

中加货币市场基金2016年半年度报告

2016年6月30日

基金管理人：中加基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016年8月25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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	
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	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的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 债券回购融资情况	44
7.3 基金投资组合平均剩余期限	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
7.8 期末按公允价值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	47
7.9 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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情况	49

§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	51
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	51
10.9 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加货币市场基金	
基金简称	中加货币	
基金主代码	000331	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年10月21日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,820,315,911.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	中加货币A	中加货币C
下属两级基金的交易代码	000331	000332
报告期末下属两级基金的份 额总额	1,295,395,644.23份	24,524,920,266.81份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的现金收益。
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，力求将各类风险降到最低，在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。
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，平均剩余期限控制在120天以内，属于低风险、高流动性、预期收益稳健的基金产品。本基金的预期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	中加基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公

			司
信息披露负责人	姓名	刘向途	张建春
	联系电话	400-00-95526	010-63639180
	电子邮箱	service@bobbns.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-00-95526	95595
传真		010-66226080	010-63639132
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市西城区南纬路35号	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100057	100033
法定代表人		闫冰竹	唐双宁

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	www.bobbns.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日-2016年6月30日）	
	中加货币A	中加货币C
本期已实现收益	17,043,189.99	323,413,482.53

本期利润	17,043,189.99	323,413,482.53
本期净值收益率	1.39%	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末基金资产净值	1,295,395,644.23	24,524,920,266.81
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(2016年6月30日)	
累计净值收益率	12.10%	12.82%

注：1.本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于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。

3.本基金收益分配是按月结转份额。

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

(1) 中加货币A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

阶段(A级)	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	0.2061 %	0.0014 %	0.1126 %	0.0000 %	0.0935 %	0.0014 %
过去三个月	0.6773 %	0.0022 %	0.3418 %	0.0000 %	0.3355 %	0.0022 %
过去六个月	1.3850 %	0.0017 %	0.6848 %	0.0000 %	0.7002 %	0.0017 %
过去一年	2.9351 %	0.0016 %	1.3819 %	0.0000 %	1.5532 %	0.0016 %
自基金合同生效日起至今(2013年10月21日-2016年06月30日)	12.0958 %	0.0086 %	3.7589 %	0.0000 %	8.3369 %	0.0086 %

(2) 中加货币C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

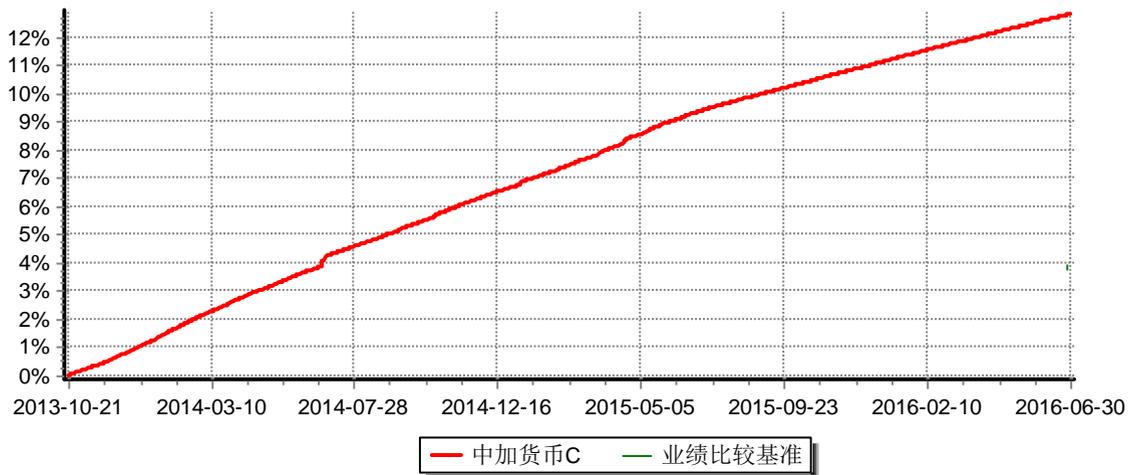
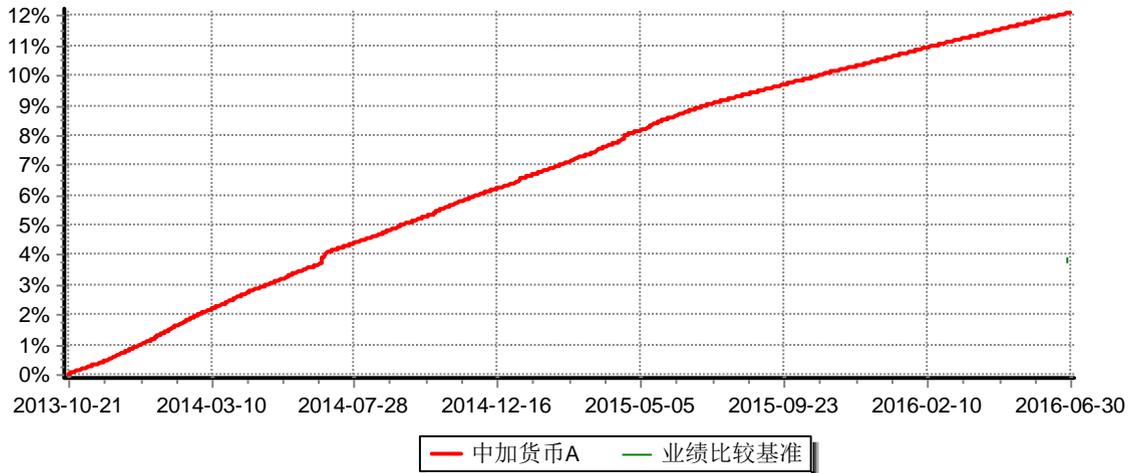
阶段(B级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2257 %	0.0014 %	0.1126 %	0.0000 %	0.1131 %	0.0014 %
过去三个月	0.7372 %	0.0022 %	0.3418 %	0.0000 %	0.3954 %	0.0022 %
过去六个月	1.5058 %	0.0017 %	0.6848 %	0.0000 %	0.8210 %	0.0017 %
过去一年	3.1823 %	0.0016 %	1.3819 %	0.0000 %	1.8004 %	0.0016 %
自基金合同生效日起至今(2013年10月21日-2016年06月30日)	12.8203 %	0.0086 %	3.7589 %	0.0000 %	9.0614 %	0.0086 %

