嘉实货币市场基金

【2013】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：2013年8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。本半年度报告已经由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2013年8月20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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实货币市场基金	
基金简称	嘉实货币	
基金主代码	070008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年3月18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	16,182,436,030.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	嘉实货币A	嘉实货币B
下属分级基金的交易代码：	070008	070088
报告期末下属分基基金的份额总额	6,256,525,604.58份	9,925,910,426.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	力求资产的安全性和流动性，追求超过业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济指标决定债券组合的剩余期限和比例分布；根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例；根据债券的信用等级及担保状况决定组合的风险级别。
业绩比较基准	税后活期存款利率
风险收益特征	本基金具有较低风险、流动性强的特征。

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	唐州徽
	联系电话	(010)65215588	95566
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65182266	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告报告备置地点	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

基金级别	嘉实货币A	嘉实货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)
本期已实现收益	166,731,562.99	368,379,414.65
本期利润	166,731,562.99	368,379,414.65
本期净值收益率	1.7677%	1.8889%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末基金资产净值	6,256,525,604.58	9,925,910,426.35
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)	
累计净值收益率	28.3054%	2.0369%

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)嘉实货币A与嘉实货币B适用不同的销售服务费率。 ③)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；④)本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金表现

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

嘉实货币A

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	0.2609%	0.0017%	0.0287%	0.0000%	0.2322%	0.0017%
过去三个月	0.8334%	0.0014%	0.0871%	0.0000%	0.7463%	0.0014%
过去六个月	1.7677%	0.0036%	0.1734%	0.0000%	1.5943%	0.0036%
过去一年	3.5320%	0.0030%	0.3507%	0.0000%	3.1813%	0.0030%
过去三年	11.3019%	0.0050%	1.2500%	0.0002%	10.0519%	0.0048%
自基金合同生效起至今	28.3054%	0.0086%	8.4076%	0.0022%	19.8978%	0.0064%

嘉实货币B

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	0.2808%	0.0018%	0.0287%	0.0000%	0.2521%	0.0018%
过去三个月	0.8939%	0.0014%	0.0871%	0.0000%	0.8068%	0.0014%
过去六个月	1.8889%	0.0036%	0.1734%	0.0000%	1.7155%	0.0036%
自基金合同生效起至今	2.0369%	0.0034%	0.1878%	0.0000%	1.8491%	0.0034%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

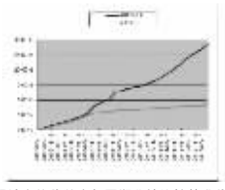

图1：嘉实货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2005年3月18日至2013年6月30日)

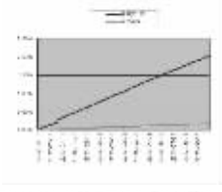

图2：嘉实货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年12月17日至2013年6月30日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同第十五节(二、投资范围和八、投资限制)的规定：①)投资组合的平均剩余期限不得超过180天；②)投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的10%；③)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；④)除发生巨额赎回的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%；⑤)中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

§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2013年6月30日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、47只开放式证券投资基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、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、嘉实优质企业股票、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)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、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)等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，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		
魏莉	本基金基金经理、嘉实超短债债券基金经理	2009年1月16日	-	10年	曾任职于国家开发银行国际金融局，中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金从事固定收益投资研究工作。金融硕士，CFA，CPA，具有基金从业资格，中国国籍。

注：①)任职日期、离任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

在报告期内，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

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

2013年上半年，资金面是货币市场的关键性主导因素，流动性先松后紧，资金利率大幅波动。5月下旬之前，整体资金面一直维持宽松局面，外汇占款持续增长，社会融资总量和银行信贷相对超预期，期间银行间1天和7天回购利率均值分别在2.4%和3.2%左右。上半年央行的货币政策有所调整，公开市场2月重启正回购操作，5月重启央票发行，反映其不希望资金面总量继续宽松的态度，货币政策由宽松转为中性；但央行每周正回购量维持少量的数百亿，回笼力度相对偏弱，对市场影响不大，资金面整体仍偏宽松。上半年宏观经济数据弱于预期，显示经济仍处于弱复苏态势，通胀压力也不大，对债市构成支撑。在资金面和宏观经济数据的配合下，各机构配置需求旺盛，债券收益率整体下行，部分投资者更增加杠杆运作，1年期国开金融债二级市场收益率由年初3.4%下降至1季末的3.29%。但是5月20日开始，企业所得税年度集中清缴、端午节假期现金需求、外汇市场变化、银行补缴法定准备金、理财产品集中到期、季末银行争夺存款等多种因素的影响持续并叠加，市场资金面迅速逆转，由前期的宽松转入紧张。过往一直担当资金供给方的国有大型银行也纷纷减少融出量甚至转为融入，市场恐慌情绪不断升级，在最为紧张的6月20日，银行间1天和7天回购利率均值分别升至11.6%和11.7%。之后央行出面稳定市场情绪，并对部分银行提供流动性支持，季末最后一周，市场信心才有所恢复，资金成本逐步下行。但5月20日至6月末，银行间1天和7天回购利率均值仍高达5.95%和6.26%。资金成本的持续高企导致整体债市下跌，部分投资者出于流动性需要被迫抛售，短期债券受到的冲击尤为剧烈。虽然后期市场有所恢复，2季末1年期国开金融债收益率仍高达4.08%，较1季末上行约80基点。信用产品方面，短融收益率跟随基准利率波动的同时，债市上行时信用利差收窄，而债市下跌时信用利差则扩宽。上半年高评级的AAA级短融收益率先由年初的4.46%降至1季末的4.0%左右，然后2季末又飙升超过5%，中等评级的AA级短融收益率则由年初的4.86%降至1季末的4.3%左右，2季末则升至5.43%，波幅均超过100基点。

