

中金现金管家货币市场基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 35 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 36 |
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 36 |
| 7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细..... | 37 |
| 7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 37 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 37 |
| 7.8 投资组合报告附注..... | 38 |
| §8 基金份额持有人信息 | 38 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 38 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 8.3 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的情况..... | 39 |
| §9 开放式基金份额变动 | 39 |

| | |
|---------------------------------------|-----------|
| §10 重大事件揭示 | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 10.2 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..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 40 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 41 |
| 10.9 其他重大事件..... | 41 |
| §11 备查文件目录 | 43 |
| 11.1 备查文件目录..... | 43 |
| 11.2 存放地点..... | 43 |
| 11.3 查阅方式..... | 43 |

§2

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称 | 中金现金管家货币市场基金 | |
| 基金简称 | 中金现金管家 | |
| 基金主代码 | 000882 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 11 月 28 日 | |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,439,973,717.47 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 中金现金管家 A 类 | 中金现金管家 B 类 |
| 下属分级基金的交易代码: | 000882 | 000883 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,147,179.45 份 | 1,423,826,538.02 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在保障基金资产安全性和流动性的前提下，通过积极主动管理，力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 根据对宏观经济指标、货币政策、市场结构变化等因素的研究与分析，对未来一段时期短期市场利率进行判断，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金资产的配置策略。 |
| 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，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |

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 | | 中金基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杜季柳 | 田青 |
| | 联系电话 | 010-63211122 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ciccfund.com | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | (86) 400-868-1166 | 010-67595096 |
| 传真 | | (86) 010-66159121 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心 |

| | | |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码 | 100032 | 100033 |
| 法定代表人 | 林寿康 | 王洪章 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ciccfund.com/ |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 中金基金管理有限公司 | 北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层 |

§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 | 中金现金管家 A 类 | 中金现金管家 B 类 |
|---------------|---|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 502,670.32 | 8,521,768.49 |
| 本期利润 | 502,670.32 | 8,521,768.49 |
| 本期净值收益率 | 1.8639% | 1.9853% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日) | |
| 期末基金资产净值 | 16,147,179.45 | 1,423,826,538.02 |
| 期末基金份额净值 | 1.000 | 1.000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日) | |
| 累计净值收益率 | 2.2596% | 2.4028% |

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，由于货币市场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、本基金收益分配按日结转份额。

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

中金现金管家 A 类

| 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 | 0.1560% | 0.0005% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0450% | 0.0005% |
| 过去三个月 | 0.7715% | 0.0077% | 0.3366% | 0.0000% | 0.4349% | 0.0077% |
| 过去六个月 | 1.8639% | 0.0087% | 0.6695% | 0.0000% | 1.1944% | 0.0087% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.2596% | 0.0082% | 0.7952% | 0.0000% | 1.4644% | 0.0082% |