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

中加货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年10月21日-2016年6月30日)



注：1、本基金合同生效日为2013年10月21日。

2、依照基金合同约定，建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系试点中首家获批的基金公司，注册资本为3亿元人民币，注册地为北京，股东分别为北京银行股份有限公司、加拿大丰业银行、北京有色金属研究总院，持股比例分别为62%、33%、5%。

报告期内，本公司共管理七只基金，分别为中加货币市场基金(基金代码：A类000331，

C类000332)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金(基金代码:A类:000552,C类:000553)、中加纯债分级债券型证券投资基金(基金代码:A类000914,B类000915)、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:001537)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:A类002027,C类002533)、中加心安保本混合型证券投资基金(基金代码:002440)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(基金代码:A类002881,C类002882)。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
闫沛贤	本基金基金经理、投资研究部副总监兼固定收益部总监	2013年10月21日	—	8	英国帝国理工大学金融学硕士、伯明翰大学计算机硕士学位。2008年至2013年曾任职于平安银行资金交易部、北京银行资金交易部,担任债券交易员。2013年加入中加基金管理有限公司,现任投资研究部副总监兼固定收益部总监、中加货币市场基金基金经理(2013年10月21日至今)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2014年3月24日至今)、中加纯债分级债券型证券投资基金基金经理(2014年12月17日至今)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年12月28日至今)。

注:1、任职日期说明:闫沛贤的任职日期以本基金基金合同生效公告为准。

2、离任日期说明:无。

3、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。

4、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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、《中加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，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期内不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合间不存在同日反向交易。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性，未出现异常交易的情况。

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

上半年资金面虽出现一定的波动，但整体较为平稳。春节前后，央行均通过公开市场及SLO\SLF等工具向市场投放巨量资金，以缓解紧张的资金面，7天回购加权利率始终稳定在2.5%以下。

三月初降准0.5%，释放资金7000亿左右，但全月公开市场大规模净回笼1.025万亿元，三月较高的信贷投放带来准备金的上缴也较高，以及外汇占款的继续流出，整体资金供给维持偏紧状态。在资金供应有限的情况下，三月下旬面临季末压力和MPA初次考

