

嘉实安心货币市场基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

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 2022 年 03 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|----------------------------------------------|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 其他指标..... | 11 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 11 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 16 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明..... | 16 |
| 4.10 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..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16 |
| 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..... | 17 |
| §6 审计报告 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 17 |
| §7 年度财务报表 | 19 |
| 7.1 资产负债表..... | 19 |
| 7.2 利润表..... | 20 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 21 |
| 7.4 报表附注..... | 23 |

| | |
|----------------------------------------------|-----------|
| §8 投资组合报告 | 47 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 47 |
| 8.2 债券回购融资情况..... | 47 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 47 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 | 48 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 48 |
| 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 49 |
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 | 49 |
| 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 | 50 |
| 8.9 投资组合报告附注..... | 50 |
| §9 基金份额持有人信息 | 51 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 51 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 52 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 52 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 52 |
| §10 开放式基金份额变动 | 53 |
| §11 重大事件揭示 | 53 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 53 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 53 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 54 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 54 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 54 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 54 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 54 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 62 |
| 11.9 其他重大事件..... | 62 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 63 |
| §13 备查文件目录 | 64 |
| 13.1 备查文件目录..... | 64 |
| 13.2 存放地点..... | 64 |
| 13.3 查阅方式..... | 64 |

§ 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 | 1,526,901,183.01 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 | 33,766,275.69 份 | 1,493,134,907.32 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 | <p>本基金主要投资策略包括：</p> <p>整体资产配置策略（根据宏观经济指标，决定组合的平均剩余期限（长/中/短）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。根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别。）</p> <p>类别资产配置策略（根据整体策略要求，决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。根据不同类别资产的流动性指标，决定类别资产的当期配置比率。根据不同类别资产的收益率水平、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。）</p> <p>明细资产配置策略（第一步筛选，根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标，决定是否纳入组合。第二步筛选，根据个别债券的收益率与剩余期限的配比，对照基金的收益要求决定是否纳入组合。第三步筛选，根据个别债券的流动性指标，决定投资总量。）</p> |
| 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 | 许俊 |
| | 联系电话 | (010)65215588 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | 400-600-8800 | 95566 | |
| 传真 | (010)65215588 | (010)66594942 | |
| 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单元 | 北京西城区复兴门内大街1号 | |
| 办公地址 | 北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层 | 北京西城区复兴门内大街1号 | |
| 邮政编码 | 100005 | 100818 | |
| 法定代表人 | 经雷 | 刘连舸 | |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 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 | 北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层嘉实基金管理有限公司 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼 |
| 注册登记机构 | 嘉实基金管理有限公司 | 北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层 |

§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 | 报告期（2021年1月1日 -2021年12月31日） | | 报告期（2020年1月1日 -2020年12月31日） | | 报告期（2019年1月1日 -2019年12月31日） | |
|----------------------------------|--------------------------------|-------------|--------------------------------|-------------|--------------------------------|-------------|
| | 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 | 768,521.26 | 29,810,909.92 | 840,027.05 | 19,300,097.68 | 1,827,614.06 | 36,925,305.86 |
| 本期利润 | 768,521.26 | 29,810,909.92 | 840,027.05 | 19,300,097.68 | 1,827,614.06 | 36,925,305.86 |
| 本期净值收益率 | 1.9046% | 2.1492% | 1.6762% | 1.9205% | 2.0468% | 2.2920% |
| 3.1 .2 期末数据和指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| 期末基金资产净值 | 33,766,275.69 | 1,493,134,907.32 | 40,907,666.75 | 1,574,971,755.48 | 64,999,922.54 | 1,361,604,227.14 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1 .3 | 2021 年末 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |

| | | | | | | |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| 累计期末指标 | | | | | | |
| 累计净值收益率 | 29.8657% | 33.0253% | 27.4386% | 30.2266% | 25.3378% | 27.7728% |

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）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

（3）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 | 0.4801% | 0.0007% | 0.3403% | 0.0000% | 0.1398% | 0.0007% |
| 过去六个月 | 0.9587% | 0.0014% | 0.6805% | 0.0000% | 0.2782% | 0.0014% |
| 过去一年 | 1.9046% | 0.0013% | 1.3500% | 0.0000% | 0.5546% | 0.0013% |
| 过去三年 | 5.7333% | 0.0018% | 4.0537% | 0.0000% | 1.6796% | 0.0018% |
| 过去五年 | 12.5539% | 0.0035% | 6.7537% | 0.0000% | 5.8002% | 0.0035% |

