# 嘉实稳泽纯债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

嘉实现金添利货币市场基金2019年半年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2019年08月29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。本半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2019年8月23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。

半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§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 | 98,403,052,293.48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 | 本基金在严谨深入的研究分析基础上,综合考量资产配置比例,同时根据对市场收益率水平变化趋势的判断,本基金动态调整组合久期,以谋求控制风险、增加或锁定收益。严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资,同时根据利用市场机会获得超额收益。 |
| 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 | 王永民 |
| | 联系电话 | (010)65215588 | (010)66594896 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-600-8800 | 95566 |
| 传真 | | (010)65215588 | (010)66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 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 | 2019年01月01日-2019年06月30日 |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,033,462,042.82 |
| 本期利润 | 1,033,462,042.82 |
| 本期净值收益率 | 1.3933% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019年06月30日 |
| 期末基金资产净值 | 98,403,052,293.48 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019年06月30日 |
| 累计净值收益率 | 8.7385% |

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2182% | 0.0006% | 0.0287% | 0.0000% | 0.1895% | 0.0006% |
| 过去三个月 | 0.6742% | 0.0009% | 0.0871% | 0.0000% | 0.5871% | 0.0009% |
| 过去六个月 | 1.3933% | 0.0011% | 0.1734% | 0.0000% | 1.2199% | 0.0011% |
| 过去一年 | 3.1792% | 0.0015% | 0.3500% | 0.0000% | 2.8292% | 0.0015% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.7385% | 0.0020% | 0.7919% | 0.0000% | 7.9466% | 0.0020% |

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

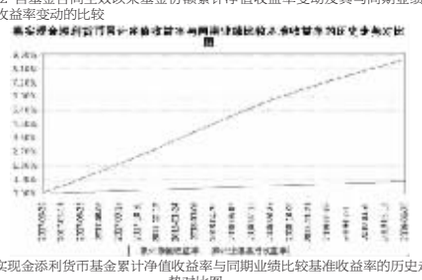

图:嘉实现金添利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月29日至2019年6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。

§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2019年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、154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/E、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、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老2040混合(FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债1-3政金债指数、嘉实养老2050混合(FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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、嘉实新金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实6个月理财债券、嘉实中短债债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券基金经理 | 2017年5月25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。 |
| 李曦 | 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、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实中短债债券基金经理 | 2017年4月13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。 |
| 万晓西 | 本基金、嘉实货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实新金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实6个月理财债券、嘉实中短债债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券基金经理 | 2017年3月29日 | - | 18年 | 曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部,南方基金固定收益部总监助理,宫庶宏观研究员、南方现金增利基金经理,第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理,民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理,2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任固定收益业务体系短端alpha策略组组长,中国国籍。 |

注:(1)基金经理万晓西的任职日期是指本基金合同生效之日,基金经理李金灿、李曦的任职日期是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

今年以来,国内经济面临较大下行压力,以及中美贸易谈判的不确定性有所增加,在这样的背景下央行进行了全面降准、定向中期借贷便利(TMLF)和普惠金融定向降准,流动性总体合理充裕。随后政策托底和地产边际放松的提振效果有所显现,经济小幅回升,流动性边际上收紧。然后地产调控再次收紧,企业融资在年初提前放贷和政策集中发力提振后再次疲弱,同时中美贸易摩擦由持续好转突然升级加剧,经济下行压力再次显现,于是5月份央行及时进行了定向降准,超额续作了MLF,并大量投放逆回购,流动性再次回归合理充裕。5月底,包商银行突然被监管机构接管,释放出监管层有意打破银行"刚兑"信号,短期对市场信心有所影响,引发交易对手和质押券的重新梳理,以及信用风险偏好的回收,流动性分层现象较为突出。此前,1年期AAA国股存单和城商行存单利差在10bps左右;包商事件后,1年期AAA国股存单、AAA城商行存单、AA+存单发行利率利差明显走阔至20、30bps。央行而后连续三周进行了大量流动性投放,至6月中旬监管部门通过召开座谈会、对锦州银行存单发行进行增信、及时公告处置进度等措施对市场情绪予以平稳,流动性供需基本平衡。

