

嘉实现金添利货币市场基金更新招募说明书摘要

(2020年05月30日更新)

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

重要提示

嘉实现金添利货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2014年4月28日证监许可[2014]442号文《关于核准嘉实现金添利货币市场基金募集的批复》注册募集。并于2017年3月23日经机构部函[2017]793号《关于嘉实现金添利货币市场基金延期募集备案的回批》确认。本基金基金合同于2017年3月29日正式生效,自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定,本次更新招募说明书更新了基金管理人基本信息、基金经理信息,涉及“基金管理人”章节。

一、基金管理人

(一) 基金管理人基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
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层
办公地址	北京市建国门内大街8号华润大厦A座
法定代表人	经雷
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%,DWS Investments Singapore Limited 30%,立信投资管理有限公司30%。
存续期限	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡雪欣

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资格和特定资产管理业务资格。

(二) 主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、总经理及其他管理人员基本情况
牛成立先生,联席董事长,经济学硕士,中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长;中国银行厦门分行党委委员、副行长(挂职);中国银行银监管理务委员会(下称银监会)非银行金融机构监管处处长;银监会新疆监管局党委书记、副局长;银监会银行监管四部副主任;银监会黑龙江监管局党委书记、局长;银监会融资性担保业务工作组(融资性担保业务监管部际联席会议办公室)主任;中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长、兼任中国信托保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生,董事长,党委书记,经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所,外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限责任公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理,2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任银保监会财务部资金运用处主任科员;国都证券有限责任公司研究部高级经理;中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略岗。现任中诚信托有限责任公司业务总监兼国际业务部总经理,兼任中国国际资本有限公司总经理,中诚宝捷思货币经纪有限责任公司董事长及法人代表。

韩家乐先生,董事,1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今,任北京德恒律师事务所主任/总经理;2001年11月至今,任立信投资有限公司董事长。

Mark H.Cullen先生,董事,澳大利亚籍,澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管,贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人,德意志银行(纽约)全球股票投资部首席运营官,MD,德意志资产管理(纽约)全球首席运营官,MD,德意志银行(伦敦)首席运营官,德意志银行全球资产主管。现任DWS Management GmbH执行董事,全球首席运营官。

高翔先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总监,美国友邦金融产品集团结构产品部副总监。自1996年加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场中国区主管、上海分行行长,2006年至今任德意志银行(中国)有限公司行政、德意志银行集团中国区总经理。

李国祥先生,独立董事,美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任任职于中国建设银行总行,曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员,美国花旗银行分行分析师,美国世界银行顾问,中国南方证券有限公司副总裁,万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授,清华大学法律研究中心副主任,《清华法学》主编,海姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员,曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员,现兼任上海证券交易所上市公司委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,注册会计师,中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任,注册师副主任,商学院院长兼MBA教育中心主任。现任中央财经大学商学院教授。

经雷先生,董事、总经理,金融学、会计学专业本科学历,工商管理学士学位,特许金融分析师(CFA)。1998年至2008年在美国国际集团(AIG)国际投资有限公司美国纽约总部担任研究投资经理。2008年至2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监,首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就任职于嘉实基金管理有限公司,历任董事总经理(MD)、机构投资和固定收益业务首席投资官;2018年3月起任公司总经理。

张树忠先生,监事长,经济学博士,高级经济师,中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理;光大证券公司总裁助理,北方国际信托总经理,资产管理总监;光大保德信基金管理有限公司副总经理;大通证券有限责任公司副总经理、总经理,大成基金管理有限公司董事长、中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官;中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁,兼任中诚宝捷思管理(北京)有限公司董事长。

穆群先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教,长安信息产业(集团)股份有限公司董事会秘书,北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾宪政先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国浩律师集团(北京)事务所证券部律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部,法律部,现任法律部总监。

罗丽女士,监事,经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表,2004年9月至2006年1月任华泰人寿保险股份有限公司(筹)法律事务主管,2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法律经理,2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司,曾任稽核部投资总监,现任基金运营总监。

王玮女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

郭杰先生,机构首席投资官,硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司,海富通基金管理有限公司,2012年6月加入嘉实基金管理有限公司,历任部门总监、策略组组长,现任公司机构首席投资官。

