嘉实安心货币市场基金 2016年年度报告摘要

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:2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 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 2017 年 3 月 24 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 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	2,351,663,921.73 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	66,168,079.62 份	2,285,495,842.11 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,力求获得高于企业活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	胡秀秋	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年		2015年		2014年	
	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B	嘉实安心货币 A	嘉实安心货币 B
本期已实现收益	1,526,433.97	43,634,233.23	4,610,489.49	63,130,076.59	2,909,514.90	40,514,314.30
本期利润	1,526,433.97	43,634,233.23	4,610,489.49	63,130,076.59	2,909,514.90	40,514,314.30
本期净值收益率	2.1001%	2.3454%	2.7206%	2.9697%	3.8913%	4.1406%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	66,168,079.62	2,285,495,842.11	100,666,928.61	5,354,225,309.43	330,696,785.90	3,310,409,283.40
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
累计净值收益率	15.3810%	16.7799%	13.0078%	14.1038%	10.0150%	10.8133%

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

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
过去三个月	0.5690%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.2287%	0.0032%
过去六个月	1.0667%	0.0028%	0.6805%	0.0000%	0.3862%	0.0028%
过去一年	2.1001%	0.0025%	1.3537%	0.0000%	0.7464%	0.0025%
过去三年	8.9587%	0.0035%	4.0537%	0.0000%	4.9050%	0.0035%
过去五年	15.3543%	0.0034%	6.8215%	0.0001%	8.5328%	0.0033%
自基金合同生效起至今	15.3810%	0.0035%	6.8378%	0.0001%	8.5432%	0.0034%

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
过去三个月	0.6295%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.2892%	0.0032%
过去六个月	1.1885%	0.0028%	0.6805%	0.0000%	0.5080%	0.0028%
过去一年	2.3454%	0.0025%	1.3537%	0.0000%	0.9917%	0.0025%
过去三年	9.7479%	0.0035%	4.0537%	0.0000%	5.6942%	0.0035%
过去五年	16.7505%	0.0034%	6.8215%	0.0001%	9.9290%	0.0033%
自基金合同生效起至今	16.7799%	0.0035%	6.8378%	0.0001%	9.9421%	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

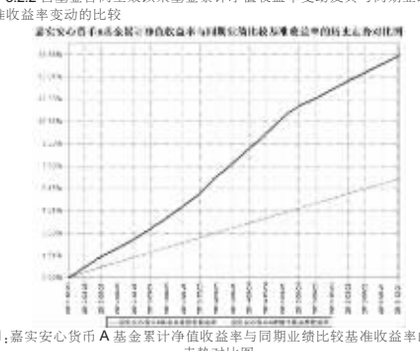


图 1:嘉实安心货币 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011 年 12 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日)

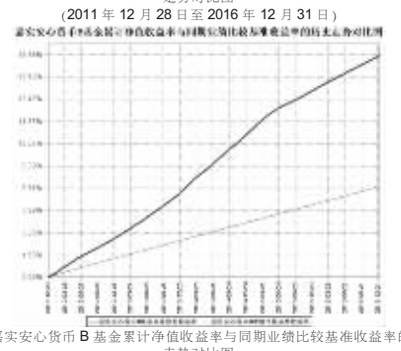
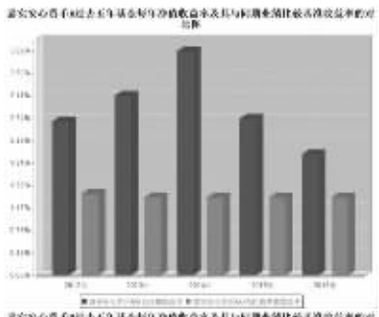


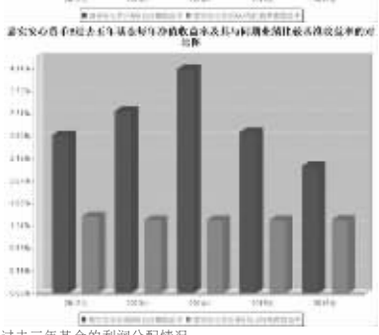
图 2:嘉实安心货币 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011 年 12 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日)