年初以来,资金面总体合理充裕,局部时间边际走紧,松紧程度的波动较大截至6月30日,由于全面降准、定向降准,以及财政支出力度增大等措施释放较多增量资金,央行公开市场操作净回笼10451亿元(含国库现金定存)。其中,逆回购到期40550亿元,投放37750亿元;MLF到期24100亿元,投放11400亿元;TMLF投放5249亿元。年初全面降准和普惠金融定向降准释放增量资金约5400亿元,5月定向降准释放增量资金约2800亿元。

2019年以来货币市场中枢有所下行,半年末银行间隔夜、7天、1个月和3个月回购加权利率较去年末分别-98bps、-47bps、-11bps 和-27bps至1.58%、2.66%、3.41%、3.58%;短端资产价格也有一定幅度下行:3个月、6个月和1年期AAA存单收益率较去年末分别-48bps、-32bps、-30bps至2.49%、2.93%和3.03%。1年期国债较去年末上行4bps至2.64%;1年期国开债较去年末持平下行3bps至2.72%。

2019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,2019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1.3933%,业绩比较基准收益率为0.1734%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后看三季度基本面和政策面对债券市场比较友好。基本面来看,地产投资高位回落、出口消费乏力,基建和社融增速短期内难以快速回升,通胀上行压力也逐步减弱。在此背景下货币政策从宽货币向紧货币的转变将会有所延迟,经济基本面和政策面共同对债券市场形成支撑。但同时三季度债券供给较大,且贸易谈判不确定性一直存在,可能对市场形成一定冲击。四季度基本面可能逐步趋于平稳,政策可能在边际上有所调整。货币政策逐步减少短期操作,预计等量续作MLF的降准搭配以LPR为贷款报价利率机制降息操作。宽信用的前提是宽货币,故降准旨在维稳资金面,亦不会"大水漫灌";降息旨在进一步降低小微企业融资实际利率。央行货币政策委员会2019年二季度例提出"在推动高质量发展中防范化解风险,把握好处置风险的力度和节奏,稳定市场预期"。

包商银行接管事件将会对银行业结构产生深远影响,低等级中小银行同业负债利率中将包含合理的信用利差,其继续通过同业负债去参与其他投资,以此来增加杠杆、增加盈利的行为将逐步收缩,中小银行的同业业务占比也会下降。包商事件后产生流动性分层及杠杆投资模式的变迁,同业存单刚兑的打破督促市场普遍加强交易对手和质押券的风险管理,非银机构赖以生存的加杠杆套利模式会被迫进行调整,双重影响下将直接影响中低评级个券的投资和估值。

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1,033,462,042.82元,每日分配,每日支付,合计分配1,033,462,042.82元,符合法律法规的规定和本基金合同的约定。

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

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 托管人对本半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"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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:嘉实现金添利货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 50,883,487,216.13 | 35,498,890,612.17 |
| 结算备付金 | | 50,027,061.59 | 50,098,987.39 |
| 存出保证金 | | 34,457.64 | 39,558.50 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 51,450,760,731.98 | 25,276,041,785.97 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 50,982,760,731.98 | 25,276,041,785.97 |
| 资产支持证券投资 | | 468,000,000.00 | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 4,298,925,628.46 | 5,276,880,555.31 |
| 应收证券清算款 | | - | 1,001,126,027.40 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 699,024,136.72 | 642,061,162.35 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 658,350.98 | 14,326.07 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 107,382,917,583.50 | 67,745,153,015.16 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | 8,931,664,454.19 | 6,848,501,551.73 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 684,420.16 | 5,155,473.92 |
| 应付管理人报酬 | | 23,460,866.48 | 15,523,927.67 |
| 应付托管费 | | 3,910,144.42 | 2,587,321.26 |
| 应付销售服务费 | | 17,204,635.40 | 11,384,213.63 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 598,050.40 | 466,139.24 |
| 应交税费 | | 803,875.38 | 506,833.08 |
| 应付利息 | | 1,396,737.13 | 6,080,361.12 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 142,097.46 | 459,000.00 |
| 负债合计 | | 8,979,865,290.02 | 6,890,664,821.65 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 98,403,052,293.48 | 60,854,488,193.51 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 98,403,052,293.48 | 60,854,488,193.51 |
| 负债和所有者权益总计 | | 107,382,917,583.50 | 67,745,153,015.16 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额98,403,052,293.48份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实现金添利货币市场基金