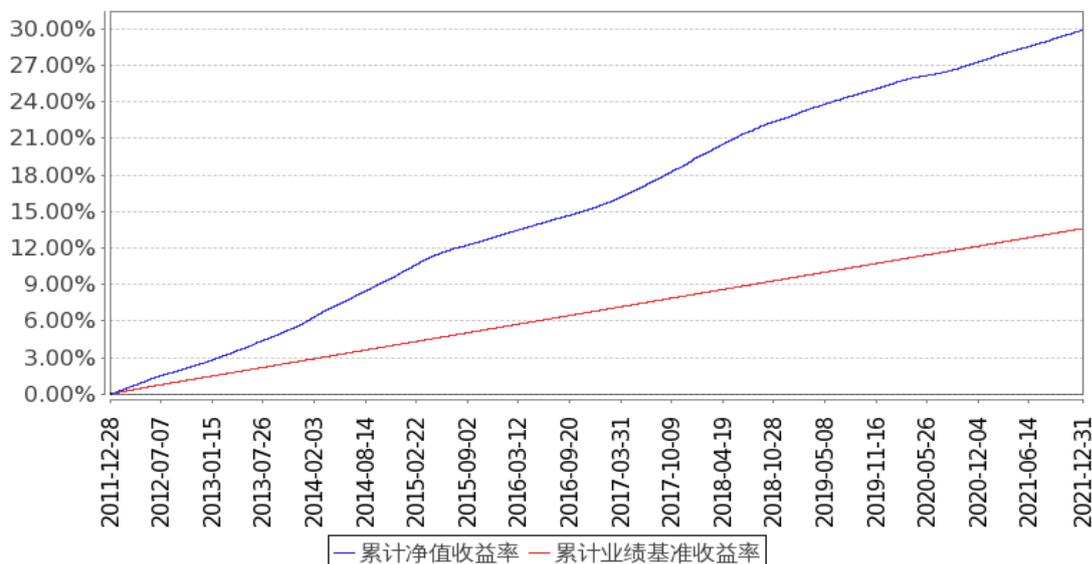
| | | | | | | |
|----------------|--------------|---------|----------|---------|--------------|-------------|
| 自基金合同生效起 至今 | 29.8657 % | 0.0036% | 13.5915% | 0.0001% | 16.274 2% | 0.0035 % |
|----------------|--------------|---------|----------|---------|--------------|-------------|

嘉实安心货币 B

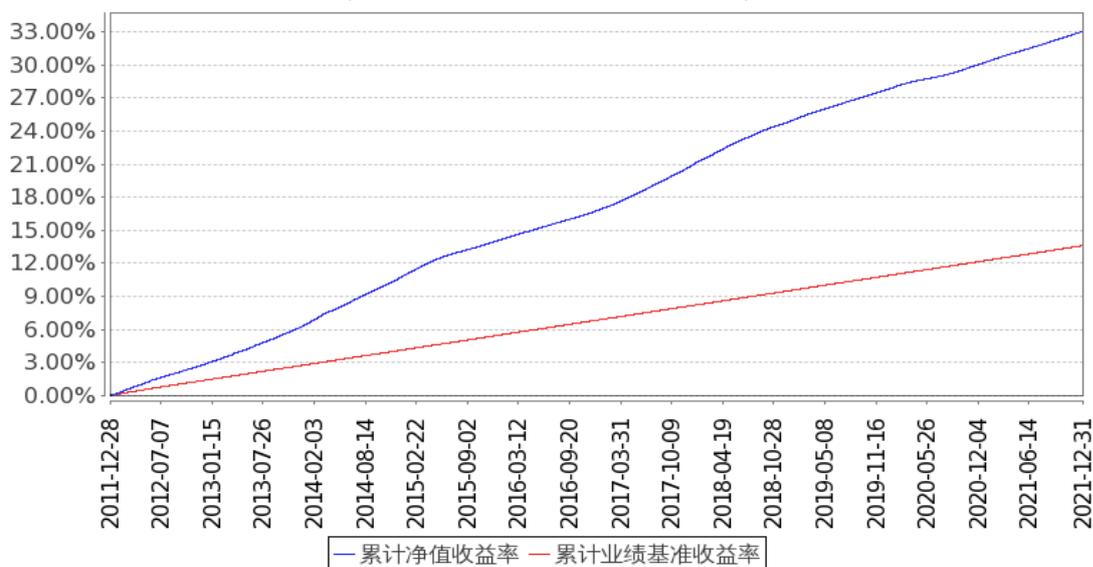
| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------------|-------------|
| 过去三个月 | 0.5410% | 0.0007% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2007 % | 0.0007 % |
| 过去六个月 | 1.0808% | 0.0014% | 0.6805% | 0.0000% | 0.4003 % | 0.0014 % |
| 过去一年 | 2.1492% | 0.0013% | 1.3500% | 0.0000% | 0.7992 % | 0.0013 % |
| 过去三年 | 6.4970% | 0.0018% | 4.0537% | 0.0000% | 2.4433 % | 0.0018 % |
| 过去五年 | 13.9113 % | 0.0035% | 6.7537% | 0.0000% | 7.1576 % | 0.0035 % |
| 自基金合同生效起 至今 | 33.0253 % | 0.0036% | 13.5915% | 0.0001% | 19.433 8% | 0.0035 % |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实安心货币A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2021年12月31日)



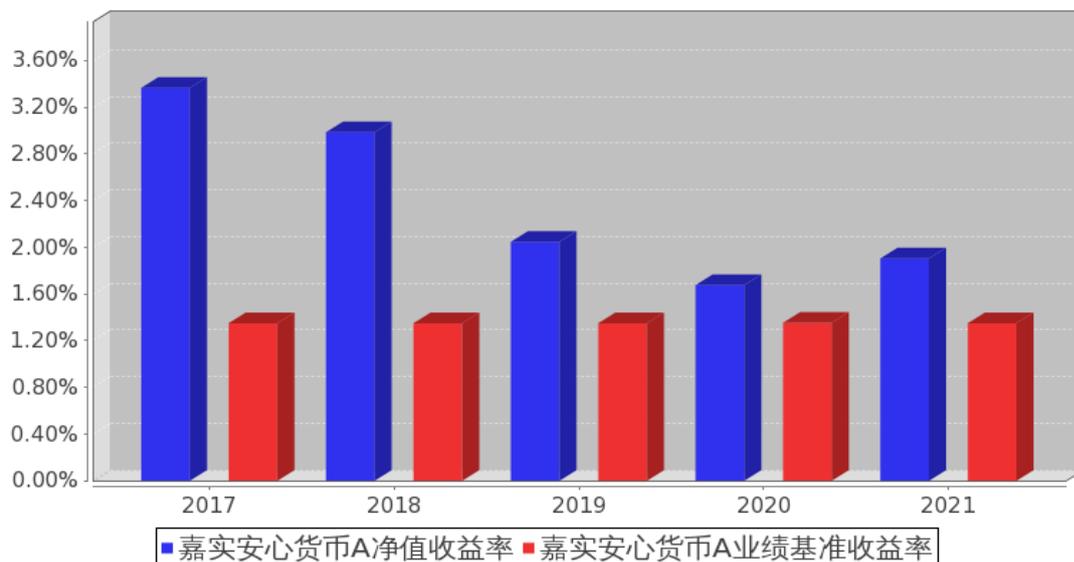
嘉实安心货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月28日至2021年12月31日)