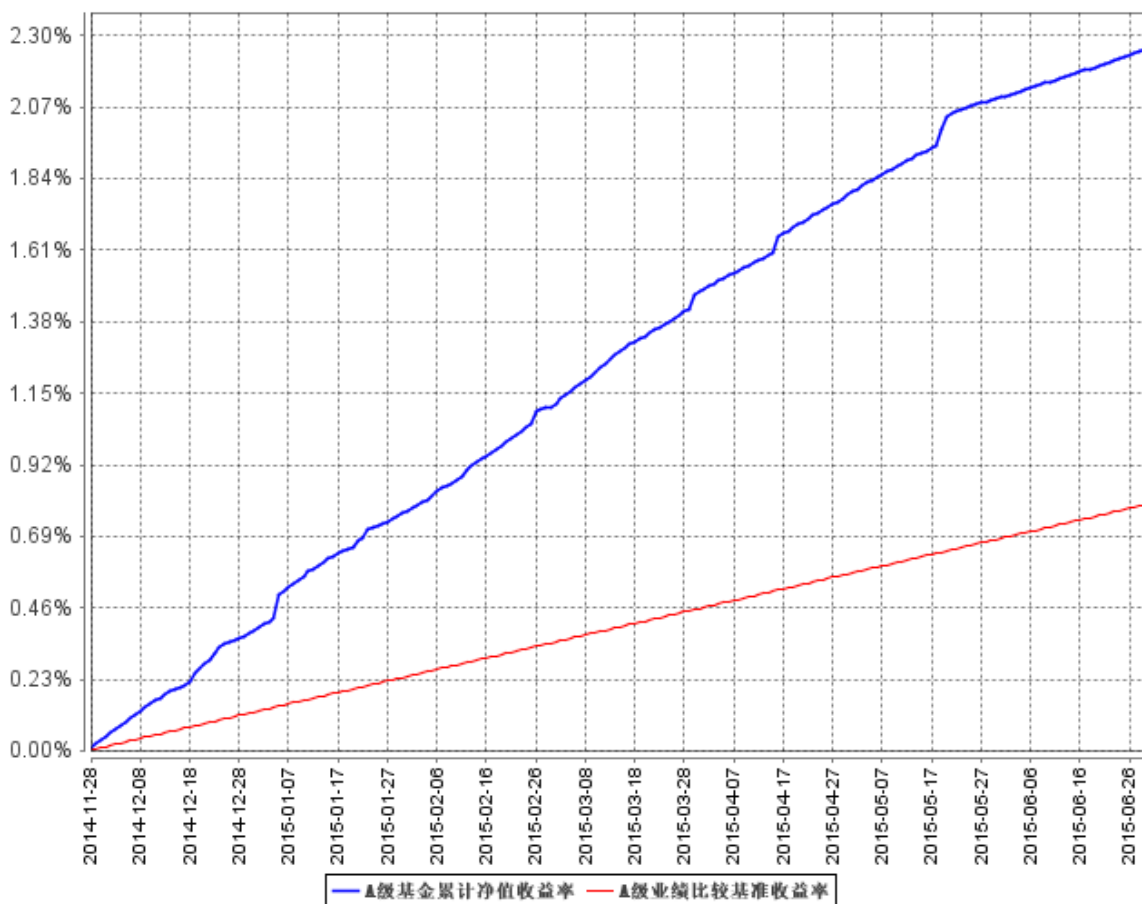
中金现金管家 B 类

| 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 | 0.1760% | 0.0005% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0650% | 0.0005% |
| 过去三个月 | 0.8324% | 0.0077% | 0.3366% | 0.0000% | 0.4958% | 0.0077% |
| 过去六个月 | 1.9853% | 0.0087% | 0.6695% | 0.0000% | 1.3158% | 0.0087% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.4028% | 0.0082% | 0.7952% | 0.0000% | 1.6076% | 0.0082% |