核更是加剧了结构性的非银机构的资金紧张状况，回购利率在季末陡升。

进入6月份，MPA考核导致阶段性的资金面承压。此外，转债打新、新债缴款等因素也带来了新增的资金需求，增加了流动性层面的压力。央行全月通过逆回购、MLF、国库现金定存等实现净投放5350亿，并且主要集中在资金需求较高的后两周。对比3月末资金利率的大幅上行，本次资金价格并未出现大幅飙升，市场反映出虽然承受压力，但基本可控的局面。

报告期内，基金规模有一定增长，组合通过对资金面进行阶段性判断，择机调整杠杆水平和债券投资比例，同时合理安排了资产的到期分布，保持组合的流动性，并通过节前、季末等的逆回购操作增厚产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内中加货币A净值收益率为1.3850%，中加货币C净值收益率为1.5058%，同期业绩比较基准收益率为0.6848%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从公布的6月份经济金融数据来看，6月经济数据总体与预期有差异，工业和消费好于预期，固定资产投资差于预期，且结构上，仍靠政府基建托底经济，但制造业、民间投资、房地产开发投资仍在恶化。从信贷结构来看，也仍以居民房贷为主，实体的融资需求仍较弱。趋势上，经济的内生动力不强，高杠杆和债务压力倒逼利率保持低位，信用风险仍处于上升期，决定无风险利率下行的趋势并未逆转。

整体来看，尽管央行呵护下，流动性无忧，但需求疲弱以及稳增长诉求下，货币政策放松的压力仍在。当前短端利率受制于公开市场操作利率2.25%的制约难以下行，上半年货币政策维持稳健没有进行主动引导宽松，但后期随着通胀压力的进一步下行，以公开市场操作利率衡量的政策利率水平有进一步下行的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司总经理任估值小组负责人，成员由投资研究部门负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成，主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员，主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理不参与决定本基金估值的程序。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 根据基金合同规定：本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；分配方式为红利再投资，免收再投资费用；每日分配，按月支付；根据每日收益情况，收益全部分配。本基金截至2016年6月30日，本期应付收益340,456,672.52元。

(2) 自2016年1月1日至2016年6月30日，中加货币A已按再投资形式转实收基金：19,289,844.93元，年度利润分配合计：17,043,189.99元；中加货币C已按再投资形式转实收基金：265,615,230.13元，年度利润分配合计：323,413,482.53元。

(3) 本基金截至2016年6月30日，未分配支付利润为61,996,537.25元，于次月第一个工作日结转支付。

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发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§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

2016年上半年度，中国光大银行在中加货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对中加货币市场基金投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016年上半年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人中加基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计

算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际情况进行处理。

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

中国光大银行依法对基金管理人中加基金管理有限公司编制的“中加货币市场基金2016年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§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：中加货币市场基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,686,915,542.79	4,234,792,593.36
结算备付金			—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	11,524,736,868.44	6,362,976,215.42
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		11,524,736,868.44	6,362,976,215.42
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	2,328,460,092.68	5,631,947,807.91
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	267,471,091.89	129,820,504.74
应收股利		—	—

应收申购款		18,488,288.03	400.00
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		29,826,071,883.83	16,359,537,521.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		3,931,354,491.11	3,484,197,521.69
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		8,153,294.26	3,673,911.50
应付托管费		2,470,695.19	1,113,306.54
应付销售服务费		502,124.08	361,239.96
应付交易费用	6.4.7.7	240,033.68	187,547.84
应交税费		—	—
应付利息		567,061.02	534,392.89
应付利润		61,996,537.25	31,166,178.15
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	471,736.20	389,855.99
负债合计		4,005,755,972.79	3,521,623,954.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	25,820,315,911.04	12,837,913,566.87
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		25,820,315,911.04	12,837,913,566.87
负债和所有者权益总计		29,826,071,883.83	16,359,537,521.43

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额25,820,315,911.04份；其中，中加货币A基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,295,395,644.237份；中加货币C基金份额净值1.0000元，基金份额总额24,524,920,266.81份。

6.2 利润表

会计主体：中加货币市场基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日 -2016年6月30日	上年度可比期间2015 年01月01日-2015年06 月30日
一、收入		404,263,423.64	105,000,221.78
1.利息收入		402,634,821.58	92,038,554.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	172,223,635.30	26,338,525.58
债券利息收入		161,594,128.14	49,509,316.71
资产支持证券利息收 入		—	1,448,876.70
买入返售金融资产收 入		68,817,058.14	14,741,835.41
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,577,450.59	12,961,667.38
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	1,577,450.59	12,961,667.38
资产支持证券投资收 益	6.4.7.12. 3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.13	—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）		—	—
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	51,151.47	—