注 1: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。

注 2:2016 年 7 月 23 日,本基金管理人发布《关于嘉实安心货币基金经理变更的公告》,魏莉女士不再担任本基金基金经理职务,增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务,与基金经理张文玥女士、李曦先生共同管理本基金。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

嘉实安心货币 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	1,591,267.86	157,871.58	- 222,705.47	1,526,433.97	
2015	4,398,843.01	1,675,604.86	- 1,463,958.38	4,610,489.49	
2014	2,349,700.47	800,940.05	- 241,125.62	2,909,514.90	
合计	8,339,811.34	2,634,416.49	- 1,927,789.47	9,046,438.36	

单位:人民币元

嘉实安心货币 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	39,738,348.34	4,425,461.65	- 529,576.96	43,634,233.23	
2015	55,026,097.42	7,112,178.07	991,801.10	63,130,076.59	
2014	33,130,320.52	5,422,418.57	1,961,575.21	40,514,314.30	
合计	127,894,766.28	16,960,058.49	2,423,799.35	147,278,624.12	

§ 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 2016 年 12 月 31 日, 基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、111 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、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 300 ETF 联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、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)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、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 400 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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、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、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、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、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳奉债券、嘉实稳丰纯债债券、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、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、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、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、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。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		
张文玥	本基金,嘉实货币,嘉实宝A/B,嘉实理财宝 7 天债券,嘉实 1 个月理财债券,嘉实 3 个月理财债券,嘉实机构快线货币,嘉实现金宝货币,嘉实定期宝 6 个月理财债券基金经理	2014年 8 月 13 日	-	8年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及投资经理。2014 年 4 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期 alpha 策略组,硕士,具有基金从业资格。
李曦	本基金,嘉实货币,嘉实活期宝货币,理财宝 7 天债券,嘉实活钱包货币,嘉实机构快线货币,嘉实现金宝货币基金经理	2015年 5 月 14 日	-	7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期 alpha 策略组,硕士研究生,具有基金从业资格。
李金灿	本基金,嘉实货币,嘉实宝A/B,嘉实超短债债券,嘉实薪金宝货币,嘉实机构快线货币,嘉实理财宝 7 天债券,嘉实增益宝货币基金经理	2016年 7 月 23 日	-	7年	曾任 Futex Trading Ltd 期货交易员,北京首创期货有限责任公司研发员,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期 alpha 策略组。硕士研究生,CFA,具有基金从业资格。
魏莉	本基金,嘉实货币,嘉实超短债债券,嘉实薪金宝货币,嘉实机构快线货币,嘉实理财宝 7 个月理财债券,嘉实薪金宝货币基金经理	2013年 12 月 19 日	2016年 7 月 23 日	13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,中国籍。

注:(1)任职日期、离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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离, 任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则, 保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易, 严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素, 交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《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;对投资交易行为进行监察稽核,通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息,及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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

2016 年,前三季度央行主导下市场资金面保持宽松,但是四季度在央行主导下货币政策回归中性偏紧,货币市场收益率波动性加大,导致债券市场波动增加。宏观经济数据显示,2016 年整体经济增长压力较大,到四季度整体经济增长呈现底部企稳,但是结构性矛盾突出,供给侧改革和去产能过程收到明显成效,通胀有一定上升势头,房地产市场过热引发关注并遭到政策打压。国际形势动荡,外汇占款仍流出,美国大选结果和英国脱欧超预期,12 月美联储加息,美元指数和美债收益率攀升,人民币贬值压力增加。针对上述宏观经济环境,央行更加注重货币政策执行的前瞻性、针对性和灵活性,完善宏观审慎政策框架,根据经济和市场运行情况,运用公开市场操作和各类创新工具对市场资金面进行预调微调。但是,中央经济工作会议明确下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在首要位置,未来金融去杠杆过程仍将延续。