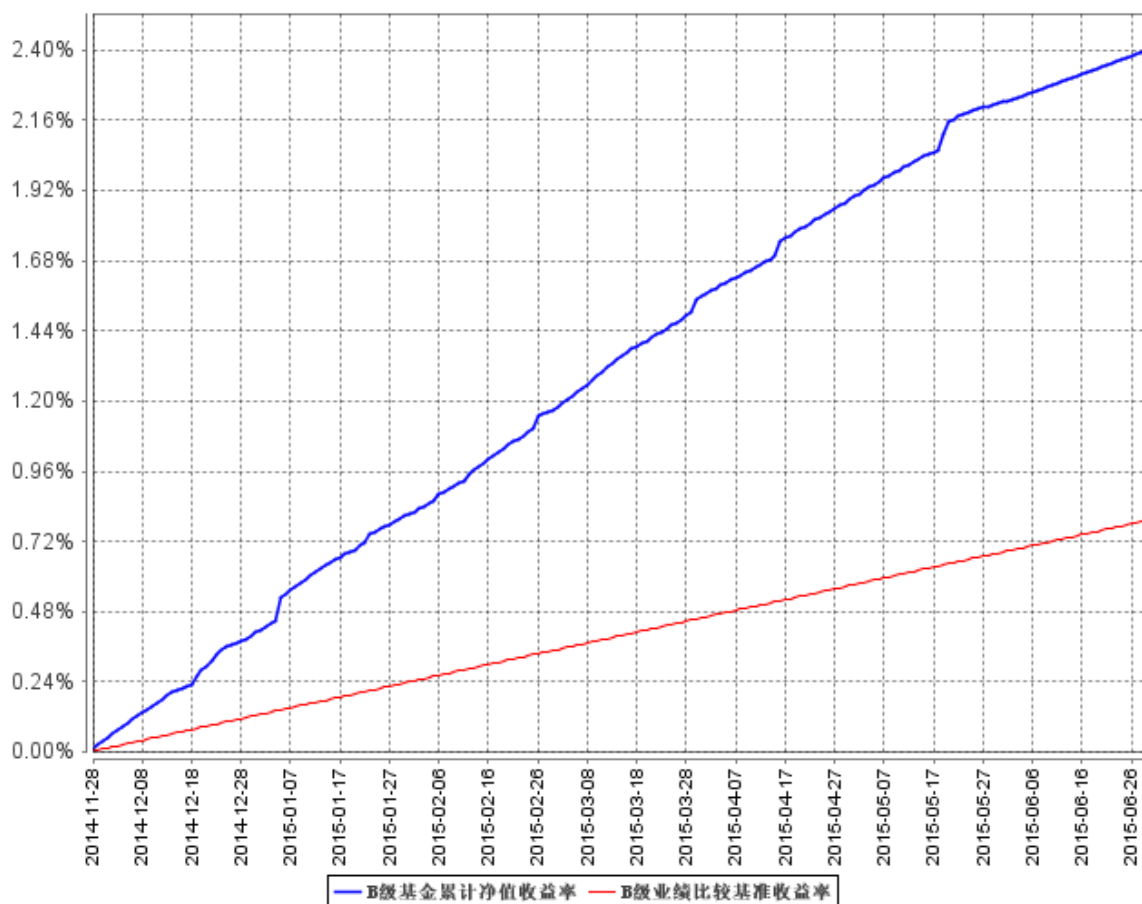
注：本基金收益分配按日结转份额，业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

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

A级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



B级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



注：本基金的基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是证监会批准设立的第 90 家公募基金公司，也是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 1.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金管理有限公司注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。公司目前拥有共同基金募集和

管理资格、特定客户资产管理业务资格。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 4 支开放式基金--中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金和中金消费升级股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模 30.21 亿。

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 | | |
| 石云峰 | 本基金的基金经理 | 2014 年 11 月 28 日 | - | 8 | 石云峰先生，经济学硕士。历任中国邮政储蓄银行总行资金营运部交易员，太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理，嘉实基金管理有限公司机构投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理，2014 年 11 月 4 日起任中金纯债债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1、任职日期说明：任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》

的相关规定

3、本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，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，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

上半年，国内经济面临下行压力，稳增长依然重要，而通胀仍然维持较低水平，货币政策总体延续适度宽松的基调。人民银行启用了包括下调存贷款利率、重启逆回购并下调公开市场回购利率、降低存款准备金率、续作中短期借贷便利等多种政策工具，积极引导利率水平下行。上半年货币市场资金利率持续回落。

操作方面，报告期内基金以短期融资券、存款和逆回购为主要配置资产。报告期内组合保持了适当的剩余期限和杠杆率，在二季度提高了债券占比。总体来看，组合在上半年保持了较好的流动性和较稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类基金份额净值收益率为 1.8639%，B 类基金份额净值收益率为 1.9853%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内经济基本面可能仍然较弱，宽松的货币政策仍是保证经济平稳增长的必要条件。预期人民银行会继续运用多种工具来保持资金面的适当宽松，以维持货币信贷和社融规模的平稳增长。同时，权益市场的调整带动整个资本市场投资者风险偏好下降，大类资产配置可能重新转移至固定收益市场。预计下半年货币市场利率中枢将保持低位。