减：二、费用		63,811,163.19	15,416,284.08
1. 管理人报酬		37,755,651.04	6,168,169.99
2. 托管费		11,441,106.38	1,869,142.35
3. 销售服务费		2,622,714.90	1,943,542.02
4. 交易费用	6.4.7.16	677.05	46.94
5. 利息支出		11,700,333.61	5,186,925.96
其中：卖出回购金融资产支出		11,700,333.61	5,186,925.96
6. 其他费用	6.4.7.17	290,680.21	248,456.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		340,452,260.45	89,583,937.70
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		340,452,260.45	89,583,937.70

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中加货币市场基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日-2016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)	12,837,913,566.87	—	12,837,913,566.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	340,456,672.52	340,456,672.52
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)	12,982,402,344.17	—	12,982,402,344.17
其中：1.基金申购款	63,156,654,690.69	—	63,156,654,690.69
2.基金赎回款	-50,174,252,346.52	—	-50,174,252,346.52

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)	—	-340,456,672.52	-340,456,672.52
五、期末所有者权益 (基金净值)	25,820,315,911.04	—	25,820,315,911.04
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06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)	3,225,009,690.97	—	3,225,009,690.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	89,583,937.70	89,583,937.70
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)	2,840,056,924.02	—	2,840,056,924.02
其中：1.基金申购款	16,702,608,383.01	—	16,702,608,383.01
2.基金赎回款	-13,862,551,458.99	—	-13,862,551,458.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	—	-89,583,937.70	-89,583,937.70
五、期末所有者权益(基金净值)	6,065,066,614.99	—	6,065,066,614.99

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：

夏英

陈昕

陈昕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中加货币市场基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称

"中国证监会")于2013年8月27日证监许可[2013]1125号《关于核准中加货币市场基金募集的批复》核准,由中加基金管理有限公司(以下简称"中加基金")依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加货币市场基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称"光大银行")。

本基金通过中加基金及光大银行、北京银行股份有限公司(以下简称"北京银行")、南京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司和上海农村商业银行股份有限公司的代销网点公开发售,募集期为2013年10月10日至2013年10月16日。本基金于2013年10月21日成立,成立之日基金实收份额为6,872,827,402.92份(含利息转份额人民币562,401.71元),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中加货币市场基金基金合同》和《中加货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自成立日起实行销售服务费分级收费方式,按单个基金账户内保留的基金份额是否达到或超过500万份将其分设为A类或C类基金份额,并分别适用不同的销售服务费费率。本基金分级后,除A、C两类基金份额收益率不同外,各级基金份额持有人的其他权益平等。

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")于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"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<年度报告和半年度报告>》和中国证券投资基金业协会于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、中国证监会和中国证券投资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截止2016年6月30日的财务状况及自2016年1月1日至2016年6月30日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

本基金财务报表的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

(1)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。

(2)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。

(3)持有至到期投资：本基金将有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为持有至到期投资。

(4)可供出售金融资产：本基金将在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产分类为可供出售金融资产。

(5)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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1)本基金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；
- (2)本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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A类与C类基金份额之间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

无。

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和与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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《中加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《中加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《中加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C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C类的基金份额,年基金销售服务费率应自其达到C类条件的开放日后的下一工作日起享受C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C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,次月以红利再投资方式集中支付累计收益。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 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，本基金确定以下类别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 差错更正的说明

本报告期，本基金未发生会计差错更正事项。

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 2016年6月30日

活期存款	915,542.79
定期存款	15,686,000,000.00
合计	15,686,915,542.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016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	11,524,736,868.44	11,534,112,000.00	9,375,131.56	0.0363%
	合计	11,524,736,868.44	11,534,112,000.00	9,375,131.56	0.0363%

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

本基金本期末未持有衍生金融资产/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2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	2,328,460,092.68	—
合计	2,328,460,092.68	—

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	19,444.77
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—

应收债券利息	213,391,502.74
应收买入返售证券利息	6,760,292.07
应收申购款利息	79,551.88
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	47,220,300.43
合计	267,471,091.89

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016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	240,033.68
合计	240,033.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016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	302,955.84
其他应付	168,780.36
合计	471,736.20

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 中加货币A

金额单位：人民币元

项目(A级)	本期2016年1月1日-2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,210,023,092.17	1,210,023,092.17

