嘉实安心货币市场基金

【2014】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:2014年8月25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2014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2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实安心货币市场基金	
基金简称	嘉实安心货币	
基金主代码	070028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月28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	2,026,129,198.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
下属分级基金的交易代码:	070028	070029
报告期末下属分级基金的份额总额	53,446,789.61份	1,972,682,408.68份

2.2 基金产品说明

投资目标	以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金以确保组合安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。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	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本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)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	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	1,223,082.29	12,790,270.94
本期利润	1,223,082.29	12,790,270.94
本期净值收益率	1.9478%	2.0691%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	53,446,789.61	1,972,682,408.68
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(2014年6月30日)	
累计净值收益率	7.9570%	8.6091%

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)嘉实安心货币A与嘉实安心货币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

嘉实安心货币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	0.3157%	0.0040%	0.1110%	0.0000%	0.2047%	0.0040%
过去三个月	0.8855%	0.0026%	0.3366%	0.0000%	0.5489%	0.0026%
过去六个月	1.9478%	0.0039%	0.6695%	0.0000%	1.2783%	0.0039%
过去一年	3.6261%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	2.2761%	0.0032%
自基金合同生效起至今	7.9570%	0.0036%	3.4535%	0.0001%	4.5035%	0.0035%

嘉实安心货币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	0.3356%	0.0040%	0.1110%	0.0000%	0.2246%	0.0040%
过去三个月	0.9461%	0.0026%	0.3366%	0.0000%	0.6095%	0.0026%
过去六个月	2.0691%	0.0039%	0.6695%	0.0000%	1.3996%	0.0039%
过去一年	3.8748%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	2.5248%	0.0032%
自基金合同生效起至今	8.6091%	0.0036%	3.4535%	0.0001%	5.1556%	0.0035%

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

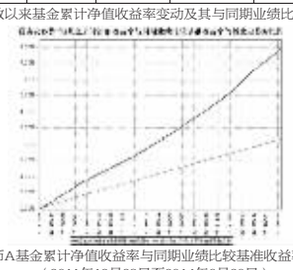

图1:嘉实安心货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月28日至2014年6月30日)

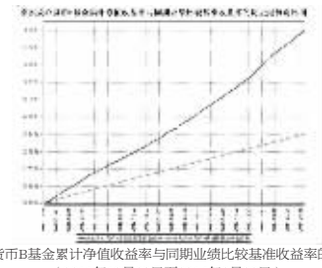

图2:嘉实安心货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月28日至2014年6月30日)

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(十四(二)投资范围和(八)投资组合比例限制)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2014年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、62只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、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)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、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、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实理财宝7天债券、嘉实1个月理财债券、嘉实薪金宝货币基金经理	2013年12月19日	-	11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;(3)2014年8月13日,本基金管理人发布《关于新增嘉实安心货币基金经理的公告》,增聘张文玥女士担任本基金基金经理,与魏莉女士共同管理本基金。

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、《嘉实安心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

2014年上半年,资金面仍是货币市场的关键性主导因素。1月末春节假期临近,大量现金流出效应明显,央行采取了逆回购操作,稳定了市场预期。在春节后大量现金回流,央行重启了正回购进行对冲。一季度人民币创下历年最高的2.6%的季度贬幅,3月17日起,银行间即期外汇市场人民币兑美元交易价浮动幅度由1%扩大至2%,人民币进入双向波动阶段。随着经济数据的乏力下滑,央行展开了一系列定向微调的维稳政策。4月25日起下调县域农商行存准率2个百分点,下调县域农合行存准率0.5个百分点。6月16日起,又对符合审慎经营要求且"三农"和小微企业贷款达到一定比例的商行下调存准率0.5个百分点。央行还通过定向发放给国开行一万亿额度的再贷款,专项用于支持棚户区改造。今年以来金融机构新增外汇占款出现持续下滑的趋势,至6月底为-883亿元,十个月正增长后首次出现下降。6月中旬IPO重启对货币市场带来扰动,但在央行的稳定指引下半年末仍然平稳渡过。上半年对货币基金影响显著的另一方面是银行同业存款政策调整。伴随市场资金面的宽松,1年期同业存款利率在春节前突破7%高位后,同业存款利率大幅下降,央行窗口指导商业银行不接受签署提前支取利率与定期存款利率一致的同业存款,范围进一步扩大。央行等五部委5月17日下发127号文规范金融机构同业业务后,同业存款的需求相对减弱。在市场流动性充裕、经济基本面疲软的推动下,债券市场在上半年走出牛市行情,银行投资户的需求主要在中长端释放,10年国开债从年初5.83%迅速下行87bps至4.96%的水平。短端收益率也随之回落,半年末1年期国开金融债收益率4.28%,较年初的5.50%下行122bps。信用产品方面,短融收益率跟随基准利率下行,高信用等级之间的利差有所收窄,短融受到各种类型投资需求的青睐,1年期高评级的AAA级短融半年末收益率4.73%,较年初的6.28%下行155bps。