本基金将坚持货币基金作为流动性管理工具的定位，继续保持投资组合较好的流动性和适中的剩余期限。本基金投资类属配置将以同业存款、逆回购、金融债和信用相对较好的短期融资券为主，追求相对稳定的投资收益。

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委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监督稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会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，基金经理参加估值委员会会议，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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金自基金合同生效之日起每个开放日将实现的基金净收益（或净损失）分配给基金份额持有人，参与下一日基金收益分配，并结转到投资者基金账户，使基金份额净值始终保持 1.000 元。本基金收益分配方式为红利再投资。

本基金本报告期内 A 类份额累计应分配利润 502,670.32 元，实际分配金额 502,670.32 元，B 类份额累计应分配利润 8,521,768.49 元，实际分配 8,521,768.49 元。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，中金现金管家 A 实施利润分配金额为 502,670.32 元；中金现金管家 B 实施利润分配金额为 8,521,768.49 元。

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

本托管人复核审查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。

§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：中金现金管家货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 203,936,094.89 | 170,929,973.16 |
| 结算备付金 | | 502,500.00 | - |
| 存出保证金 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 607,703,094.43 | 80,144,543.05 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 607,703,094.43 | 80,144,543.05 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 610,001,575.00 | 20,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 10,044,069.45 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 8,197,724.46 | 2,525,897.08 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 103,000.00 | 2,460,000.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,440,488,058.23 | 276,060,413.29 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 284,482.21 | 95,583.84 |
| 应付托管费 | | 86,206.73 | 28,964.80 |
| 应付销售服务费 | | 11,554.43 | 3,869.50 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 13,895.73 | 1,831.19 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 118,201.66 | - |
| 负债合计 | | 514,340.76 | 130,249.33 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,439,973,717.47 | 275,930,163.96 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,439,973,717.47 | 275,930,163.96 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,440,488,058.23 | 276,060,413.29 |

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，中金现金管家 A 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 16,147,179.45 份；中金现金管家 B 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 1,423,826,538.02 份。中金现金管家基金份额总额合计为 1,439,973,717.47 份。

2、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日。

6.2 利润表

会计主体：中金现金管家货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 10,356,141.03 | - |
| 1.利息收入 | | 9,626,877.70 | - |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 4,627,876.01 | - |
| 债券利息收入 | | 2,432,695.07 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,566,306.62 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 729,263.33 | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 729,263.33 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 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（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | - | - |
| 减：二、费用 | | 1,331,702.22 | - |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 845,122.62 | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 256,097.75 | - |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 56,896.22 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.16 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 20,997.62 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 20,997.62 | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.17 | 152,588.01 | - |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 9,024,438.81 | - |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” | | 9,024,438.81 | - |

| | | | |
|-------|--|--|--|
| ”号填列) | | | |
|-------|--|--|--|

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金现金管家货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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) | 275,930,163.96 | - | 275,930,163.96 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 9,024,438.81 | 9,024,438.81 |
| 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) | 1,164,043,553.51 | - | 1,164,043,553.51 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,018,094,445.65 | - | 3,018,094,445.65 |
| 2. 基金赎回款 | -1,854,050,892.14 | - | -1,854,050,892.14 |
| 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) | - | -9,024,438.81 | -9,024,438.81 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 1,439,973,717.47 | - | 1,439,973,717.47 |

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，无上年度可比期间数据。

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：

阚睿

基金管理人负责人

孙菁

主管会计工作负责人

白娜

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金现金管家货币市场基金（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[2014]1152 号文《关于准予中金现金管家货币市场基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基