本期申购	3,213,131,432.30	3,213,131,432.30
本期赎回（以“-”号填列）	-3,127,758,880.24	-3,127,758,880.24
本期末	1,295,395,644.23	1,295,395,644.23

6.4.7.9.2 中加货币C

金额单位：人民币元

项目(B级)	本期2016年1月1日-2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,627,890,474.70	11,627,890,474.70
本期申购	59,943,523,258.39	59,943,523,258.39
本期赎回（以“-”号填列）	-47,046,493,466.28	-47,046,493,466.28
本期末	24,524,920,266.81	24,524,920,266.81

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 中加货币A

单位：人民币元

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	17,043,189.99	—	17,043,189.99
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	-17,043,189.99	—	-17,043,189.99
本期末	—	—	—

6.4.7.10.2 中加货币C

单位：人民币元

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	323,413,482.53	—	323,413,482.53

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	-323,413,482.53	—	-323,413,482.53
本期末	—	—	—

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
活期存款利息收入	117,915.48
定期存款利息收入	170,905,820.14
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	1,199,899.68
合计	172,223,635.30

6.4.7.12 股票投资收益

本基金报告期未取得股票投资收益。

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 2016年1月1日-2016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	1,577,450.59
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	1,577,450.59
----	--------------

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 2016年1月1日-2016年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	6,205,191,906.19
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	6,025,000,000.00
减：应收利息总额	178,614,455.60
买卖债券差价收入	1,577,450.59

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期末未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本报告期末未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本报告期末未取得衍生工具收益。

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期末未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期末未取得股利收益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
基金赎回费收入	—
其他收入	51,151.47

合计	51,151.47
----	-----------

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
交易所市场交易费用	—
银行间市场交易费用	677.05
合计	677.05

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
审计费用	54,753.80
信息披露费	149,178.12
帐户维护费	18,701.52
汇划手续费	68,046.77
合计	290,680.21

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**

截至2016年6月30日止，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的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**

本基金本报告期内存在控制管理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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售

	机构
北京银行股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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

本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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2016年1月1日-2016年6月30日	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	37,755,651.04	6,168,169.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	793,069.19	1,081,957.72

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值*0.33%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,441,106.38	1,869,142.35

注：支付基金托管人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值*0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2016年1月1日-2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加货币A	中加货币C	合计
中加基金管理有限公司	64,386.37	1,064,006.88	1,128,393.25
北京银行股份有限公司	1,308,735.20	10,230.03	1,318,965.23
中国光大银行股份有限公司	21,816.65	—	21,816.65
合计	1,394,938.22	1,074,236.91	2,469,175.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加货币A	中加货币C	合计
中加基金管理有限公司	63,876.17	83,782.94	147,659.11
北京银行股份有限公司	1,453,220.36	21,675.42	1,474,895.78
中国光大银行股份有限公司	38,930.48	91.10	39,021.58
合计	1,556,027.01	105,549.46	1,661,576.47

注：1.本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%，对于由C级降级为A级的基金份额，应自其降级后的下一个工作日起适用A级基金份额的销售服务费年费率；C级基金份额的销售服务费年费率为0.01%，对于由A级升级为C级的基金份额，应自其升级后的下一个工作日起享受C级基金份额的销售服务费年费率。

2.A类基金日销售服务费=A类基金份额前一日基金资产净值*0.25%/当年天数；C类基金日销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值*0.01%/当年天数。

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

本期间未发生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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日		上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日	
	中加货币A	中加货币C	中加货币A	中加货币C
基金合同生效日持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	99,566,123.46	—	152,538,126.21
期间申购/买入总份额	—	20,000,000.00	—	53,215,167.47
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	-8,000,000.00
期末持有的基金份额	—	121,123,061.71	—	197,233,707.30
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.47%	—	3.25%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

6.4.10.4.2 期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称		本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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
C类	北京银行股份有限公司	638248613.9	2.47%	630231787.68	4.22%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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2016年1月1日-2016年6月30日		上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
中国光大银行活期存款	915,542.79	117,915.48	3,300,593.45	9,616.48
中国光大银行定期存款	—	2,493,750.00	380,000,000.00	216,388.90

注：本基金的银行存款由基金托管行中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与各关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金(A级)	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
19,289,844.93	1,827,730.30	-4,074,385.24	17,043,189.99	
已按再投资形式转实收基金(B级)	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
265,615,230.13	22,893,508.06	34,904,744.34	323,413,482.53	