2. 基金经理

(1) 现任基金经理
李耀先生,硕士研究生,10年证券从业经历,具有基金从业资格。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。2015年5月14日至2018年11月2日任嘉实财富7天债券型证券投资基金基金经理,2016年1月28日至2020年5月29日任嘉实活期宝货币市场基金基金经理。2016年4月21日至2020年5月29日任嘉实快线货币市场基金基金经理。2015年1月28日至至今任嘉实活钱货币市场基金基金基金经理。2015年5月14日至至今任嘉实安心货币市场基金基金基金经理。2016年1月28日至至今任嘉实活期宝货币市场基金基金基金经理。2016年4月21日至至今任嘉实快线货币市场基金基金基金经理。2016年12月22日至至今任嘉实现金宝货币市场基金基金基金经理。2017年4月13日至至今任嘉实现金添利货币市场基金基金基金经理。2017年5月24日至至今任嘉实超短债债券投资基金基金基金经理。2017年5月25日至至今任嘉实增益货币市场基金基金基金经理。2017年5月25日至至今任嘉实理财宝货币市场基金基金基金经理。2017年6月25日至至今任嘉实中证短债债券投资基金基金基金经理。2019年1月24日至至今任嘉实中债短债债券投资基金基金基金经理。2019年9月26日至至今任嘉实天颐中债短债债券投资基金基金基金经理。

(2) 历任基金经理
万晓霞女士,管理时间为2017年3月29日至2019年8月30日;李金灿先生,管理时间为2017年5月25日至2020年6月29日。
(3) 债券投资决策委员会
债券投资决策委员会的成员包括:公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系策略组组长王茜女士、胡永青先生、王怀震先生。

二、基金托管人

(一) 基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记时间:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿柒仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人:刘连舸
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人:许俊

传真:(010) 66594942
中国银行客服电话:95566
(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有银行托管经验。证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、OFII、ROFII、QDII,境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三) 证券投资基金托管情况

截至2020年3月31日,中国银行已托管780只证券投资基金,其中境内基金735只,QDII基金45只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、POF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四) 托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AA01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1.直销机构

名称	嘉实基金管理有限公司直销中心
办公地址	北京市东城区建国门内大街71号北京万豪中心D座12层
电话	(010) 65215588 传真 (010) 65215677
联系人	黄珊
名称	嘉实基金管理有限公司上海直销中心
办公地址	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层
电话	(021) 38789658 传真 (021) 68880023
联系人	邵婧

(3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新交子大道177号中海国际中心A座2单元21层04-05单元
电话	(028) 86202100 传真 (028) 86202100
联系人	王娟明

(4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦16层
电话	0755-84362200 传真 (0755) 25870663
联系人	陈翠珊

(5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室
电话	(0652) 66777991 传真 (0532) 66777676
联系人	胡晓楠

(6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城2幢1001A室
电话	(0571) 88061392 传真 (0571) 88021391
联系人	王薇

(7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路137号信合广场801A单元
电话	(0591) 88013670 传真 (0591) 88013670
联系人	吴志峰

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山南路288号新世纪广场A座4202室
电话	(025) 66671118 传真 (025) 66671100
联系人	徐莉娟

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心裙楼103,203单元
电话	(020) 62306006 传真 (020) 62306005
联系人	周炜