金法》和《中金现金管家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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 402,244,840.44 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) 毕马威华振验字(2014)第 1401361 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中金现金管家货币市场基金基金合同》于 2014 年 11 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 402,261,594.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,754.29 份基金份额。本基金的基金管理人为中金基金，注册登记机构为中金基金，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中金现金管家货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券、1 年以内(含 1 年)的银行存款和大量存单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券和中期票据、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的《企业会计准则》的要求编制。在具体会计核算和信息披露方面，同时亦按照证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度和半年度报告》（中国证监会正式稿）（2014 年 11 月 5 日）和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 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以及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况及自 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债） 本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。衍生工具所产生的金融资产和金融负债在资产负债表中以衍生金融资产和衍生金融负债列示。

-应收款项

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。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债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；同时于每一估值日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

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，采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。当基金资产净值与按影子价格计算的基金资产

净值之间的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产净值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一日估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 损益平准金

不适用。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益 / (损失) 于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本以实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票

面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产利息收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《中金现金管家货币市场基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率逐日确认。

根据《中金现金管家货币市场基金基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率逐日确认。

根据《中金现金管家货币市场基金基金合同》的规定，本基金实行销售服务费分级收费方式。本基金 A 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提，本基金 B 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提。对于因账户基金份额达到 500 万份而由 A 类升级为 B 类的基金份额，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工作日起享受 B 类基金份额的费率。对于因账户基金份额降至 500 万份以下而由 B 类降级为 A 类的基金份额，年销售服务费率应自其降级后的下一工作日起适用 A 类基金份额的费率。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用红利再投资分红方式，投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益。本基金每日进行基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算并结转至应付利润科目，且每日进行支付。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个工作日起，不享有基金的收益分配权益。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本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，本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：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字 [2007] 21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 差错更正的说明

无

6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂不征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的债券的利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- (4) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 5,936,094.89 |
| 定期存款 | 198,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 198,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 203,936,094.89 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 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 | 607,703,094.43 | 608,485,000.00 | 781,905.57 | 0.0543% |
| | 合计 | 607,703,094.43 | 608,485,000.00 | 781,905.57 | 0.0543% |

注：偏离金额=影子定价-摊余成本，偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 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 2015年6月30日 | |
|------------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 40,000,000.00 | - |
| 买入返售证券_银行间 | 570,001,575.00 | - |
| 合计 | 610,001,575.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 4,325.81 |
| 应收定期存款利息 | 275,250.28 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 226.38 |
| 应收债券利息 | 7,579,175.77 |
| 应收买入返售证券利息 | 194,703.08 |
| 应收申购款利息 | 144,043.14 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 8,197,724.46 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 13,895.73 |
| 合计 | 13,895.73 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 118,201.66 |
| 合计 | 118,201.66 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中金现金管家 A 类 | | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 13,076,608.55 | 13,076,608.55 |
| 本期申购 | 141,758,171.40 | 141,758,171.40 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -138,687,600.50 | -138,687,600.50 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 16,147,179.45 | 16,147,179.45 |

金额单位：人民币元

| 中金现金管家 B 类 | | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 262,853,555.41 | 262,853,555.41 |
| 本期申购 | 2,876,336,274.25 | 2,876,336,274.25 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,715,363,291.64 | -1,715,363,291.64 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,423,826,538.02 | 1,423,826,538.02 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中金现金管家 A 类 | | | |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 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 | 502,670.32 | - | 502,670.32 |
| 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 | -502,670.32 | - | -502,670.32 |
| 本期末 | - | - | - |

单位：人民币元

| 中金现金管家 B 类 | | | |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 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 | 8,521,768.49 | - | 8,521,768.49 |
| 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 | -8,521,768.49 | - | -8,521,768.49 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 65,920.61 |
| 定期存款利息收入 | 4,411,905.15 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 10,569.94 |
| 其他 | 139,480.31 |
| 合计 | 4,627,876.01 |