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。密切跟踪各项经济数据,及时分析市场资金面变化,把握投资时钟,适时调整投资策略和组合配置。组合持仓以短期利率债、不同期限的同业存款和交易所回购为主,合理管理现金流分布,保障组合充足流动性。上半年本组合债券配置控制合理仓位,逐步增加久期,在提高组合静态收益、提供流动性储备的同时,控制组合承担的利率风险。整体看,上半年本基金实现了安全性和流动性的目标,并抓住市场机遇,保持了平稳较好的投资业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实安心货币A的基金份额净值收益率为1.9478%,嘉实安心货币B的基金份额净值收益率为2.0691%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

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2014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,上半年美国和欧洲的整体经济复苏表现弱于预期,但外需仍保持稳定,美国的量化宽松政策接近尾声,欧洲央行可能实施新一轮量化宽松,由此带来的影响错综复杂;国内经济短期企稳,中期仍面临压力,房地产投资增速下滑仍将延续,基建投资仍然是对冲国内经济下行风险的主要力量,通胀仍将保持稳定,但潜在风险在增加;人民币汇率双向波动将继续维持。综合当前国内外整体经济和货币环境,预计央行将持续定向宽松的货币政策,短端通过公开市场操作,打造利率走廊,中长端用抵押补充贷款PSL打造中期政策利率。PSL一方面承担外汇占款减少后基础货币投放的任务,一方面传递央行的政策意图,引导实体利率下行。央行公开市场操作和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。从季节性因素看,3季度财政存款回笼规模较大,同时股票IPO开闸后将对资金面构成持续扰动。央行的抵押补充贷款、定向降准和银监会对贷存比的修订,将对商业银行信贷投放起到政策导向的作用,这对债券市场会构成压力。下半年预期货币基金的同业存款政策将面临较大调整,将对货币基金的运作带来复杂和深远影响,投资者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,平衡配置债券持仓、同业存款和交易所回购,谨慎控制组合利率风险,保持合理流动性资产配置,细致管理现金流,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、监察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十九(二)收益分配原则"2."每日分配、按月支付"。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,为投资者每日计算当日收益并分配,每月集中支付收益。4.本基金每日进行收益计算并分配,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1,223,082.29元,每日分配,每月支付,合计分配1,223,082.29元,B类份额已实现收益为12,790,270.94元,每日分配,每月支付,合计分配12,790,270.94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")在对嘉实安心货币市场基金(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:嘉实安心货币市场基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	211,108,509.71	340,485,605.41
结算备付金		9,575,000.00	3,795,238.11
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	300,473,292.45	59,970,048.43
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		300,473,292.45	59,970,048.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	1,206,000,000.00	930,000,000.00
应收证券清算款		295,113,605.65	166,210.37
应收利息	6.4.7.4	6,708,902.51	1,511,074.91
应收股利		-	-
应收申购款		313,045.29	456,388.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,029,292,355.61	1,336,384,566.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,500,000.00	58,644.00
应付管理人报酬		244,249.93	102,987.54
应付托管费		74,015.08	31,208.31
应付销售服务费		18,254.88	13,577.81
应付交易费用	6.4.7.6	3,712.33	4,018.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		1,135,552.77	734,902.26
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	187,372.33	369,000.00
负债合计		3,163,157.32	1,314,337.99
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	2,026,129,198.29	1,335,070,228.15
未分配利润	6.4.7.9	-	-
所有者权益合计		2,026,129,198.29	1,335,070,228.15
负债和所有者权益总计		2,029,292,355.61	1,336,384,566.14