2.代销机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
	办公地址:中国北京市复兴门内大街1号	法定代表人:刘连舸 电话:(010)66594938 传真:(010)66594946 客服电话:95566 网址:http://www.bocm.com
1	中国银行股份有限公司	办公地址:四川省南充市顺庆区滨江中路一段97号26楼 法定代表人:周晓 联系人:樊海霞 电话:(028-67676033 传真:(028-67676033 网址:http://www.citic.com
2	四川天府银行股份有限公司	办公地址:山东青岛市市南区秦岭路6号1号楼 法定代表人:刘训生 联系人:李洪波 电话:(0532-69657228 传真:(0532-85933730 客服电话:(0400-021-96668 网址:http://www.qfcb.com
3	青岛农村商业银行股份有限公司	办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号中国金融中心三期3楼 法定代表人:吕国林 联系人:张琪 电话:(021-20288980 传真:(021-20289110 客服电话:(0400-021-8850 网址:http://www.harvestwm.com
4	嘉实财富管理有限公司	办公地址:北京市朝阳区东四环中路27号院5号楼3201F3201单元 法定代表人:李志刚 联系人:李艳 电话:(010-59497361 联系人:李晏青 电话:(010-64789016 客服电话:(010-6478-0162 网址:http://www.jrcb.com
5	浦银基金销售有限公司	办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号中国金融中心三期3楼 法定代表人:李志刚 联系人:李晏青 电话:(010-64789016 客服电话:(010-6478-0162 网址:http://www.jrcb.com
6	中民财富基金销售(上海)有限公司	办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2F 法定代表人:姜晓东 联系人:于舒 电话:(0411-39027828 传真:(0411-39027835 客服电话:(4000-899-1000 网址:http://www.yitaijin.com
7	大连网金基金销售有限公司	办公地址:上海市黄浦区老太平弄98号A、B单元 法定代表人:李洪军 联系人:李晏青 电话:(021-33563392 传真:(021-63563736 客服电话:(400-876-5716 网址:http://www.cmiwm.com/
8	万家财富基金销售(天津)有限公司	办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层 法定代表人:李志刚 联系人:李晏青 电话:(010-59013842/15819216322 电话:(010-59013828 网 址 :http://www.wanjiawealth.com
9	阳光人寿保险股份有限公司	办公地址:北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼泰国大厦A座 法定代表人:李科 联系人:王超 电话:(010-59053660 传真:(010-59057700 客服电话:(95051 网址:http://tllife.sinosig.com/

大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年12月31日 (“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	64,048,172,489.15	57.11
	其中:债券	63,728,172,489.15	56.82
	资产支持证券	320,000,000.00	0.29
2	买入返售金融资产	5,065,273,277.90	4.52
	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	42,433,110,357.44	37.84
4	其他资产	601,734,906.61	0.54
5	合计	112,148,291,031.10	100.00

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	15.13
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	16.68
	其中:买断式回购融资	-

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期末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末每日融资余额占基金资产净值比例简单平均值。(2)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%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	83

注: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。

(2) 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	19.51	16.68
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	14.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.11	16.68

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。

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	119,723,116.07	0.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,784,461,595.94	7.06
	其中:政策性金融债	4,823,986,619.08	5.02
4	企业债券	50,095,214.51	0.05
5	企业短期融资券	8,375,696,983.02	8.72
6	中期票据	1,198,181,995.11	1.25
7	同业存单	47,199,851,593.60	49.13
8	其他	-	-
9	合计	63,728,172,489.15	66.34
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中心,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折价和利息在应收利息。

6. 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11191635	19上海银行CD354	25,000,000	2,488,216.04937	2.59
2	11191307	19南商银行CD202	20,000,000	1,988,829.37339	2.07
3	11191038	19平安银行CD184	15,000,000	1,482,426.68401	1.54
4	11190825	19平安银行CD254	15,000,000	1,482,046.95607	1.54
5	11191106	19平安银行CD267	14,800,000	1,463,013.07251	1.52
6	190206	19国开06CD195	11,000,000	1,100,014.54529	1.15
7	11190319	19农业银行CD198	10,000,000	995,279.62041	1.04
8	11191843	19华夏银行CD434	10,000,000	989,440.60237	1.03
9	11191844	19华夏银行CD448	10,000,000	988,622.00760	1.03

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	165334	国债06A1	1,460,000	146,000.00000	0.15
2	159532	国债04A2	1,170,000	117,000.00000	0.12
3	159702	国债06A2	570,000	57,000.00000	0.06

注:报告期末,本基金仅持有上述3只资产支持证券。9. 投资组合报告附注
(1) 基金定价方法说明
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。
(2) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行人主体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、处罚的情况。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明。
报告期内本基金投资的前十名证券的发行人主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行人主体未受到公开谴责、处罚。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	601,423,208.34
4	应收申购款	311,688.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	601,734,906.61

十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
(一) 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 率①	净值增长率 基准差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
2017年3月29日 (基金合同生效日)至 2017年12月31日	3.1472%	0.0016%	0.2665%	0.0000%	2.8807%	0.0016%
2018年	3.9720%	0.0017%	0.3500%	0.0000%	3.6220%	0.0017%
2019年	2.6856%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	2.3356%	0.0009%