嘉实增益宝货币市场基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年03月26日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月22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2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实增益宝货币市场基金
基金简称	嘉实增益宝货币
基金主代码	004173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,044,744,495.32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。
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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	吴玉婷
	联系电话	(010)65215588	021-52629999-212052
	电子邮箱	service@jsfund.cn	0152890@cil.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95561
传真		(010)65215588	021-62535823

2.4 信息披露方式

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	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	392,636,098.73	238,178,030.55	1,185,020.44
本期利润	392,636,098.73	238,178,030.55	1,185,020.44
本期净值收益率	3.3329%	4.4290%	0.0537%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末基金资产净值	7,044,744,495.32	8,669,860,863.31	2,206,186,270.44
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
累计净值收益率	7.9675%	4.4851%	0.0537%

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	0.6597%	0.0009%	0.0881%	0.0000%	0.5716%	0.0009%
过去六个月	1.3865%	0.0013%	0.1763%	0.0000%	1.2102%	0.0013%
过去一年	3.3329%	0.0025%	0.3500%	0.0000%	2.9829%	0.0025%
自基金合同生效起至今	7.9675%	0.0023%	0.7060%	0.0000%	7.2615%	0.0023%

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

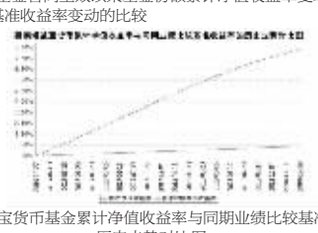
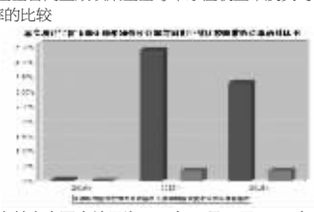


图:嘉实增益宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年12月27日至2018年12月31日)

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个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

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



注:本基金基金合同生效日为2016年12月27日,2016年度的相关数据根据当年实际存续期(2016年12月27日至2016年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位: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
2018年	392,636,098.73	-	-	392,636,098.73	-
2017年	238,178,030.55	-	-	238,178,030.55	-
2016年	1,185,020.44	-	-	1,185,020.44	-
合计	631,999,149.72	-	-	631,999,149.72	-

§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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的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,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2018年12月31日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、144只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数(QDII)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券A/B、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快钱货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合(LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券基金经理	2016年12月27日	-	9年	曾任Futex Trading Ltd期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司,曾任债券交易员,现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士研究生,CFA、具有基金从业资格。
李曈	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币基金经理	2017年5月25日	-	9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,现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理李金灿的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理李曈的任职日期指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

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、《嘉实增益宝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》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

2018年世界经济整体呈现温和增长,但增速出现放缓,主要经济体经济增速、通胀水平和货币政策分化明显。美国经济表现抢眼,美联储持续加息,新兴经济体资本流出加剧,金融市场呈现震荡。保护主义和单边主义抬头,国际经济贸易规则酝酿调整。国际货币基金组织预测数据显示,2018年世界GDP增长率与2017年基本持平。其中,2018年发达经济体GDP增速为2.4%,比2017年上升0.1个百分点,美国经济增速表现出上升趋势,欧元区和日本等其它经济体均出现增速回落现象。新兴市场与发展中经济体GDP增速为4.7%,与2017年一致,但内部分化显著,除印度等极少数国家之外,其他主要亚洲新兴经济体均显现出经济增速回落态势。

2018年,在面临中美贸易摩擦和国内稳杠杆的背景下,我国经济形势整体相对稳健,供给侧改革继续推进,但是经济下行压力和债务风险问题日益严重。2018年GDP增速达到了6.6%,低于去年的6.8%。分季度看,一季度同比增长6.8%,二季度增长6.7%,三季度增长6.5%,四季度增长6.4%。具体来看,工业增加值小幅回落,全年同比增速均值为6.17%,低于去年同比增速均值6.58%;"克强指数"前11个月均值为8.81%,明显低于去年均值11.52%;中国制造业采购经理指数(PMI)均值站到荣枯线以上,全年均值为50.90%,低于去年均值51.61%。以投资、消费和出口为代表的"三驾马车"增速涨跌互现,固定资产投资整体呈现回落态势,全年累计同比增速均值为5.68%,低于去年均值7.46%,其中房地产开发投资全年累计同比增速均值为9.13%,高于去年均值6.0%,民间固定资产投资小幅回升,全年累计同比增速为7.87%,高于去年均值6.0%;社会消费品零售总额也呈现回落,全年同比增速均值为8.22%,低于去年均值9.43%;受贸易摩擦抢出口和人民币贬值等影响,出口形势整体略有好转,出口金额全年同比增速均值为11.23%,高于去年均值7.65%。另外,全年价格水平整体出现温和小幅上行,全国居民消费价格总水平同比增速均值为2.13%,高于去年均值1.55%;全年PPI同比增速为3.54%,大幅低于去年均值6.33%。从金融数据来看,货币供应增速放缓,M2全年同比增速均值为8.28%,略低于去年均值9.32%;社会融资规模持续走低,全年新增规模均值为1.60万亿元,低于去年均值1.87万亿元;新增人民币贷款继续上升,全年新增均值为1.35万亿元,高于去年均值1.13万亿元。全年人民币汇率整体呈现先稳后贬走势,CNY全年累计贬值5.43%,CNH全年累计贬值5.47%,全年央行外汇资产减少为2232亿元,去年同期大幅减少4272亿元,跨境资金流出规模在管控下明显减少但是流出趋势难改。