本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 1,370,240,851.36 | 784,472,963.31 |
| 1.利息收入 | | 1,356,992,821.95 | 782,925,518.46 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 778,392,928.49 | 492,587,147.16 |
| 债券利息收入 | | 514,108,558.55 | 258,912,104.11 |
| 资产支持证券利息收入 | | 2,578,194.37 | 345,790.65 |
| 买入返售金融资产收入 | | 61,913,140.54 | 31,080,476.54 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 13,248,029.41 | 1,547,444.85 |
| 其中:股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 13,248,029.41 | 1,547,444.85 |
| 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) | 6.4.7.13 | - | - |
| 减:二、费用 | | 336,778,808.54 | 147,253,981.07 |
| 1. 管理人报酬 | | 111,547,525.24 | 44,363,108.46 |
| 2. 托管费 | | 18,591,254.18 | 7,393,851.47 |
| 3. 销售服务费 | | 81,801,518.47 | 32,532,946.24 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.14 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 124,187,991.01 | 62,519,707.78 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 124,187,991.01 | 62,519,707.78 |
| 6. 税金及附加 | | 425,521.58 | 168,163.04 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.15 | 224,998.06 | 276,204.08 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 1,033,462,042.82 | 637,218,982.24 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 1,033,462,042.82 | 637,218,982.24 |

6.3 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:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30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) | 60,854,488,193.51 | - | 60,854,488,193.51 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,033,462,042.82 | 1,033,462,042.82 |
| 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) | 37,548,564,099.97 | - | 37,548,564,099.97 |
| 其中:1.基金申购款 | 393,036,826,998.89 | - | 393,036,826,998.89 |
| 2.基金赎回款 | -355,488,262,898.92 | - | -355,488,262,898.92 |
| 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) | - | -1,033,462,042.82 | -1,033,462,042.82 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 98,403,052,293.48 | - | 98,403,052,293.48 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30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) | 9,484,998,703.06 | - | 9,484,998,703.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 637,218,982.24 | 637,218,982.24 |
| 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) | 31,333,091,201.79 | - | 31,333,091,201.79 |
| 其中:1.基金申购款 | 192,293,052,237.82 | - | 192,293,052,237.82 |
| 2.基金赎回款 | -160,959,961,036.03 | - | -160,959,961,036.03 |
| 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) | - | -637,218,982.24 | -637,218,982.24 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 40,818,089,904.85 | - | 40,818,089,904.85 |

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 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

6.4 报表附注

6.4.1 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相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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 |
|---|---|
| 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 |
| 中国银行股份有限公司("中国银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 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 |
| 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 |

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 111,547,525.24 | 44,363,108.46 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 10,206,488.32 | 419,610.46 |

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0.3%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×0.3% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 18,591,254.18 | 7,393,851.47 |

注:支付基金托管人中国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。

6.4.4.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30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 | 71,081,660.81 | |
| 中国银行 | 10,708,929.71 | |
| 嘉实财富 | 102.71 | |
| 合计 | 81,790,693.23 | |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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 | 31,757,463.70 | |
| 中国银行 | 769,286.06 | |
| 合计 | 32,526,749.76 | |

注:本基金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。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。

6.4.4.3 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 2019年1月1日 至 2019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 |
| 中国银行股份有限公司 | 142,888,121.51 | 99,801,806.96 | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018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 |
| 中国银行股份有限公司 | 39,699,905.64 | 999,511,076.09 | - | - | 313,500,000.00 | 23,203.60 |

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 报告期初持有的基金份额 | 32,122,495.58 | 30,895,319.67 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 168,957.18 | 671,170.80 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | 32,291,452.57 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.19 | 31,566,490.47 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 0.08% |

注:本报告期内(2019年1月1日至2019年6月30日),基金管理人于2019年3月7日赎回本基金份额32,288,903.16份,2019年3月27日赎回本基金基金份额2,549.41份。上年度可比期间(2018年1月1日至2018年6月30日),基金管理人期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

6.4.4.4.2 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

| 关联方名称 | 本期末 2019年6月30日 | | 上年度末 2018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(%) |
| 嘉实资本 | 1,832.81 | 0.00 | 17,402,783.58 | 0.03 |

6.4.4.5 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 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018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 |
| 中国银行股份有限公司_活期 | 2,487,216.13 | 1,717,054.37 | 1,443,672.49 | 29,674.72 |
| 中国银行股份有限公司_定期 | 1,200,000,000.00 | 18,543,308.44 | - | - |

注:本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2019年1月1日至2019年6月30日)及上年度可比期间(2018年1月1日至2018年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(2019年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截