6.4.12 期末（2016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**

本期间无因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期间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**

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011599884	15陕煤化 SCP009	2016-07-04	100.06	2,020,000.0 0	202,126,199.94
011699003	16陕有色 SCP001	2016-07-04	100.11	2,800,000.0 0	280,298,014.29
011699533	16兖州 煤业 SCP004	2016-07-04	99.68	1,071,000.0 0	106,760,464.17
011699628	16陕煤化 SCP003	2016-07-01	99.97	1,115,000.0 0	111,463,297.02
011699685	16中建材 SCP004	2016-07-01	99.79	4,000,000.0 0	399,176,473.28
011699782	16中材 股 SCP001	2016-07-04	100.33	3,080,000.0 0	309,026,914.66
041551039	15赣煤炭 CP002	2016-07-01	99.99	500,000.00	49,993,145.40
041553047	15冀中 CP002	2016-07-04	100.07	1,240,000.0 0	124,087,964.36
041553054	15宏图 CP002	2016-07-01	99.99	600,000.00	59,996,689.23
041556031	15峰峰	2016-07-01	100.03	321,000.00	32,108,634.69

	CP003				
041558061	15魏桥 铝电 CP001	2016-07-01	100.11	200,000.00	20,021,396.43
041559067	15包钢 集 CP002	2016-07-04	99.82	600,000.00	59,894,159.86
041560081	15华南 工业 CP001	2016-07-01	100.11	1,200,000.00	120,135,034.65
041561038	15万向 钱潮 CP001	2016-07-01	100.11	1,500,000.00	150,160,211.34
041564062	15晋焦 煤 CP002	2016-07-04	100.02	2,005,000.00	200,543,190.34
041566016	15包钢 CP001	2016-07-06	100.02	2,051,000.00	205,134,779.46
041566023	15嘉实 投 CP002	2016-07-01	99.98	327,000.00	32,694,051.95
041569033	15东方 园林 CP002	2016-07-01	100.09	600,000.00	60,055,633.23
041654029	16鞍钢 集 CP001	2016-07-01	99.95	2,000,000.00	199,901,991.57
041654029	16鞍钢 集 CP001	2016-07-01	99.95	500,000.00	49,975,497.89
041654031	16陕煤 化 CP002	2016-07-04	99.95	3,000,000.00	299,851,508.82
041656017	16陕煤 化	2016-07-04	100.19	3,000,000.00	300,559,445.96

	CP003				
070208	07国开 08	2016-07-01	99.47	1,200,000.0 0	119,360,526.89
090221	09国开 21	2016-07-06	99.86	3,000,000.0 0	299,569,355.85
101453007	14河钢 MTN00 1	2016-07-05	102.58	800,000.00	82,065,208.50
110417	11农发 17	2016-07-01	100.52	1,000,000.0 0	100,515,151.72
1182222	11中煤 MTN1	2016-07-04	100.57	5,000,000.0 0	502,830,186.99
1182222	11中煤 MTN1	2016-07-01	100.57	200,000.00	20,113,207.48
1182222	11中煤 MTN1	2016-07-05	100.57	5,000,000.0 0	502,830,186.99
1182222	11中煤 MTN1	2016-07-04	100.57	1,200,000.0 0	120,679,244.88
1182307	11晋焦 煤 MTN1	2016-07-04	100.57	2,000,000.0 0	201,134,801.46
1182324	11河钢 MTN3	2016-07-04	100.56	3,000,000.0 0	301,685,462.04
120223	12国开 23	2016-07-01	99.66	1,100,000.0 0	109,622,020.55
140208	14国开 08	2016-07-01	102.00	2,300,000.0 0	234,592,000.24
140401	14农发 01	2016-07-05	101.77	1,000,000.0 0	101,765,431.79
150302	15进出 02	2016-07-01	100.73	1,300,000.0 0	130,950,734.90
150419	15农发 19	2016-07-05	100.04	200,000.00	20,008,968.98
160204	16国开 04	2016-07-05	99.84	800,000.00	79,869,735.76

160209	16国开09	2016-07-01	99.86	428,000.00	42,740,411.02
160209	16国开09	2016-07-01	99.86	708,000.00	70,701,427.57
160209	16国开09	2016-07-06	99.86	1,041,000.00	103,955,065.11
160414	16农发14	2016-07-01	99.91	70,000.00	6,993,518.61
合计				65,077,000.00	6,525,947,345.87

