚信息公开表（京银保监罚决字（2021）26 号），对北京银行股份有限公司服务收费管理不力，违规收费等违法违规事实，因违反《中华人民共和国商业银行法》第七十三条、第八十九条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，于 2021 年 9 月 26 日作出行政处罚决定，责令北京银行改正，并给予合计 820 万元罚款。2021 年 11 月 29 日，北京银保监局发布行政处罚信息公开表（京银保监罚决字（2021）30 号），对北京银行股份有限公司发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告，严重违反审慎经营规则等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，于 2021 年 11 月 24 日作出行政处罚决定，给予北京银行 40 万元罚款的行政处罚。

本基金投资于“21 国开 01(210201)”、“20 兴业银行 CD546(112010546)”、“21 兴业银行 CD022(112110022)”、“21 兴业银行 CD102(112110102)”、“21 北京银行 CD155(112112155)”的决策程序说明：基于对 21 国开 01、20 兴业银行 CD546、21 兴业银行 CD022、21 兴业银行 CD102、21 北京银行 CD155 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“21 国开 01”、“20 兴业银行 CD546”、“21 兴业银行 CD022”、“21 兴业银行 CD102”、“21 北京银行 CD155”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，其他五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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,348.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	834,902,194.53
4	应收申购款	9,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	834,918,543.44

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
12,976,366	9,519.33	1,859,173,639.10	1.51	121,667,153,888.59	98.49

9.2 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	1,034,596,792.63	0.84
2	其他机构	502,782,459.15	0.41
3	银行类机构	290,166,608.29	0.23
4	个人	11,290,304.54	0.01
5	个人	9,225,329.80	0.01
6	个人	8,996,343.73	0.01
7	其他机构	8,528,410.49	0.01
8	个人	8,276,295.24	0.01
9	基金类机构	7,633,673.43	0.01
10	个人	7,025,915.85	0.01

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,985,739.53	0.00

9.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月29日） 基金份额总额	400,808,917.72
本报告期期初基金份额总额	123,549,672,010.25
本报告期基金总申购份额	2,195,818,820,369.96
减：本报告期基金总赎回份额	2,195,842,164,852.52
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	123,526,327,527.69

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2021年5月29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》，杨竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

2021年7月23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》，龚康先生任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 140,000.00 元,该审计机构已连续 5 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-

华西证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
联储证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	3	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
野村东方国 际证券有限	2	-	-	-	-	-

公司						
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有 限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	10	-	-	-	-	-
中信证券华 南股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证	2	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
-------------	--	--	--	--	--	--

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。

3. 华宝证券有限责任公司更名为华宝证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国元证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：东方证券股份有限公司新增交易单元 1 个，海通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，联储证券有限责任公司新增交易单元 2 个，信达证券股份有限公司新增交易单元 2 个，野村东方国际证券有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 3 个。

11.7.2 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
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	50,074,500.00	15.73%	3,623,214,000.00	0.51%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	268,314,610.00	84.27%	710,494,200,000.00	99.49%	-	-
华西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
联储证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 华南股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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%。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 29 日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 23 日
3	嘉实基金管理有限公司关于继续在网 上直销开展基金认购、申购、转换费 率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 28 日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分 公募基金参与北京证券交易所股票投 资及相关风险提示的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 16 日
5	嘉实基金管理有限公司关于对中信银 行借记卡持卡人开通网上直销电子支 付业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 3 日
6	嘉实基金管理有限公司关于对中国邮 政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直 销电子支付业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 3 日
7	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资 者持续完善客户身份信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 24 日

§ 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。

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

2022 年 3 月 30 日