货币政策以国内为主、以国外为辅,为应对经济下行风险,央行货币政策整体偏松,央行定向降准4次,央行还通过公开市场操作、国库现金定存、MLF和PSL等政策工具及时补充和调节市场流动性,全年公开市场操作(含国库现金定存)累计净投放资金8000亿元。银行间市场资金利率大幅回落,2018年末隔夜、7天、1个月和3个月回购加权利率较2017年末分别-226BP、-59BP、-286BP和-198BP;银行间市场国债收益率曲线呈现陡峭化下移,2018年末国债收益率曲线1年、3年、5年、7年和10年期收益率较去年末分别-119BP、-91BP、-88BP、-73BP和-65BP,10年期与1年期国债期限利差为63BP,较去年末扩大54BP。

2018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,2018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

本报告期基金份额净值收益率为3.3329%,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

国际货币基金组织2019年初发布了新版的《世界经济展望》。IMF认为,2018年全球增长率估计为3.7%,但由于2018年年底全球贸易局势、金融状况收紧,以及公共和私人债务高企等因素的影响。2019年全球经济增长不乐观,IMF认为可能实际增速只有3.5%。预计2019年全球经济增长将放缓。全球增长面临的风险偏于下行,贸易紧张局势的升级可能超出增长预测已经体现的程度,这仍是经济前景面临的一个主要风险。除了贸易不确定性之外,IMF认为还有诸多因素可能触发全球经济下行。尤其是随着美联储加息、欧洲央行退出QE(量化宽松)购债计划,融资环境已经从去年秋季以来收紧,且公私部门的债务处于相当高水平。同时,下行风险也包括了英国"无协议脱欧"等。其中,发达经济体实际增速将下滑到2%,低于2017年的2.4%和2018年的2.3%;而新兴市场和发展中经济体预计也将下滑到4.5%,低于2017年的4.7%和2018年的4.6%。

2019年国内经济下行压力较大,目前固定资产投资、消费和社融以及M2增速均处于历史低位,宽货币持续,宽信用有待观察,在国内经济风险隐患突显和中美贸易摩擦不确定的背景下,2019年经济目标完成压力较大。

在经济下行周期,2018年信用风险继续曝露,违约范围和金额继续扩大。2018年全年新增违约主体43家,涉及债券119只,涉及金额1166.51亿,约是2017年3.5倍,超过2014年~2017年违约金额的总和。2018年的债券违约从季度分布看,一季度、二季度、三季度和四季度新增违约主体分别为1家、8家、15家和19家,明显集中于下半年,且环比呈增加趋势。

2019年,在外部压力减弱的背景下,央行继续推进"宽货币"+"宽信用"组合政策,1月份已推出全面降准、普惠金融定向降准、TMLF和创设CBS等,预计宽信用起效前,宽货币持续。中国人民银行货币政策司司长发表文章《货币政策回顾与展望》,指出了2019年货币政策调控的政策思路:一是稳健的货币政策保持松紧适度,进一步强化逆周期调节。二是进一步发挥货币政策的结构优化作用,创新货币政策工具,以供给侧结构性改革为主线,落实好金融服务实体经济各项政策措施。三是切实防范化解重点领域金融风险,平衡好促发展与防风险之间的关系。四是协调好本外币关系,处理好内部均衡和外部均衡的平衡。五是提高金融结构的适应性,在服务经济结构转型升级的同时增强金融体系的韧性。

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

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历。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但不限于上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同第十六部分(二)基金收益分配原则"3."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;5.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",本期已实现收益为392,636,098.73元,每日分配,每日支付,合计分配392,636,098.73元,符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