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2015年1月1日至2015年6月30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 | 729,263.33 |
| 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 | 729,263.33 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 209,137,107.61 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 200,438,961.54 |
| 减：应收利息总额 | 7,968,882.74 |
| 买卖债券差价收入 | 729,263.33 |

6.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.16 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 34,712.18 |
| 信息披露费 | 74,383.76 |
| 上清所证书费用 | 105.72 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 汇划手续费 | 25,386.35 |
| 合计 | 152,588.01 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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 |
|----------------------|-----------------------|
| 中金基金管理有限公司（中金基金） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（中国建设银行） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国国际金融股份有限公司（中金公司） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----------------------|----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| | | |

| | | |
|-----------------|------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 845,122.62 | - |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,330.78 | - |

注：1. 支付基金管理人中金基金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《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售服务机构的客户维护费为 3,330.78 元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

3、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 256,097.75 | - |

注：1、支付基金托管人中国建设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。

2、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中金现金管家 A 类 | 中金现金管家 B 类 | 合计 |
| 中金基金 | 16,362.50 | 22,958.99 | 39,321.49 |
| 中国建设银行 | 2,244.34 | - | 2,244.34 |
| 中金公司 | 10,407.12 | 1,341.01 | 11,748.13 |
| 合计 | 29,013.96 | 24,300.00 | 53,313.96 |

注：1、中金现金管家 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。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、中金现金管家 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。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。

3、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
|--|---------------------------------------|---------------|
| | 中金现金管家 A 类 | 中金现金管家 B 类 |
| 基金合同生效日（ 2014 年 11 月 28 日）持有的 基金份额 | - | 10,000,450.00 |
| 期初持有的基金份额 | - | 10,020,857.14 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 219,150.67 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | 10,240,007.81 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 0.72% |

注：1. 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额。

2. 本管理人上年度可比期间未运用自有资金投资本产品。

6.4.10.4.2 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

中金现金管家 B 类

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2014 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 |
| 中金公司 | 500,186,451.62 | 34.74% | - | - |

本基金合同生效日为 2014 年 11 月 28 日，无上年度对比数据

6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014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 |
| 中国建设银行 | 203,936,094.89 | 4,477,825.76 | - | - |

注：1、本报告期期末余额包括活期存款和定期存款，利息收入包括活期存款利息收入和存款投资收益收入。

2、本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2015年6月30日的相关余额为人民币502,500.00元。

3、本基金合同生效日为2014年11月28日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

中金现金管家A类

| 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 |
|--------------|---------------|----------|------------|----|
| 502,670.32 | - | - | 502,670.32 | - |

中金现金管家B类

| 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 |
|--------------|---------------|----------|--------------|----|
| 8,521,768.49 | - | - | 8,521,768.49 | - |

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险稳定收益品种。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而实现本基金的投资目标。

本基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 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 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | 517,451,756.94 | 50,164,859.62 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 20,163,527.38 | 19,999,733.06 |
| 合计 | 537,615,284.32 | 70,164,592.68 |

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。

此外，本基金亦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。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是债券投资的首要风险，更多的指市场利率上升致使债券价格下跌，持债市值缩水的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本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、定期进行货币基金压力测试，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015 年 6 月 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|--------|----------|-------|-------|-----|----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|-----------------------------|------------------|---------------|-------|-------|---------------|------------------|
| 30 日 | | | | | | |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 203,936,094.89 | - | - | - | - | 203,936,094.89 |
| 结算备付金 | 502,500.00 | - | - | - | - | 502,500.00 |
| 交易性金融资产-债券投资 | 567,711,061.90 | 39,992,032.53 | - | - | - | 607,703,094.43 |
| 买入返售金融资产 | 610,001,575.00 | - | - | - | - | 610,001,575.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | 10,044,069.45 | 10,044,069.45 |
| 应收利息 | - | - | - | - | 8,197,724.46 | 8,197,724.46 |
| 应收申购款 | 103,000.00 | - | - | - | - | 103,000.00 |
| 资产总计 | 1,382,254,231.79 | 39,992,032.53 | - | - | 18,241,793.91 | 1,440,488,058.23 |
| 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 | - | - | - | - | 284,482.21 | 284,482.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 86,206.73 | 86,206.73 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 13,895.73 | 13,895.73 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 11,554.43 | 11,554.43 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 118,201.66 | 118,201.66 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 514,340.76 | 514,340.76 |
| 利率敏感度缺口 | 1,382,254,231.79 | 39,992,032.53 | - | - | 17,727,453.15 | 1,439,973,717.47 |
| 上年度末 2014 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 170,929,973.16 | - | - | - | - | 170,929,973.16 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 60,128,873.53 | 20,015,669.52 | - | - | - | 80,144,543.05 |
| 买入返售金融资产 | 20,000,000.00 | - | - | - | - | 20,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | 2,525,897.08 | 2,525,897.08 |