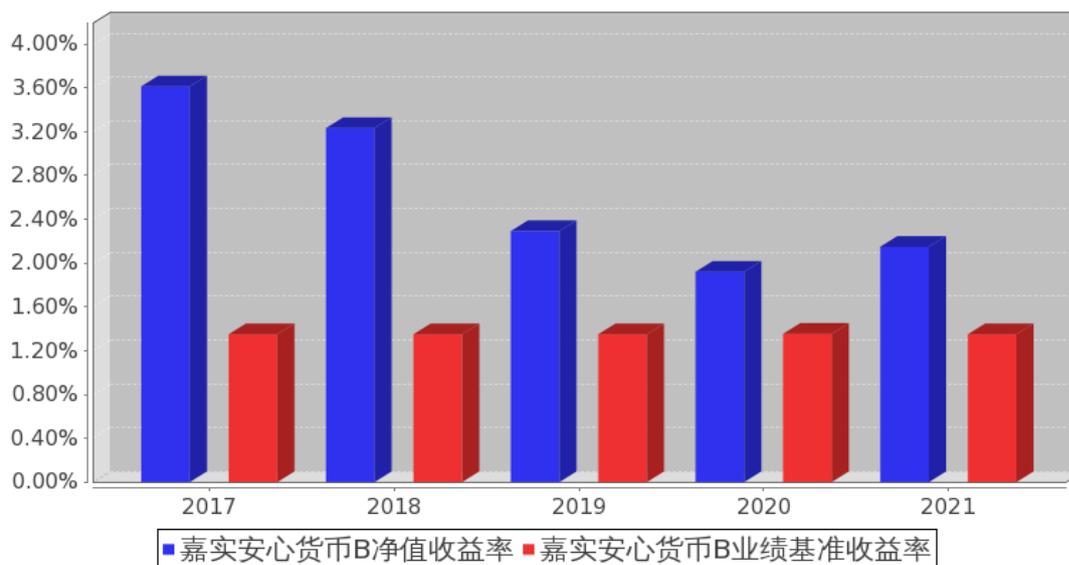
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年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基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实安心货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 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 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 2021 年 | 742,695.07 | 33,165.71 | -7,339.52 | 768,521.26 | - |
| 2020 年 | 820,864.49 | 28,846.94 | -9,684.38 | 840,027.05 | - |
| 2019 年 | 1,923,646.21 | 133,095.18 | -229,127.33 | 1,827,614.06 | - |
| 合计 | 3,487,205.77 | 195,107.83 | -246,151.23 | 3,436,162.37 | - |

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 |
|--------|------------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 2021 年 | 28,265,521.18 | 1,771,789.51 | -226,400.77 | 29,810,909.92 | - |
| 2020 年 | 17,776,229.83 | 1,368,106.14 | 155,761.71 | 19,300,097.68 | - |
| 2019 年 | 35,274,882.55 | 2,855,192.22 | -1,204,768.91 | 36,925,305.86 | - |
| 合计 | 81,316,633.56 | 5,995,087.87 | -1,275,407.97 | 86,036,313.46 | - |

§ 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

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，总部设在北京并设北京、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 和特定资产管理业务等资格。

截止 2021 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 258 只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF 等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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 | | |
| 徐珊 | 本基金、嘉实货币、嘉实薪金宝货币、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实精选平衡混合基金经理 | 2020 年 6 月 4 日 | - | 16 年 | 曾任职于中信银行股份有限公司，从事债券交易、同业负债及同业流动性管理工作，期间曾借调中国银行业监督管理委员会。2017 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，从事同业存款管理工作，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
| 张文玥 | 本基金、嘉实货币、嘉实活期宝货币、嘉实薪金宝货币、嘉实 3 个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实 | 2014 年 8 月 13 日 | 2021 年 8 月 12 日 | 13 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债券投资经理。2014 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |

| | | | | |
|------------------------------------|--|--|--|--|
| 现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实6个月理财债券、嘉实融享货币基金经理 | | | | |
|------------------------------------|--|--|--|--|

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《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合规守信情况的说明

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

2021 年，央行货币政策从 2020 年的“灵活适度，精准导向”变为“灵活精准，合理适度”，疫情后时代回归常态化的中性基调有所体现。

年初为缓解永煤事件冲击，央行进行了流动性呵护。春节前为了抑制国内股市和一线城市房地产过热，央行推动资金面边际迅速收紧，春节后流动性转松，回购利率围绕 2.2% 的中枢上下波动。2 季度出口保持强劲，国内经济持续恢复，央行货币政策维持中性，并继续向常态化回归。3 季度，地产投资增速逐步下降，消费恢复欠佳，经济边际走弱，央行货币政策转为中性偏宽松，并在 7 月全面降准支持经济，为地方专项债加速发行提供资金支持。7 月 15 号央行在存款准备金率下调 0.5 个百分点，释放资金近万亿，并维持 MLF 价格 2.95% 不变。同时维持 1 年和 5 年 LPR 利率水平分别维持在 3.85% 和 4.65% 不变。四季度央行宣布年内第 2 次降准，12 月 15 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点。释放资金 1.2 万亿左右，置换了 4500 亿到期的 MLF，并维持 MLF 价格 2.95% 不变。同时 12 月 20 号年内首次下调了 1 年 LPR 利率 3.85% 至 3.80%；5 年 LPR 利率保持 4.65% 不变。总的来看，全年货币政策保持了较强定力，发挥了灵活精准的特性，在维持资金利率中性的前提下，实现了定向宽信用的调控意图。