4.8 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。

4.9 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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

嘉实增益宝货币市场基金 2018年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、注册会计师薛竞、张勇签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2019)第 22727号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:嘉实增益宝货币市场基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	4,490,682,365.67	5,036,833,596.11
结算备付金		10,090,909.08	4,635,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,906,041,167.27	3,520,475,235.58
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,906,041,167.27	3,520,475,235.58
资产支持证券投资		-	-
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	500,000,000.00	1,248,858,743.99
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	68,119,886.36	73,459,555.97
应收股利		-	-
应收申购款		200,010,809.93	156,703.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,174,945,138.31	9,884,419,744.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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		1,126,264,110.60	1,210,047,464.92
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		155,113.88	1,345,878.31
应付管理人报酬		1,742,656.95	1,277,222.37
应付托管费		580,885.67	425,740.78
应付销售服务费		116,177.13	85,148.14
应付交易费用	7.4.7.7	167,599.30	101,444.33
应交税费		20,876.39	-
应付利息		694,223.07	866,982.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	459,000.00	409,000.00
负债合计		1,130,200,642.99	1,214,558,881.11
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	7,044,744,495.32	8,669,860,863.31
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,044,744,495.32	8,669,860,863.31
负债和所有者权益总计		8,174,945,138.31	9,884,419,744.42

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额7,044,744,495.32份。

7.2 利润表
会计主体:嘉实增益宝货币市场基金
本报告期:2018年1月1日 至 2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日 至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年12月31日
一、收入		435,358,236.03	266,069,229.11
1.利息收入		430,684,684.98	266,101,885.60
其中:存款利息收入	7.4.7.11	151,075,494.34	166,457,509.56
债券利息收入		172,890,372.29	73,908,233.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		106,718,818.35	25,736,142.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		4,673,551.05	-32,656.49
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	4,673,551.05	-32,656.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.13	-	-
减:二、费用		42,722,137.30	27,891,198.56
1. 管理人报酬		18,626,410.90	8,207,099.89
2. 托管费		6,208,803.62	2,735,699.98
3. 销售服务费		1,241,760.77	547,139.95
4. 交易费用	7.4.7.14	150.00	-
5. 利息支出		16,012,058.26	15,911,316.90
其中:卖出回购金融资产支出		16,012,058.26	15,911,316.90
6. 税金及附加		39,323.65	-
7. 其他费用	7.4.7.15	593,630.10	489,941.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		392,636,098.73	238,178,030.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		392,636,098.73	238,178,030.55

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:嘉实增益宝货币市场基金
本报告期:2018年1月1日 至 2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018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)	8,669,860,863.31	-	8,669,860,863.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	392,636,098.73	392,636,098.73
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)	-1,625,116,367.99	-	-1,625,116,367.99
其中:1.基金申购款	73,396,286,528.96	-	73,396,286,528.96
2.基金赎回款	-75,021,402,896.95	-	-75,021,402,896.95
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)	-	-392,636,098.73	-392,636,098.73
五、期末所有者权益(基金净值)	7,044,744,495.32	-	7,044,744,495.32
	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017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)	2,206,186,270.44	-	2,206,186,270.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	238,178,030.55	238,178,030.55
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)	6,463,674,592.87	-	6,463,674,592.87
其中:1.基金申购款	12,900,488,538.42	-	12,900,488,538.42
2.基金赎回款	-6,436,813,945.55	-	-6,436,813,945.55
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)	-	-238,178,030.55	-238,178,030.55
五、期末所有者权益(基金净值)	8,669,860,863.31	-	8,669,860,863.31

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	王红	张公允
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 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一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人
中诚信托有限责任公司	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
德意志资产管理(亚洲)有限公司	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

7.4.4 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。

1.1.1.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2018年1月1日至2018年12月31日)及上年度可比期间(2017年1月1日至2017年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

1.1.1.2 关联方报酬

1.1.1.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,626,410.90	8,207,099.89
其中:支付销售机构的客户维护费	6,697.85	23.27

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司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。

1.1.1.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,208,803.62	2,735,699.98

注:支付基金托管人兴业银行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。

1.1.1.2.3 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 2018年1月1日 至 2018年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	嘉实增益宝货币	
嘉实基金管理有限公司	1,240,466.94	
合计	1,240,466.94	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	嘉实增益宝货币	
嘉实基金管理有限公司	547,026.13	
合计	547,026.13	

注:本基金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。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。

1.1.1.3 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 2018年1月1日 至 2018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