| | | | | | | |
|-----------|----------------|---------------|---|---|--------------|----------------|
| 应收申购款 | 2,460,000.00 | - | - | - | - | 2,460,000.00 |
| 资产总计 | 253,518,846.69 | 20,015,669.52 | - | - | 2,525,897.08 | 276,060,413.29 |
| 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 | - | - | - | - | 95,583.84 | 95,583.84 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 28,964.80 | 28,964.80 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 1,831.19 | 1,831.19 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 3,869.50 | 3,869.50 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - |
| 负债总计 | - | - | - | - | 130,249.33 | 130,249.33 |
| 利率敏感度缺口 | 253,518,846.69 | 20,015,669.52 | - | - | 2,395,647.75 | 275,930,163.96 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，其中交易性金融资产以摊余成本近似反映其公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降 25 个基点，对本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|----|------------------------|--------------------------|
|----|------------------------|--------------------------|

| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 607,703,094.43 | 42.20 | 80,144,543.05 | 29.05 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 607,703,094.43 | 42.20 | 80,144,543.05 | 29.05 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------------------|------------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 607,703,094.43 | 42.19 |
| | 其中: 债券 | 607,703,094.43 | 42.19 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 610,001,575.00 | 42.35 |
| | 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 | 204,438,594.89 | 14.19 |
| 4 | 其他各项资产 | 18,344,793.91 | 1.27 |
| 5 | 合计 | 1,440,488,058.23 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|-----|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 0.53 | |
| | 其中: 买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金 |

| | | | 资产净值的比例 (%) |
|---|--------------|---|-------------|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 27 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 72 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 7 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

合同约定：“基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天”，本基金本报告期未发生超标情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 30 天以内 | 79.99 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 11.12 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 2.78 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—180 天 | 2.80 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180 天(含)—397 天(含) | 2.78 | - |

| | | | |
|--|------------------------|-------|---|
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.46 | - |

7.4 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 70,087,810.11 | 4.87 |
| | 其中：政策性金融债 | 70,087,810.11 | 4.87 |
| 4 | 企业债券 | 537,615,284.32 | 37.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 607,703,094.43 | 42.20 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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 | 071511004 | 15 国信证 券 CP004 | 500,000 | 50,046,523.05 | 3.48 |
| 2 | 071525004 | 15 国都证 券 CP004 | 400,000 | 40,038,597.70 | 2.78 |
| 3 | 140218 | 14 国开 18 | 400,000 | 40,018,117.59 | 2.78 |
| 4 | 071544002 | 15 华福证 券 CP002 | 400,000 | 40,000,480.71 | 2.78 |
| 5 | 071507001 | 15 中信建 投 CP001 | 300,000 | 30,034,246.63 | 2.09 |
| 6 | 071517002 | 15 东北证 券 CP002 | 300,000 | 30,033,342.57 | 2.09 |
| 7 | 071523002 | 15 长城证 券 CP002 | 300,000 | 30,028,542.53 | 2.09 |
| 8 | 071533003 | 15 华融证 券 CP003 | 300,000 | 30,017,057.18 | 2.08 |
| 9 | 071502005 | 15 国泰君 | 300,000 | 29,995,803.29 | 2.08 |

| | | | | | |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| | | 安 CP005 | | | |
| 10 | 071511006 | 15 国信证 券 CP006 | 300,000 | 29,995,744.41 | 2.08 |