面对剧烈波动的市场，上半年本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务；灵活配置银行间回购和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；债券持仓控制整体仓位，保持中性较短久期，在实现组合较高静态收益的同时，减小组合承担的利率风险。上半年组合规模大幅波动，通常每季前期规模增长较多，但靠近季末则有所回落。2季度后期市场资金面紧张叠加季末因素，投资者赎回较为集中，组合主要通过到期支取同业存款进行应对，不需要在收益率上行阶段被动减持债券，组合收益率相对稳定。整体看，上半年本基金成功应对了市场冲击和规模波动，并保持了平稳的投资业绩，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

本报告期嘉实货币A的基金份额净值收益率为1.7677%，嘉实货币B的基金份额净值收益率为1.8889%，同期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

展望2013年下半年，宏观经济、通胀走势和资金面仍将是影响货币市场的主要因素。整体看，海外量化宽松政策的退出已渐趋明朗，国内通胀较大概率仍然在3%以下，经济处于弱复苏状况。综合当前国内外整体经济和货币环境，预计央行将持续稳健的货币政策，并着力增强政策的前瞻性、针对性和灵活性，适时适度进行预调微调。6月份资金面最紧张的阶段已经过去，但预期未来资金面难以回到前期宽松状况，利率中枢将有所抬升。周小川行长讲话中提到，未来央行工作关注重点是，一方面引导金融机构保持合理信贷投放，合理安排资产负债总量和期限结构，支持实体经济的结构调整和转型升级；另一方面，也将综合运用各种工具和手段，适时调节市场流动性，保持市场总体稳定，为金融市场平稳运行和经济发展创造良好的货币条件。央行公开市场操作和正回购利率将是影响资金面、资金利率和投资者政策预期的关键指标。同时，3季度是传统的债市供给增加、资金相对紧张时期，同时重启股票IPO也已经纳入日程，4季度之前资金面和债市状况需要谨慎。近期监管层在讨论的同业业务规范、抑制银行同业业务规模的增长，推动金融去杠杆，以及不断完善、日趋严格的债券监管规定，这都将对债券和资金市场带来复杂和深远影响，下半年要重点关注这方面的政策。针对上述复杂的市场环境，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、法律稽核等部门负责人组成，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，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

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二十节三、基金收益分配原则的约定：①、每日分配、按月支付。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益"，②、本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计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A类份额已实现收益为166,731,562.99元，每日分配，每月支付，合计分配166,731,562.99元，B类份额已实现收益为368,379,414.65元，每日分配，每月支付，合计分配368,379,414.65元，符合本基金基金合同的约定。

§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")在对嘉实货币市场基金(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、基金份额申购赎回价格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：嘉实货币市场基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,596,695,443.65	14,800,677,655.95
结算备付金		12,490,909.09	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	11,417,073,111.57	10,494,735,744.47
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,417,073,111.57	10,494,735,744.47
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	756,200,898.10	1,652,600,000.00
应收证券清算款		122,945,859.31	-
应收利息	6.4.7.5	167,760,371.54	262,309,436.28
应收股利		-	-
应收申购款		153,558,585.69	730,217.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,226,725,178.95	27,211,053,053.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		-	2,100,478,429.76
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		15,365,005.84	101,471,498.29
应付管理人报酬		7,067,897.78	6,313,509.60
应付托管费		2,141,787.19	1,913,184.75
应付销售服务费		1,811,173.14	3,571,732.77
应付交易费用	6.4.7.7	154,616.33	193,256.18
应交税费		35,940.00	35,940.00
应付利息		-	222,675.43
应付利润		17,458,751.02	23,110,467.58
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	253,976.72	381,335.87
负债合计		44,289,148.02	2,237,692,030.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	16,182,436,030.93	24,973,361,023.47
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		16,182,436,030.93	24,973,361,023.47
负债和所有者权益总计		16,226,725,178.95	27,211,053,053.70