全年来看，短端资产价格呈现年初迅速大幅上行，2 月末 3 月初达到最高，最后逐季度下行的波动走势。以 1 年 AAA 同业银行存单价格为例，从年初的 2.70% 迅速上升至 2 月末的 3.10%，随之下行到半年末的 2.90%，在第一次降准后下探至低位 2.64%，三季度逐步回升至 10 月末的 2.80%，最后在 12 月第二次降准前下探到 2.65%，降准后反而年末冲高至 2.78%。

2021 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；灵活配置债券、同业存单和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制债券整体仓位。

整体看，2021 年本基金成功应对了市场波动，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

本报告期嘉实安心货币 A 的基金份额净值收益率为 1.9046%；嘉实安心货币 B 的基金份额净值收益率为 2.1492%；业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年初，央行下调 1 年 MLF 利率 10bps 到 2.85%，同时还下调了 OMO 的 7 天逆回购利率 2.20% 到 2.10%。1 年期 LPR 报价下降 10BP 至 3.70%，5 年期以上 LPR 下降 5BP 至 4.60%。货币政策短期内中性偏宽松，上半年预计易松难紧。市场对明年利率走势的普遍预期为前低后高。在美联储开始收紧政策背景下，要求稳健的货币政策灵活精准、合理适度，并进一步提出“以我为主”。预计偏积极的财政政策成为全年支撑经济的主要措施，货币政策将重新转向中性偏宽松支持财政政策，以缓解明年稳增长的压力。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，新产品新业务从战略规划到具体产品方案、业务模式，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差

错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表及调查、专题报告。

4.7 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验。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基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金每日收益计算并分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2022)第 23968 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 嘉实安心货币市场基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实安心货币市场基金(以下简称“嘉实安心货币基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实安心货币基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实安心货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 强调事项 | 无 |
| 其他事项 | 无 |
| 其他信息 | 无 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 嘉实安心货币基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业 |

| | |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实安心货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实安心货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实安心货币基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实安心货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实安心货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 薛竞 周祎 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道 |

| | |
|--------|------------------|
| | 中心 11 楼 |
| 审计报告日期 | 2022 年 03 月 25 日 |

§ 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 387,500,931.81 | 90,186,890.69 |
| 结算备付金 | | 21,188,181.82 | 22,982,857.14 |
| 存出保证金 | | 6,392.40 | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 588,743,183.57 | 878,112,899.28 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 588,743,183.57 | 878,112,899.28 |
| 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 | 523,900,000.00 | 620,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 242,646.56 | 2,114,361.64 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 6,436,669.02 | 3,750,033.99 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 26,195.98 | 200,253.70 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | 40,000.00 | 40,000.00 |
| 资产总计 | | 1,528,084,201.16 | 1,617,387,296.44 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 1,496.65 | - |
| 应付管理人报酬 | | 374,620.81 | 428,154.05 |
| 应付托管费 | | 113,521.48 | 129,743.65 |
| 应付销售服务费 | | 18,601.19 | 21,296.45 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 14,258.25 | 19,549.19 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费 | | 3,816.55 | 10,696.30 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 445,694.28 | 679,434.57 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 211,008.94 | 219,000.00 |
| 负债合计 | | 1,183,018.15 | 1,507,874.21 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,526,901,183.01 | 1,615,879,422.23 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,526,901,183.01 | 1,615,879,422.23 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,528,084,201.16 | 1,617,387,296.44 |

注：报告截止日 2021 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 33,766,275.69 份，嘉实安心货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,493,134,907.32 份，基金份额总额合计为 1,526,901,183.01 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实安心货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | 37,350,300.64 | 25,094,703.84 |
| 1. 利息收入 | | 36,541,976.75 | 24,810,228.68 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 8,019,119.80 | 1,625,499.23 |
| 债券利息收入 | | 15,562,417.94 | 14,204,429.60 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 12,960,439.01 | 8,980,299.85 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 808,323.89 | 284,475.16 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 808,323.89 | 284,475.16 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - | - |

| | | | |
|------------------------|----------|---------------|---------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | - | - |
| 减：二、费用 | | 6,770,869.46 | 4,954,579.11 |
| 1. 管理人报酬 | - | 4,760,404.48 | 3,392,085.84 |
| 2. 托管费 | - | 1,442,546.88 | 1,027,905.04 |
| 3. 销售服务费 | - | 242,029.10 | 223,872.74 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 11,432.94 | 4,882.66 |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 314,456.06 | 305,832.83 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 30,579,431.18 | 20,140,124.73 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 30,579,431.18 | 20,140,124.73 |