上半年央行维持货币政策放松操作,3 月降低存款准备金率 50bps,前三季公开市场货币净投放超过 14000 亿,并配合 SLO 和 MFL 等措施,调节市场流动性缺口,促进降低社会融资成本,支持实体经济发展。四季度央行公开市场净投放 3114 亿,但是央行通过 MLF 操作持续进行"锁短放长",调节市场流动性缺口的同时资金成本提升。四季度银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 2.29%和 2.81%,较前 3 季度均值 2.05%和 2.47%明显上行。

相较短端资金成本的稳定,二季度中长端债券收益率曾有阶段性上行,主要原因是 4 月以铁物资和东北特钢为代表的国企债券违约事件,引发市场对信用债全面谨慎,投资者赎回增加导致基金被迫卖出债券,流动性好的利率债也受到冲击,收益率曲线全线上行 30-50bps。但是后期信用违约面未进一步扩大,市场资金充裕,通货膨胀数据也低于预期,市场可投资标的有限,以银行理财为主的配置资金对债券仍有大量需求,债券牛市又持续到了三季度。四季度债券市场剧烈波动,收益率曲线全线上行。全年看来,整体回顾,2016 年债券市场先涨后跌,1 年期和 10 年期国开债收益率分别收于 3.18%和 3.68%,较上年末 2.40%和 3.13%大幅平坦化上行。2016 年信用债市场收益率基本跟随利率债市场波动,信用利差先压缩后扩宽。三季度之前在资金宽松和配置压力推动下,整体收益率下行,同时信用利差进一步压缩;四季度信用债市场在资金紧张、去杠杆和估值上行压力推动下,收益率也跟随利率债大幅上扬,信用利差跟随扩宽。整体看 2016 年末 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率收于 3.91%,同期中等评级的 AA+ 级短融收益率收于 4.17%,较上年末的 2.87%和 3.20%均大幅上行。并且 2016 年信用债市场进一步分化,因经济增长乏力、去过剩产能和债务重组压力增加、信贷不良率上升、信用事件爆发等原因,投资者更加谨慎地规避周期行业和民企等信用评级较差券种,这类券种收益率居高不下。

2016 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;灵活配置逆回购、银行存单、债券和回业存款,管理现金流分布,保障组合充足流动性;控制银行存单和债券资产配置比例,组合保持中性较短久期,在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险;谨慎筛选组合投资个券,严控信用风险;灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看,2016 年本基金成功应对了市场和规模波动,投资业绩平稳,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

本报告期嘉实安心货币 A 的基金份额净值收益率为 2.1001%, 嘉实安心货币 B 的基金份额净值收益率为 2.3454%,同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。

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 2017 年,宏观经济、货币政策和短期资金面仍是影响货币市场的主要因素。整体看,全球主要经济体增长形势和政策将继续分化。美国经济稳步复苏,美联储加息节奏和美元走势是影响市场的关键因素;特朗普就任后的政策存在多重不确定性,不仅会导致国际金融市场持续波动,还对全球经济增长格局带来长期深远影响;欧洲政治风险增加,但经济增长仍然乏力,但发达国家货币政策宽松到头,开始趋向于收缩央行资产负债表的态势比较明显;新兴经济体仍面临汇率贬值、资金外逃和经济萧条等多重挑战,国际资本流动不确定性进一步增加,预期主要货币汇率需要一段时间达成再平衡;由此带来的影响将错综复杂。而国内经济运行也面临多重问题和挑战,增长过程中的结构性失衡依然存在,需要继续深化供给侧改革。中央经济工作会议明确稳中求进工作总基调是治国理政的重要原则,下一步要将抑制资产泡沫和防范金融风险放在更加重要位置,货币政策要保持稳健中性,调节好货币闸门,维护流动性基本稳定。针对上述国内外经济形势和货币环境,预计 2017 年在央行的主导下,货币政策执行上由 2016 年相对宽松转为紧平衡,会更注重政策的前瞻性、针对性和灵活性,根据实体经济增长情况和市场变动,综合运用公开市场操作和各类创新工具进行调整和指导,以支持实体经济增长势头。2017 年整体金融市场去杠杆过程将延续,叠加外汇市场波动和人民币汇率贬值压力,市场资金面波动概率增加。央行公开市场操作、回购利率和各种定向或创新工具运用将是影响资金面、资金利率、和投资者政策预期的关键指标。2017 年受基数、天气原因和油价等因素影响,预期通胀有上行趋势。政府地方债置换计划继续实施,存量债券到期较多有续发需求,债市供给维持高位,股票市场继续推进改革,这些方面的政策投资者均要重点关注。