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未进行交易所市场债券正回购交易。

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，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人光大银行和信用风险较低的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，在银行间同业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；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	3,950,628,948.08	3,711,279,609.71
A-1以下	—	—
未评级	3,600,649,550.55	1,760,933,779.82
合计	7,551,278,498.63	—

注：表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间定期报告债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。每一个信用等级均不进行微调。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	2,336,576,923.31	50,035,411.35
AAA以下	—	—
未评级	1,636,881,446.50	840,727,414.54
合计	3,973,458,369.81	890,762,825.89

注：根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级

级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间定期报告债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，银行间债券市场长期债券信用等级划分为三等九级，符号表示为：AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC、C。除AAA级、CCC级以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级，但不包括AAA+。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，本基金于本报告期末未持有的流通受限证券，均能够及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并通过风险管理部门设定流动性比例要求和建立流动性监控模型，对流动性风险进行持续监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金管理人每日对基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,962,915,542.79	7,684,000,000.00	4,040,000,000.00	—	—	—	15,686,915,542.79
交易性金融资产	771,068,894.10	3,628,986,564.85	7,124,681,409.49	—	—	—	11,524,736,868.44
买入返售金融资产	2,328,460,092.68	—	—	—	—	—	2,328,460,092.68
应收利息	—	—	—	—	—	267,471,091.89	267,471,091.89
应收申购款	—	—	—	—	—	18,488,288.03	18,488,288.03
资产总计	7,062,444,529.57	11,312,986,564.85	11,164,681,409.49	—	—	285,959,379.92	29,826,071,883.83
负债							
卖出回购金融资产款	3,931,354,491.11	—	—	—	—	—	3,931,354,491.11
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	8,153,294.26	8,153,294.26
应付托管费	—	—	—	—	—	2,470,695.19	2,470,695.19
应付销售服务费	—	—	—	—	—	502,124.08	502,124.08
应付交易费用	—	—	—	—	—	240,033.68	240,033.68
应付利息	—	—	—	—	—	567,061.02	567,061.02
应付利润	—	—	—	—	—	61,996.5	61,996.5

						37.25	37.25
其他负债	—	—	—	—	—	471,736.20	471,736.20
负债总计	3,931,354,491.11	—	—	—	—	74,401,481.68	4,005,755,972.79
利率敏感度缺口	3,131,090,038.46	11,312,986,564.85	11,164,681,409.49	—	—	211,557,898.24	25,820,315,911.04
上年度末 2015年12月 31日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,000,792,593.36	890,000,000.00	2,344,000,000.00	—	—	—	4,234,792,593.36
交易性金融 资产	490,093,308.18	881,929,005.39	4,990,953,901.85	—	—	—	6,362,976,215.42
买入返售金 融资产	5,015,465,843.18	616,481,964.73	—	—	—	—	5,631,947,807.91
应收利息	—	—	—	—	—	129,820,504.74	129,820,504.74
应收申购款	—	—	—	—	—	400.00	400.00
资产总计	6,506,351,744.72	2,388,410,970.12	7,334,953,901.85	—	—	129,820,904.74	16,359,537,521.43
负债							
卖出回购金 融资产款	3,484,197,521.69	—	—	—	—	—	3,484,197,521.69
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	3,673,911.50	3,673,911.50
应付托管费	—	—	—	—	—	1,113,306.54	1,113,306.54
应付销售服 务费	—	—	—	—	—	361,239.96	361,239.96
应付交易费	—	—	—	—	—	187,547.84	187,547.84

用							
应付利息	—	—	—	—	—	534,392.89	534,392.89
应付利润	—	—	—	—	—	31,166,178.15	31,166,178.15
其他负债	—	—	—	—	—	389,855.99	389,855.99
负债总计	3,484,197,521.69	—	—	—	—	37,426,432.87	3,521,623,954.56
利率敏感度缺口	3,022,154,223.03	2,388,410,970.12	7,334,953,901.85	—	—	92,394,471.87	12,837,913,566.87

注：本基金根据所持有资产和负债的账面价值，按合约规定的利率重新定价日和剩余到期日中的孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动（上年末：同）。

6.4.13.4.2 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的波动风险。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