注：报告截止日2013年6月30日，嘉实货币A基金份额净值1.0000元，基金份额总额6,256,525,604.58份；嘉实货币B基金份额净值1.0000元，基金份额总额9,925,910,426.35份。 嘉实货币基金份额总额合计为16,182,436,030.93份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实货币市场基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		642,057,991.79	560,963,932.66
1.利息收入		610,486,471.33	517,356,970.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	400,912,825.55	346,792,479.95
债券利息收入		189,445,453.32	152,356,859.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,128,192.46	18,207,631.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益		31,559,020.46	43,606,962.02
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	31,559,020.46	43,606,962.02
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(-		-	-
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.13	12,500.00	-
减：二、费用		106,947,014.15	97,867,113.35
1.管理人报酬		48,470,239.69	32,769,749.10
2.托管费		14,687,951.41	9,930,227.00
3.销售服务费		12,794,898.39	24,825,567.57
4.交易费用	6.4.7.14	-	-
5.利息支出		30,690,039.95	30,126,362.25
其中：卖出回购金融资产支出		30,690,039.95	30,126,362.25
6.其他费用	6.4.7.15	303,884.71	215,207.43
三、利润总额		535,110,977.64	463,096,819.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润		535,110,977.64	463,096,819.31

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实货币市场基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	24,973,361,023.47	-	24,973,361,023.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	535,110,977.64	535,110,977.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-8,790,924,992.54	-	-8,790,924,992.54
其中：1.基金申购款	88,594,451,286.37	-	88,594,451,286.37
2.基金赎回款	-97,385,376,278.91	-	-97,385,376,278.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-535,110,977.64	-535,110,977.64
五、期末所有者权益(基金净值)	16,182,436,030.93	-	16,182,436,030.93
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	20,123,294,778.97	-	20,123,294,778.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	463,096,819.31	463,096,819.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,448,802,195.13	-	1,448,802,195.13
其中：1.基金申购款	62,328,054,698.08	-	62,328,054,698.08
2.基金赎回款	-60,879,252,502.95	-	-60,879,252,502.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-463,096,819.31	-463,096,819.31
五、期末所有者权益(基金净值)	21,572,096,974.10	-	21,572,096,974.10

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：

赵学军　　李松林　　王红

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

本基金在本报告期间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

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(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	48,470,239.69	32,769,749.10
其中：支付销售机构的客户维护费	5,487,796.24	6,093,997.59

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0.33%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× 0.33% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,687,951.41	9,930,227.00

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0.1%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×0.1% / 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 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实货币A	嘉实货币B	合计
嘉实基金管理有限公司	1,923,190.79	834,377.90	2,757,568.69
中国银行	2,778,796.75	46,672.39	2,825,469.14
合计	4,701,987.54	881,050.29	5,583,037.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实货币A	嘉实货币B	合计
嘉实基金管理有限公司	8,411,173.77	-	8,411,173.77
中国银行	3,660,921.10	-	3,660,921.10
合计	12,072,094.87	-	12,072,094.87

注：①)嘉实货币A类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日A类基金份额销售服务费=前一日A类基金份额资产净值x0.25%/当年天数。

②)嘉实货币B类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日B类基金份额销售服务费=前一日B类基金份额资产净值x0.01%/当年天数。

③)2012年12月13日本基金管理人发布《关于嘉实货币市场基金实施基金份额分类修改基金合同、招募说明书、托管协议"的公告，自2012年12月17日起，本基金分为嘉实货币A、嘉实货币B。2012年12月17日前本基金销售服务费归入嘉实货币A级销售服务费列示。

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 2013年1月1日至2013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	521,423,939.59	222,799,717.40	-	-	25,449,580,000.00	2,629,926.19
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	350,983,423.29	1,283,554,417.86	-	-	73,424,180,000.00	9,304,643.56

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

本期(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日)，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

嘉实货币A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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
立信投资有限责任公司	1,656,964.50	0.03%	1,627,996.89	0.02%

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	6,695,443.65	190,344.90	2,563,778,410.12	44,433,491.46

注：①)本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，活期银行存款按银行同业利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。 ②)本期末(2013年6月30日)，本基金无存于中国银行的定期存款，本期(2013年1月1日至2013年6月30日)，由中国银行保管的银行存款产生的利息收入无定期存款利息收入；上期末(2012年6月30日)由中国银行保管的银行存款余额含定期存款2,550,000,000.00元，上年度可比期间(2012年1月1日至2012年6月30日)，由中国银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入44,359,042.16元。

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(2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间(2012年1月1日至2012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(2013年6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(2013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

本期末(2013年6月30日)，本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

本期末(2013年6月30日)，本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	11,417,073,111.57	70.36
	其中：债券	11,417,073,111.57	70.36
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	756,200,898.10	4.66
	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	3,609,186,352.74	22.24
4	其他各项资产	444,264,816.54	2.74
	合计	16,226,725,178.95	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.08	
	其中：买断式回购融资	0.11	
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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：①)报告期末，本基金无债券回购融资余额。 ②)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。 ③)报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	132
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	81

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过180天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)