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、存单和债券投资,谨慎选择组合的信用券种持仓,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,每月基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"的内容,本期 A 类份额已实现收益为 1,526,433.97 元,每日分配,每月支付,合计分配 1,526,433.97 元,B 类份额已实现收益为 43,634,233.23 元,每日分配,每月支付,合计分配 43,634,233.23 元,符合本基金基金合同的约定。

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,完全忠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 审计报告

嘉实安心货币市场基金 2016 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师许康玮、张勇签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2017)第 20636 号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:嘉实安心货币市场基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	486,140,437.12	540,183,051.60
结算备付金		14,281,363.64	22,514,285.71
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	369,982,298.05	1,380,455,868.77
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		369,982,298.05	1,380,455,868.77
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,575,000,545.00	3,478,502,042.80
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	7,468,495.60	38,188,637.72
应收股利		-	-
应收申购款		510,006.00	1,420,375.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	40,000.00	65,000.00
资产总计		2,453,423,145.41	5,461,329,261.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		99,568,392.71	2,941,083.33
应付赎回款		100.00	52,059.75
应付管理人报酬		397,836.07	762,249.62
应付托管费		120,556.39	230,984.73
应付销售服务费		24,628.97	42,450.05
应付交易费用	7.4.7.7	7,797.40	16,001.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		1,230,912.14	1,983,194.57
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	409,000.00	409,000.00
负债合计		101,759,223.68	6,437,023.71
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,351,663,921.73	5,454,892,238.04
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,351,663,921.73	5,454,892,238.04
负债和所有者权益总计		2,453,423,145.41	5,461,329,261.75

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,嘉实安心货币 A 基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 66,168,079.62 份;嘉实安心货币 B 基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 2,285,495,842.11 份。嘉实安心货币基金份额总额合计为 2,351,663,921.73 份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实安心货币市场基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		54,475,371.29	79,163,847.35
1.利息收入		53,792,328.57	76,557,026.62
其中:存款利息收入	7.4.7.11	16,242,509.42	24,736,528.17
债券利息收入		19,673,560.98	18,472,037.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,876,258.17	33,348,460.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益		683,042.72	2,606,820.73
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	683,042.72	2,606,820.73
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	7.4.7.13	-	-
减:二、费用		9,314,704.09	11,423,281.27
1. 管理人报酬		6,474,625.78	7,890,917.40
2. 托管费		1,962,007.89	2,391,187.15
3. 销售服务费		372,744.20	623,709.19
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.15	505,326.22	517,467.53
三、利润总额		45,160,667.20	67,740,566.08
减:所得税费用		-	-
四、净利润		45,160,667.20	67,740,566.08

7.3 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:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	5,454,892,238.04	-	5,454,892,238.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,160,667.20	45,160,667.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 3,103,228,316.31	-	- 3,103,228,316.31
其中:1.基金申购款	7,230,995,812.35	-	7,230,995,812.35
2.基金赎回款	- 10,334,224,128.66	-	- 10,334,224,128.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 45,160,667.20	- 45,160,667.20
五、期末所有者权益(基金净值)	2,351,663,921.73	-	2,351,663,921.73
项目	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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)	3,641,106,069.30	-	3,641,106,069.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	67,740,566.08	67,740,566.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,813,786,168.74	-	1,813,786,168.74
其中:1.基金申购款	19,693,099,105.83	-	19,693,099,105.83
2.基金赎回款	- 17,879,312,937.09	-	- 17,879,312,937.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 67,740,566.08	- 67,740,566.08
五、期末所有者权益(基金净值)	5,454,892,238.04	-	5,454,892,238.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____赵学军_____ _____王红_____ _____常旭____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

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
中诚信托有限