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：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021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） | 1,615,879,422.23 | - | 1,615,879,422.23 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 30,579,431.18 | 30,579,431.18 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -88,978,239.22 | - | -88,978,239.22 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,939,642,592.10 | - | 2,939,642,592.10 |
| 2. 基金赎回 | -3,028,620,831.32 | - | -3,028,620,831.32 |

| | | | |
|----------------------------------------|----------------------------------|----------------|-------------------|
| 回款 | | | |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -30,579,431.18 | -30,579,431.18 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,526,901,183.01 | - | 1,526,901,183.01 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020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） | 1,426,604,149.68 | - | 1,426,604,149.68 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 20,140,124.73 | 20,140,124.73 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 189,275,272.55 | - | 189,275,272.55 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,584,022,416.91 | - | 3,584,022,416.91 |
| 2. 基金赎回款 | -3,394,747,144.36 | - | -3,394,747,144.36 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -20,140,124.73 | -20,140,124.73 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,615,879,422.23 | - | 1,615,879,422.23 |

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：

经雷

梁凯

李袁

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 基金基本情况

嘉实安心货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1947号《关于核准嘉实安心货币市场基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实安心货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实安心货币市场基金基金合同》于2011年12月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,771,867,457.66份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实安心货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值

达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；“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。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；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。若投资者在每月累计收益支付时，累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。投资者可通过赎回基金份额获得收益；基金份额持有人在全部赎回其持有的本基金余额时，基金管理人自动将该基金份额持有人的未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回其持有的基金份额时，未付收益为正时，未付收益不进行支付；未付收益为负时，其剩余的基金份额需足以弥补其当前未付收益为负时的损益，否则将自动按比例结转当前未付收益，再进行赎回款项结算；当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；本基金同类每份基金份额享有同等分配权。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 9,500,931.81 | 186,890.69 |
| 定期存款 | 378,000,000.00 | 90,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - | 20,000,000.00 |
| 存款期限 3 个月以上 | 378,000,000.00 | 70,000,000.00 |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 387,500,931.81 | 90,186,890.69 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | | | |
|--------|--------------------------|----------------|----------------|------------|
| | 摊余成本 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | 588,743,183.57 | 589,042,500.00 | 299,316.43 |
| | 合计 | 588,743,183.57 | 589,042,500.00 | 299,316.43 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 合计 | 588,743,183.57 | 589,042,500.00 | 299,316.43 | 0.0196 |
| 项目 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | | | |

| | | 摊余成本 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
|--------|-------|----------------|----------------|------------|------------|
| 债券 | 交易所市场 | 10,054,353.10 | 10,005,000.00 | -49,353.10 | -0.0031 |
| | 银行间市场 | 868,058,546.18 | 868,774,000.00 | 715,453.82 | 0.0443 |
| | 合计 | 878,112,899.28 | 878,779,000.00 | 666,100.72 | 0.0412 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 878,112,899.28 | 878,779,000.00 | 666,100.72 | 0.0412 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | |
|-------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 523,900,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 523,900,000.00 | - |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 620,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 620,000,000.00 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 103.73 | 246.92 |
| 应收定期存款利息 | 3,178,510.27 | 252,266.58 |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 9,534.70 | 10,342.30 |
| 应收债券利息 | 3,420,231.65 | 3,532,174.16 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | -171,714.23 | -44,995.97 |
| 应收申购款利息 | - | - |

| | | |
|------------|--------------|--------------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 2.90 | - |
| 合计 | 6,436,669.02 | 3,750,033.99 |

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 其他应收款 | 40,000.00 | 40,000.00 |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | 40,000.00 | 40,000.00 |

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 14,258.25 | 19,549.19 |
| 合计 | 14,258.25 | 19,549.19 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 8.94 | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 211,000.00 | 219,000.00 |
| 合计 | 211,008.94 | 219,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实安心货币 A

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 40,907,666.75 | 40,907,666.75 |
| 本期申购 | 150,577,952.13 | 150,577,952.13 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -157,719,343.19 | -157,719,343.19 |
| -基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |

| | | |
|-----|---------------|---------------|
| 本期末 | 33,766,275.69 | 33,766,275.69 |
|-----|---------------|---------------|

嘉实安心货币 B

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,574,971,755.48 | 1,574,971,755.48 |
| 本期申购 | 2,789,064,639.97 | 2,789,064,639.97 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,870,901,488.13 | -2,870,901,488.13 |
| -基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,493,134,907.32 | 1,493,134,907.32 |

注:

申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

嘉实安心货币 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------|-------------|-------|-------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 768,521.26 | - | 768,521.26 |
| 本期基金份额 交易产生的变 动数 | - | - | - |
| 其中:基金申 购款 | - | - | - |
| 基金赎 回款 | - | - | - |
| 本期已分配利 润 | -768,521.26 | - | -768,521.26 |
| 本期末 | - | - | - |

嘉实安心货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 29,810,909.92 | - | 29,810,909.92 |
| 本期基金份额 交易产生的变 动数 | - | - | - |
| 其中:基金申 购款 | - | - | - |

| | | | |
|---------|----------------|---|----------------|
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -29,810,909.92 | - | -29,810,909.92 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 8,075.23 | 24,086.40 |
| 定期存款利息收入 | 7,591,095.91 | 1,410,403.26 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 419,886.87 | 191,009.57 |
| 其他 | 61.79 | - |
| 合计 | 8,019,119.80 | 1,625,499.23 |

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 808,323.89 | 284,475.16 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 808,323.89 | 284,475.16 |

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| | | |

| | | |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 4,179,276,761.80 | 3,835,984,124.82 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,149,982,277.27 | 3,817,285,946.44 |
| 减：应收利息总额 | 28,486,160.64 | 18,413,703.22 |
| 买卖债券差价收入 | 808,323.89 | 284,475.16 |

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 交易费用

无。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 审计费用 | 82,000.00 | 90,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行划款手续费 | 75,191.06 | 58,632.83 |
| 债券托管账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 其他 | 1,265.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 314,456.06 | 305,832.83 |

