嘉实货币市场基金

【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	31,892,509,626.64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
报告期末下属分级基金的份额总额	18,405,859,526.32份	13,486,650,100.32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	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	嘉实货币A	嘉实货币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	394,884,490.36	437,163,484.25
本期利润	394,884,490.36	437,163,484.25
本期净值收益率	2.5879%	2.7094%
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	18,405,859,526.32	13,486,650,100.32
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	34.6804%	7.3624%

注:(1)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,投资者可申购嘉实货币B,同时根据基金份额分类规则予以升级或降级处理。(2)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。(3)嘉实货币A与嘉实货币B适用不同的销售服务费率。(4)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(5)自2014年6月16日起本基金收益分配从按月结转份额调整为按日结转份额。

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	0.4007%	0.0043%	0.0287%	0.0000%	0.3720%	0.0043%
过去三个月	1.2352%	0.0028%	0.0871%	0.0000%	1.1481%	0.0028%
过去六个月	2.5879%	0.0028%	0.1734%	0.0000%	2.4145%	0.0028%
过去一年	4.9689%	0.0029%	0.3500%	0.0000%	4.6189%	0.0029%
过去三年	13.5490%	0.0047%	1.2005%	0.0002%	12.3485%	0.0045%
自基金合同生效起至今	34.6804%	0.0084%	8.7870%	0.0022%	25.8934%	0.0062%

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	0.4206%	0.0043%	0.0287%	0.0000%	0.3919%	0.0043%
过去三个月	1.2952%	0.0028%	0.0871%	0.0000%	1.2081%	0.0028%
过去六个月	2.7094%	0.0028%	0.1734%	0.0000%	2.5360%	0.0028%
过去一年	5.2194%	0.0029%	0.3500%	0.0000%	4.8694%	0.0029%
自基金合同生效起至今	7.3624%	0.0036%	0.5385%	0.0000%	6.8239%	0.0036%

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

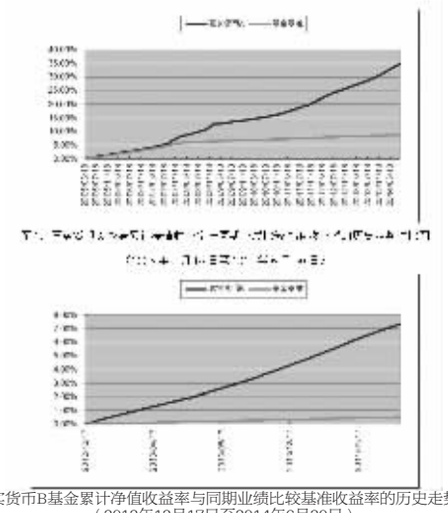

图2:嘉实货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年12月17日至2014年6月30日)

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	本基金基金经理、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、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	2009年1月16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、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

2014年上半年,资金面是货币市场的关键性主导因素。整体看上半年市场流动性保持中性偏宽松,只是在春节期间、5月企业所得税年度集中清缴、季末银行争夺存款等时点呈现短期阶段性紧张,但在央行的引导和调控下,资金成本的波动仍在可控范围内。数据显示年初外汇占款增加,1季度央行的货币政策重点集中在人民币汇率领域,扩大汇率波动区间,降低升值预期,在资金领域,虽然央行重启了正回购,但数量有限,市场流动性持续宽松。2季度央行公开市场通过回购、国库先进招标、央票到期等方式净投放资金3690亿,并且调控手段更具针对性和灵活性,期间两次定向下调存款准备金率,以切实增强金融对实体经济的支持。1季度和2季度银行间7天回购利率均值分别为4.17和3.35%,利率中枢明显下行。14年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,去年下半年持续走高的银行同业存款利率也大幅下降,3月央行又表示不再允许商业银行签署提前支取利率与定期存款利率一致的同业存款。市场流动性充裕、资金成本下降推动债券市场在上半年走出上涨行情,但是投资者基于对中长期政策和资金面仍存在担忧,需求主要集中在短端释放,收益率曲线陡峭化下行。6月末1年期国开金融债收益率4.28%,较年初的5.49%大幅下行121bps。信用产品方面,短融收益率跟随基准利率下行,整体信用息差收窄,但中高信用等级和较低信用等级债券之间的息差仍维持高位,原因是基于对今年信用风险的担忧,投资偏好向高等级和国企发行的信用债集中。2季末,1年期高评级的AAA级短融收益率年初的6.32%降至2季末的4.73%,中等评级的AA级短融收益率则由年初的7.06%降至2季末的5.29%。

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;灵活配置债券投资和同业存款,管理现金流分布,保障组合充足流动性;合理配置债券仓位,前期保持中性较短久期,后期判断市场情况适当增加久期。在实现组合较高静态收益的同时,组合也分享了债券市场上涨的估值收益。整体看,上半年本基金成功应对了市场和规模波动,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