7.6 “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 | 8 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.3568% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0263% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1184% |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

7.8.2

本基金本报告期内没有出现持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况。

7.8.3

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

7.8.1 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,044,069.45 |
| 3 | 应收利息 | 8,197,724.46 |
| 4 | 应收申购款 | 103,000.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 18,344,793.91 |

7.8.2 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 中金现金管家 A 类 | 317 | 50,937.47 | 562,129.41 | 3.48% | 15,585,050.04 | 96.52% |
| 中金现金管家 B 类 | 17 | 83,754,502.24 | 1,417,745,007.49 | 99.57% | 6,081,530.53 | 0.43% |
| 合计 | 334 | 4,311,298.56 | 1,418,307,136.90 | 98.50% | 21,666,580.57 | 1.50% |

8.2 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 | 中金现金管家 A 类 | 1,111,487.71 | 6.88% |
| | 中金现金管家 B 类 | - | - |
| | 合计 | 1,111,487.71 | 0.08% |

8.3 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的情况

| 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 中金现金管家 A 类 | 10~50 |
| | 中金现金管家 B 类 | - |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中金现金管家 A 类 | 10~50 |
| | 中金现金管家 B 类 | - |
| | 合计 | 10~50 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 中金现金管家 A类 | 中金现金管家 B类 |
|----------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日（2014年11月28日）基金份额总额 | 3,244,944.73 | 399,016,650.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,076,608.55 | 262,853,555.41 |
| 本报告期基金总申购份额 | 141,758,171.40 | 2,876,336,274.25 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 138,687,600.50 | 1,715,363,291.64 |
| 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 | 16,147,179.45 | 1,423,826,538.02 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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 | |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

2、本基金管理人负责选择证券经营结构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面地信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营结构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 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 |
| 中金公司 | - | - | 1,855,300,000.00 | 100.00% | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内每个交易日，偏离度绝对值均未超过0.5%。

10.9 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 | 中金现金管家货币市场基金新增好买基金为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年1月13日 |
| 2 | 关于中金现金管家货币市场基金新增齐鲁证券为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年1月15日 |
| 3 | 关于中金现金管家货币市场基金新增建设银行为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年1月15日 |
| 4 | 关于中金基金管理有限公司新增平安银行为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年2月5日 |
| 5 | 关于新增北京展恒基金销售有限公司为销售机构并实施申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年2月10日 |
| 6 | 关于中金现金管家货币市场基金 2015 年春节假期前暂停大额申购、转换转入、定期定额业务的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年2月11日 |
| 7 | 关于中金现金管家货币市场基金新增国信证券股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年3月4日 |
| 8 | 中金基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年3月27日 |
| 9 | 中金基金管理有限公司网上交易系统暂停服务公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015年6月3日 |

| | | | |
|----|--------------------------------|--------------------|-----------------|
| 10 | 中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015 年 6 月 8 日 |
| 11 | 中金基金管理有限公司关于网上直销身份认证系统升级的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015 年 6 月 12 日 |
| 12 | 中金基金管理有限公司关于网上直销开通招商银行借记卡支付的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015 年 6 月 24 日 |
| 13 | 中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015 年 6 月 26 日 |
| 14 | 中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告 | 中国证监会指定报刊及 公司网站 | 2015 年 7 月 3 日 |

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准中金现金管家货币市场基金募集的文件
- 2、《中金现金管家货币市场基金基金合同》
- 3、《中金现金管家货币市场基金托管协议》
- 4、《中金现金管家货币市场基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中金基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日