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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(“嘉实基金”) | 基金管理人 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人 |
| DWS Investments Singapore Limited | 基金管理人的股东 |
| 立信投资有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 中诚信托有限责任公司 | 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 |
| 嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”) | 基金管理人的控股子公司 |

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12 月31日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,760,404.48 | 3,392,085.84 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 28,965.03 | 55,511.74 |

注：1. 支付基金管理人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。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12 月31日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,442,546.88 | 1,027,905.04 |

注：支付基金托管人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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|
| | |

| 方名称 | 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 | 27,668.95 | 140,180.80 | 167,849.75 |
| 中国银行 | 12,535.05 | - | 12,535.05 |
| 嘉实财富 | - | - | - |
| 合计 | 40,204.00 | 140,180.80 | 180,384.80 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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 | 30,385.36 | 95,850.82 | 126,236.18 |
| 中国银行 | 20,127.83 | - | 20,127.83 |
| 嘉实财富 | 185.98 | - | 185.98 |
| 合计 | 50,699.17 | 95,850.82 | 146,549.99 |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，每日计提，逐日累计至每月月末，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。其计算公式为：各类别基金份额日销售服务费=各类别基金份额前一日基金资产净值×各类别基金份额适用的销售服务费率/当年天数。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；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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 本期 |
|----|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
| | 嘉实安心货币 A | 嘉实安心货币 B |

| | | |
|---------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额 | - | 30,000,000.00 |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | 688,445,235.25 |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | 280,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 438,445,235.25 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 29.36% |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| | 嘉实安心货币 A | 嘉实安心货币 B |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 200,000,000.00 |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | 530,000,000.00 |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | 700,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 30,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 1.90% |

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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 2021年1月1日至2021年12月31日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司_活期 | 9,500,931.81 | 8,075.23 | 186,890.69 | 24,086.40 |
| 中国银行股份有限公司_定期 | 128,000,000.00 | 3,525,035.25 | 20,000,000.00 | 1,013,739.50 |

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 嘉实安心货币 A | | | | |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 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 | 本期利润分配合计 | 备注 |
| 742,695.07 | 33,165.71 | -7,339.52 | 768,521.26 | - |
| 嘉实安心货币 B | | | | |
| 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 | 本期利润分配合计 | 备注 |
| 28,265,521.18 | 1,771,789.51 | -226,400.77 | 29,810,909.92 | - |

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 19,985,306.40 | 219,981,727.56 |
| 合计 | 19,985,306.40 | 219,981,727.56 |

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 39,221,357.69 | 30,259,951.26 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 39,221,357.69 | 30,259,951.26 |

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 427,453,628.18 | 508,049,609.71 |

| | | |
|--------|-------------------|-------------------|
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 427, 453, 628. 18 | 508, 049, 609. 71 |

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)以及根据份额持有人集中度情况调整投资组合的方式来实现。

本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 75 天，平均剩余存续期不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年12月31日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 不计息 | 合计 |
|--------------------|----------------|---------------|------|--------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 342,500,931.81 | 45,000,000.00 | - | - | 387,500,931.81 |
| 结算备付金 | 21,188,181.82 | - | - | - | 21,188,181.82 |
| 存出保证金 | 6,392.40 | - | - | - | 6,392.40 |
| 交易性金融资产 | 559,232,035.90 | 29,511,147.67 | - | - | 588,743,183.57 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 523,900,000.00 | - | - | - | 523,900,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 242,646.56 | 242,646.56 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,436,669.02 | 6,436,669.02 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 26,195.98 | 26,195.98 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 40,000.00 | 40,000.00 |
| 资产总计 | 1,446,827,541. | 74,511,147.67 | - | 6,745,511.56 | 1,528,084,201.16 |

| | | | | | |
|---------------------|------------------|---------------|------|--------------|------------------|
| | 93 | | | | |
| 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 | - | - | - | 1,496.65 | 1,496.65 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 374,620.81 | 374,620.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | 113,521.48 | 113,521.48 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 18,601.19 | 18,601.19 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 14,258.25 | 14,258.25 |
| 应付税费 | - | - | - | 3,816.55 | 3,816.55 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | 445,694.28 | 445,694.28 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 211,008.94 | 211,008.94 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,183,018.15 | 1,183,018.15 |
| 利率敏感度缺口 | 1,446,827,541.93 | 74,511,147.67 | - | 5,562,493.41 | 1,526,901,183.01 |
| 上年度末 2020年12月31日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 90,186,890.69 | - | - | - | 90,186,890.69 |
| 结算备付金 | 22,982,857.14 | - | - | - | 22,982,857.14 |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 868,023,379.07 | 10,089,520.21 | - | - | 878,112,899.28 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 620,000,000.00 | - | - | - | 620,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 2,114,361.64 | 2,114,361.64 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,750,033.99 | 3,750,033.99 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 200,253.70 | 200,253.70 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 40,000.00 | 40,000.00 |
| 资产总计 | 1,601,193,126.90 | 10,089,520.21 | - | 6,104,649.33 | 1,617,387,296.44 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 428,154.05 | 428,154.05 |
| 应付托管费 | - | - | - | 129,743.65 | 129,743.65 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 21,296.45 | 21,296.45 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 19,549.19 | 19,549.19 |
| 应付税费 | - | - | - | 10,696.30 | 10,696.30 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | 679,434.57 | 679,434.57 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 219,000.00 | 219,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,507,874.21 | 1,507,874.21 |
| 利率敏感度缺口 | 1,601,193,126.90 | 10,089,520.21 | - | 4,596,775.12 | 1,615,879,422.23 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2021年12月31日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 5% | - | - |
| | 业绩比较基准下降 5% | - | - |