注:报告截止日2014年6月30日,嘉实安心货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额53,446,789.61份;嘉实安心货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,972,682,408.68份。嘉实安心货币基金份额总额合计为2,026,129,198.29份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实安心货币市场基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		15,827,935.07	11,565,458.63
1.利息收入		15,394,935.63	10,905,192.89
其中:存款利息收入	6.4.7.10	4,262,787.18	3,130,318.55
债券利息收入		3,832,903.64	2,586,878.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,299,244.81	5,187,995.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益		432,999.44	660,265.74
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	432,999.44	660,265.74
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		-	-
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.12	-	-
减:二、费用		1,814,581.84	1,813,830.91
1.管理人报酬		1,137,090.45	1,096,609.60
2.托管费		344,572.83	332,305.88
3.销售服务费		113,553.56	160,715.08
4.交易费用	6.4.7.13	-	-
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.14	219,365.00	224,200.35
三、利润总额		14,013,353.23	9,751,627.72
减:所得税费用		-	-
四、净利润		14,013,353.23	9,751,627.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实安心货币市场基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	1,335,070,228.15	-	1,335,070,228.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,013,353.23	14,013,353.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	691,058,970.14	-	691,058,970.14
其中:1.基金申购款	4,470,617,781.26	-	4,470,617,781.26
2.基金赎回款	-3,779,558,811.12	-	-3,779,558,811.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-14,013,353.23	-14,013,353.23
五、期末所有者权益(基金净值)	2,026,129,198.29	-	2,026,129,198.29
项目	上年度可比期间 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)	2,394,420,733.03	-	2,394,420,733.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,751,627.72	9,751,627.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-685,197,259.82	-	-685,197,259.82
其中:1.基金申购款	4,373,936,722.19	-	4,373,936,722.19
2.基金赎回款	-5,059,133,982.01	-	-5,059,133,982.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-9,751,627.72	-9,751,627.72
五、期末所有者权益(基金净值)	1,709,223,473.21	-	1,709,223,473.21

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
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(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,137,090.45	1,096,609.60
其中:支付销售机构的客户维护费	34,008.72	79,158.58

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	344,572.83	332,305.88

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0.10%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×0.10%/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 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B	合计
嘉实基金管理有限公司	8,736.37	30,473.74	39,210.11
中国银行	15,337.93	66.99	15,404.92
合计	24,074.30	30,540.73	54,615.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B	合计
嘉实基金管理有限公司	11,420.29	23,866.53	35,286.82
中国银行	29,309.82	792.22	30,102.04
合计	40,730.11	24,658.75	65,388.86

注:(1)嘉实安心货币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×0.25%/当年天数。

(2)嘉实安心货币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×0.01%/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 2014年1月1日至2014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	-	20,143,635.34	-	-	-	-
上年度可比期间 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	10,315,671.10	338,688,861.46	200,000,000.00	11,344.93	-	-

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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
基金合同生效日(2011年12月28日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	300,632,909.46
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-300,632,909.46
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	嘉实安心货币A	嘉实安心货币B
基金合同生效日(2011年12月28日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	1,050,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	1,050,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	64.66%

注:嘉实安心货币B类,报告期间申购/买入总份额含红利再投资增加本基金管理人持有的本基金份额632,909.46份。

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

嘉实安心货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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
嘉实资本管理有限公司	20,234,650.81	1.03%	-	-

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	71,108,509.71	1,184,029.98	1,166,580,928.56	863,174.23

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(2014年6月30日)由中国银行保管的银行存款余额含定期存款50,000,000.00元,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1,120,522.91元。(3)上年度可比期间末(2013年6月30日),由中国银行保管的银行存款余额含定期存款50,000,000.00元,上年度可比期间(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含定期存款利息收入730,330.40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(2014年1月1日至2014年6月30日)及上年度可比期间(2013年1月1日至2013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(2014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(2014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(2014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(2014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	300,473,292.45	14.81
	其中:债券	300,473,292.45	14.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,206,000,000.00	59.43
	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	220,683,509.71	10.87
4	其他各项资产	302,135,553.45	14.89
	合计	2,029,292,355.61	100.00

7.2 债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。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	36
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过75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(%)
1	30天以内	75.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天