本报告期嘉实货币A的基金份额净值收益率为2.5879%,嘉实货币B的基金份额净值收益率为2.7094%,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,下半年债券供给将增加,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,这对下半年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继续面临调整,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、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第二十节三、基金收益分配原则的约定及管理人2014年6月11日发布的《嘉实基金管理有限公司关于嘉实货币市场基金调整收益支付方式并相应修订基金合同部分条款的公告》:"1、每日将基金净收益分配给基金份额持有人,当日收益参与下一日的收益分配,并定期支付且结转为相应的基金份额;3、本基金每日收益计算并分配时,以人民币元方式簿记,收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式"(通常情况下,本基金的收益支付方式为按日支付,对于目前暂不支持按日支付的销售机构,仍保留按月支付的方式),本期A类份额已实现收益为394,884,490.36元,每日分配,定期支付,合计分配394,884,490.36元,B类份额已实现收益为437,163,484.25元,每日分配,定期支付,合计分配437,163,484.25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: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	14,936,160,610.34	18,136,677,015.53
结算备付金		51,771,500.00	8,571,428.57
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	20,284,685,610.31	9,903,422,339.57
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,284,685,610.31	9,903,422,339.57
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	2,150,000,000.00	3,235,858,588.78
应收证券清算款		600,438,596.72	-
应收利息	6.4.7.4	549,324,648.04	253,039,377.25
应收股利		-	-
应收申购款		151,323,929.60	1,684,541,176.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	150,000.00
资产总计		38,723,704,895.01	33,222,259,926.21
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		4,657,595,295.20	1,656,218,811.89
应付证券清算款		2,150,000,000.00	500,000,000.00
应付赎回款		2,574,051.42	3,763,388.25
应付管理人报酬		10,955,299.21	8,539,945.06
应付托管费		3,319,787.63	2,587,862.09
应付销售服务费		5,508,153.62	2,837,737.63
应付交易费用	6.4.7.6	206,076.97	126,441.43
应交税费		129,638.63	129,638.63
应付利息		759,247.19	143,034.79
应付利润		-	44,847,159.22
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	147,718.50	296,573.27
负债合计		6,831,195,268.37	2,219,490,592.26
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	31,892,509,626.64	31,002,769,333.95
未分配利润	6.4.7.9	-	-
所有者权益合计		31,892,509,626.64	31,002,769,333.95
负债和所有者权益总计		38,723,704,895.01	33,222,259,926.21

注:报告截止日2014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18,405,859,526.32份;嘉实货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额13,486,650,100.32份。嘉实货币基金份额总额合计为31,892,509,626.64份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实货币市场基金
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		963,357,625.32	642,057,991.79
1.利息收入		947,742,491.74	610,486,471.33
其中:存款利息收入	6.4.7.10	588,306,381.84	400,912,825.55
债券利息收入		334,889,832.74	189,445,453.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,546,277.16	20,128,192.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益		15,615,133.58	31,559,020.46
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,615,133.58	31,559,020.46
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	-	12,500.00
减:二、费用		131,309,650.71	106,947,014.15
1.管理人报酬		52,534,803.25	48,470,239.69
2.托管费		15,919,637.30	14,687,951.41
3.销售服务费		20,397,606.10	12,794,898.39
4.交易费用	6.4.7.13	-	-
5.利息支出		42,182,539.80	30,690,039.95
其中:卖出回购金融资产支出		42,182,539.80	30,690,039.95
6.其他费用	6.4.7.14	275,064.26	303,884.71
三、利润总额		832,047,974.61	535,110,977.64
减:所得税费用		-	-
四、净利润		832,047,974.61	535,110,977.64

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: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)	31,002,769,333.95	-	31,002,769,333.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	832,047,974.61	832,047,974.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	889,740,292.69	-	889,740,292.69
其中:1.基金申购款	78,821,622,889.68	-	78,821,622,889.68
2.基金赎回款	-77,931,882,596.99	-	-77,931,882,596.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-832,047,974.61	-832,047,974.61
五、期末所有者权益(基金净值)	31,892,509,626.64	-	31,892,509,626.64
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)	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

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
立信投资有限责任公司	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

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	52,534,803.25	48,470,239.69
其中:支付销售机构的客户维护费	9,119,499.26	5,487,796.24

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	15,919,637.30	14,687,951.41

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		
	嘉实货币A	嘉实货币B	合计
嘉实基金管理有限公司	2,201,532.81	669,707.76	2,871,240.57
中国银行	7,582,393.95	55,529.19	7,637,923.14
合计	9,783,926.76	725,236.95	10,509,163.71
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

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×0.25%/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×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	-	-	-	-	16,894,300,000.00	2,791,467.35
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	521,423,939.59	222,799,717.40	-	-	25,449,580,000.00	2,629,926.19

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	
	嘉实货币A	嘉实货币B
基金合同生效日(2005年3月18日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	103.18	190,880,337.42
期间申购/买入总份额	2.14	206,876,305.29
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-392,937,044.96
期末持有的基金份额	4,819,703.07	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.03%	0.00%

注:(1)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嘉实货币A类份额2.14份,B类份额6,876,305.29份。(2)2014年6月30日发生自动升降级调减本基金管理人持有的嘉实货币B类份额4,819,597.75份,同时调增本基金管理人持有的嘉实货币A类份额4,819,597.75份。

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

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 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	1,406,481.97	0.01%	1,370,631.13	0.01%
立信投资有限责任公司	-	-	3,973,467.61	0.03%

嘉实货币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
立信投资有限责任公司	28,681,700.72	0.21%	-	-

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	2,154,160,610.34	27,852.97	6,695,443.65	190,344.90

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),本基金无存于中国银行的定期存款,本期(2014年1月1日至2014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166,666.67;上期末(2013年6月30日)无存于中国银行的定期存款,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无定期存款利息收入。

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

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额4,657,595,295.20元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041456011	14穗地铁CP002	2014年7月4日	100.00	1,500,000	150,000,070.01
041456027	14开滦CP001	2014年7月4日	100.00	2,000,000	200,000,137.09
041466008	14淮南矿业CP002	2014年7月4日	99.92	2,500,000	249,795,129.54
041464033	14甘公投CP001