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 588,743,183.57 元，无属于第三层次的余额。（上年度末：无属于第一层次的余额，第二层次 878,112,899.28 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金报告期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 588,743,183.57 | 38.53 |
| | 其中：债券 | 588,743,183.57 | 38.53 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 523,900,000.00 | 34.28 |
| | 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 | 408,689,113.63 | 26.75 |
| 4 | 其他各项资产 | 6,751,903.96 | 0.44 |
| 5 | 合计 | 1,528,084,201.16 | 100.00 |

8.2 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。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 58 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 23 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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。

8.3.2 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 | 49.37 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 17.00 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 8.10 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 9.16 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 16.02 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.65 | - |

8.4 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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 9,990,380.97 | 0.65 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 92,092,510.33 | 6.03 |
| | 其中：政策性金融债 | 92,092,510.33 | 6.03 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 19,985,306.40 | 1.31 |
| 6 | 中期票据 | 39,221,357.69 | 2.57 |
| 7 | 同业存单 | 427,453,628.18 | 27.99 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 588,743,183.57 | 38.56 |

| | | | |
|----|----------------------|---|---|
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |
|----|----------------------|---|---|

注：上表中，附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投资成本和内在应收利息。

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 112106011 | 21 交通银行 CD011 | 500,000 | 49,906,252.28 | 3.27 |
| 2 | 112103011 | 21 农业银行 CD011 | 500,000 | 49,812,216.53 | 3.26 |
| 3 | 112105108 | 21 建设银行 CD108 | 500,000 | 49,497,059.53 | 3.24 |
| 4 | 190202 | 19 国开 02 | 300,000 | 30,009,909.48 | 1.97 |
| 5 | 112105027 | 21 建设银行 CD027 | 300,000 | 29,889,757.19 | 1.96 |
| 6 | 101900117 | 19 宝钢 MTN001 | 290,000 | 29,176,095.87 | 1.91 |
| 7 | 190403 | 19 农发 03 | 220,000 | 22,038,139.53 | 1.44 |
| 8 | 120206 | 12 国开 06 | 200,000 | 19,999,243.78 | 1.31 |
| 9 | 112171476 | 21 三井住友银行 CD017 | 200,000 | 19,972,149.90 | 1.31 |
| 10 | 112103007 | 21 农业银行 CD007 | 200,000 | 19,966,802.05 | 1.31 |

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0480% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0154% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0241% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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。

8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的情形

(1) 2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】67 号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规事实，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 4880 万元。

2021 年 7 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）28 号），对交通银行股份有限公司理财业务和同业业务制度不健全等违法违规事实，于 2021 年 7 月 13 日作出行政处罚决定，罚款 4100 万元。

2021 年 1 月 29 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）1 号），对中国农业银行股份有限公司发生重要信息系统突发事件未报告等违法违规行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，于 2021 年 1 月 19 日作出行政处罚决定，罚款 420 万元。2021 年 12 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）38 号），对中国农业银行股份有限公司因农业银行制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权等行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，于 2021 年 12 月 8 日作出行政处罚决定，罚款 150 万元。

本基金投资于“12 国开 06（120206）”、“19 国开 02（190202）”、“21 交通银行 CD011（112106011）”、“21 农业银行 CD007（112103007）”、“21 农业银行 CD011（112103011）”的决策程序说明：基于对 12 国开 06、19 国开 02、21 交通银行 CD011、21 农业银行 CD007、21 农业银行

CD011 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“12 国开 06”、“19 国开 02”、“21 交通银行 CD011”、“21 农业银行 CD007”、“21 农业银行 CD011”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他五名证券发行主体无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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,392.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | 242,646.56 |
| 3 | 应收利息 | 6,436,669.02 |
| 4 | 应收申购款 | 26,195.98 |
| 5 | 其他应收款 | 40,000.00 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,751,903.96 |

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|----------|----------------|------------------|-----------|---------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 嘉实安心货币 A | 4,535 | 7,445.71 | 3,422,125.39 | 10.13 | 30,344,150.30 | 89.87 |
| 嘉实安心 | 11 | 135,739,537.03 | 1,493,134,907.32 | 100.00 | - | - |

| | | | | | | |
|------|-------|------------|------------------|-------|---------------|------|
| 货币 B | | | | | | |
| 合计 | 4,546 | 335,877.95 | 1,496,557,032.71 | 98.01 | 30,344,150.30 | 1.99 |

注：(1)嘉实安心货币 A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实安心货币 A 份额占嘉实安心货币 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实安心货币 A 份额占嘉实安心货币 A 总份额比例；

(2)嘉实安心货币 B:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实安心货币 B 份额占嘉实安心货币 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实安心货币 B 份额占嘉实安心货币 B 总份额比例。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份） | 占总份额比例（%） |
|----|-------|----------------|-----------|
| 1 | 基金类机构 | 438,445,235.25 | 28.71 |
| 2 | 其他机构 | 400,303,761.43 | 26.22 |
| 3 | 其他机构 | 183,915,389.24 | 12.05 |
| 4 | 其他机构 | 167,703,948.18 | 10.98 |
| 5 | 保险类机构 | 91,168,661.13 | 5.97 |
| 6 | 保险类机构 | 56,585,221.38 | 3.71 |
| 7 | 保险类机构 | 51,587,312.79 | 3.38 |
| 8 | 基金类机构 | 50,257,330.82 | 3.29 |
| 9 | 其他机构 | 30,920,996.51 | 2.03 |
| 10 | 其他机构 | 11,637,751.45 | 0.76 |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|----------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 嘉实安心货币 A | 1,505.25 | 0.00 |
| | 嘉实安心货币 B | - | - |
| | 合计 | 1,505.25 | 0.00 |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 嘉实安心货币 A | 0 |
| | 嘉实安心货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

| | | |
|---------------------|----------|---|
| 本基金基金经理持有 本开放式基金 | 嘉实安心货币 A | 0 |
| | 嘉实安心货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 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) 基金份额总额 | 343,887,031.85 | 1,427,980,425.81 |
| 本报告期期初基金份 额总额 | 40,907,666.75 | 1,574,971,755.48 |
| 本报告期基金总申购 份额 | 150,577,952.13 | 2,789,064,639.97 |
| 减: 本报告期基金总 赎回份额 | 157,719,343.19 | 2,870,901,488.13 |
| 本报告期基金拆分变 动份额 (份额减少以 “-” 填列) | - | - |
| 本报告期末基金份 额总额 | 33,766,275.69 | 1,493,134,907.32 |

注: 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升级调增份额, 总赎回份额含转换出及基金份额自动降级调减份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2021 年 5 月 29 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》, 杨竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

2021 年 7 月 23 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》, 龚康先生任公司副总经理。

2021 年 8 月 12 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》, 张文玥女士不再担任本基金基金经理职务, 本基金由徐珊女士单独管理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 82,000.00 元，该审计机构已连续 10 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 安信证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 东北证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---------------------|---|---|---|---|---|---|
| 华创证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 华西证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 联储证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证 券有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 股份有限公 司 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 信达证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 野村东方国 际证券有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国中金财 富证券有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券有 限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | 4 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|----|---|---|---|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 10 | - | - | - | - | - |
| 中信证券华南股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 华宝证券有限责任公司更名为华宝证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国元证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：东方证券股份有限公司新增交易单元 1 个，海通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，联储证券有限责任公司新增交易单元 2 个，信达证券股份有限公司新增交易单元 2 个，野村东方国际证券有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 3 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 北京高华 证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 股份有限 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---------------|---------|-------------------|---------|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 65,059,300.00 | 100.00% | 60,038,400,000.00 | 100.00% | - | - |
| 华西证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 联储证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限 公司 | | | | | | |
| 湘财证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证 券股份有 限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方 国际证券 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际 金融股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金 财富证券 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 股份有限 公司 | | | | | | |
| 中信证券 华南股份 有限公司 | | | | | | |
| 中银国际 证券股份 有限公司 | | | | | | |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

11.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|-----------------------------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1 | 嘉实基金管理有限公司关闭跨 TA 转换业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 1 月 21 日 |
| 2 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 1 号） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 1 月 25 日 |
| 3 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 2 号） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 2 月 25 日 |
| 4 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 3 号） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 25 日 |
| 5 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 4 号） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 4 月 26 日 |
| 6 | 嘉实基金管理有限公司关于终止凤凰金信（银川）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 5 月 7 日 |
| 7 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 5 号） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 5 月 25 日 |
| 8 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 5 月 29 日 |
| 9 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 6 号） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 6 月 25 日 |
| 10 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 7 月 23 日 |
| 11 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付 | 证券时报、基金管理人 | 2021 年 7 月 26 日 |

| | | | |
|----|-----------------------------------------------------|------------------------------------|------------------|
| | 的公告（2021 年第 7 号） | 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | |
| 12 | 关于嘉实安心货币基金经理变更的公告 | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 8 月 12 日 |
| 13 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 8 号） | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 8 月 25 日 |
| 14 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付的公告（2021 年第 9 号） | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 9 月 27 日 |
| 15 | 嘉实基金管理有限公司关于继续在网 上直销开展基金认购、申购、转换费 率优惠活动的公告 | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 9 月 28 日 |
| 16 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付 的公告（2021 年第 10 号） | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 10 月 25 日 |
| 17 | 嘉实基金管理有限公司关于旗下部分 公募基金参与北京证券交易所股票投 资及相关风险提示的公告 | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 11 月 16 日 |
| 18 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付 的公告（2021 年第 11 号） | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 11 月 25 日 |
| 19 | 嘉实基金管理有限公司关于对中国邮 政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直 销电子支付业务的公告 | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 12 月 3 日 |
| 20 | 嘉实基金管理有限公司关于对中信银 行借记卡持卡人开通网上直销电子支 付业务的公告 | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 12 月 3 日 |
| 21 | 嘉实基金管理有限公司关于提醒投资 者持续完善客户身份信息的公告 | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 12 月 24 日 |
| 22 | 关于嘉实安心货币市场基金收益支付 的公告（2021 年第 12 号） | 证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站 | 2021 年 12 月 27 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资 者类 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情 况 |
|----------|----------------|----------------|
|----------|----------------|----------------|

| 别 | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|----------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------|
| 机构 | 1 | 2021-09-24 至 2021-12-31 | 30,000,000.00 | 688,445,235.25 | 280,000,000.00 | 438,445,235.25 | 28.71 |
| | 2 | 2021-12-31 至 2021-12-31 | - | 400,303,761.43 | - | 400,303,761.43 | 26.22 |
| | 3 | 2021-01-01 至 2021-09-23 | 660,673,913.07 | 9,175,726.37 | 669,849,639.44 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> | | | | | | | |

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实安心货币市场基金募集的文件；
- (2) 《嘉实安心货币市场基金基金合同》；
- (3) 《嘉实安心货币市场基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实安心货币市场基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实安心货币市场基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日