其他价格风险是指基金所持有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，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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末2015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-债券投资	11,524,736,868.44	44.63	6,362,976,215.42	49.56
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	11,524,736,868.44	44.63	6,362,976,215.42	49.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2016年06月30日，除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净值资产无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)以公允价值计量的金融工具

下述按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产于2016年6月30日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。

三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2016年6月30日，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工具中属于第二层级的余额为人民币11,524,736,868.44元，无属于第一层级、第三层级的余额。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设详见本报告附注6.4.4.4和6.4.4.5。

本基金本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级未发生重大变动。

(2)其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量账面价值）

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之间无重大差异。

§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	11,524,736,868.44	38.64
	其中：债券	11,524,736,868.44	38.64
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	2,328,460,092.68	7.81
	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	15,686,915,542.79	52.59
4	其他各项资产	285,959,379.92	0.96
5	合计	29,826,071,883.83	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	4.78	
	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	3,931,354,491.11	15.23
	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

金额单位：人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资	原因	调整期
----	------	----------	----	-----

		产净值比例 (%)		
1	2016-01-04	25.34	2015年12月29日发生巨额赎回	1个交易日
2	2016-01-29	20.74	2016年1月28日发生巨额赎回	2个交易日
3	2016-02-01	20.21	2016年1月28日发生巨额赎回	2个交易日
4	2016-03-23	20.49	2016年3月22日发生巨额赎回	1个交易日

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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：根据本基金的基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

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	27.35	15.23
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	22.12	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.15	—
3	60天(含)—90天	20.26	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—

4	90天(含)—120天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		114.56	15.23

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期不存在投资组合平均剩余存续期超过240天情况。

7.5 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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,636,881,446.50	6.34
	其中：政策性金融债	1,636,881,446.50	6.34
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	7,551,278,498.63	29.25
6	中期票据	2,336,576,923.31	9.05
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	11,524,736,868.44	44.63
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,772,291.58	0.15

7.6 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	1182222	11中煤MTN1	11,500,000	1,156,647,918.44	4.48
2	011699685	16中建材SCP004	4,000,000	399,172,349.31	1.55
3	011699782	16中材股SCP001	3,500,000	351,172,117.65	1.36
4	1182324	11河钢MTN3	3,000,000	301,697,705.32	1.17
5	041656017	16陕煤化CP003	3,000,000	300,561,233.47	1.16
6	011699628	16陕煤化SCP003	3,000,000	299,900,751.04	1.16
7	041654029	16鞍钢集CP001	3,000,000	299,852,468.88	1.16
8	041654031	16陕煤化CP002	3,000,000	299,850,984.48	1.16
9	090221	09国开21	3,000,000	299,566,272.19	1.16
10	011699003	16陕有色SCP001	2,800,000	280,307,321.27	1.09

7.7 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.1742%
报告期内偏离度的最低值	0.0027%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0883%

注：无。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期不存在负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期不存在正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

7.8 期末按公允价值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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明。

本基金按以下方式进行计价：

(1) 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价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，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即影子定价。当摊余成本法计算的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，并且按相关规定进行临时公告。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.9.2

基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.9.3 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	267,471,091.89
4	应收申购款	18,488,288.03
5	其他应收款	—

6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	285,959,379.92

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因，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
中加货 币A	76,160	17,008.87	99,735,931. 66	7.70%	1,195,659,7 12.57	92.30%
中加货 币C	163	150,459,633 .54	24,503,611, 421.51	99.91%	21,308,845. 30	0.09%
合计	76,323	338,303.21	24,603,347, 353.17	95.29%	1,216,968,5 57.87	4.71%

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
基金管理公司所有从业人 员持有本基金	中加货币A	3,372,587.58	0.26%
	中加货币C	—	—
	合计	3,372,587.58	0.01%

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 资和研究部门负责人持有本	中加货币A	0
	中加货币C	0

开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中加货币A	0
	中加货币C	0
	合计	0

注：报告期末本公司高级管理人员、基金投资研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加货币A	中加货币C
基金合同生效日(2013年10月21日)基金份额总额	2,302,992,307.69	4,569,835,095.23
本报告期期初基金份额总额	1,210,023,092.17	11,627,890,474.70
本报告期基金总申购份额	3,213,131,432.30	59,943,523,258.39
减：本报告期基金总赎回份额	3,127,758,880.24	47,046,493,466.28
本报告期期末基金份额总额	1,295,395,644.23	24,524,920,266.81

注：总申购份额中包含红利再投份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

基金管理人本报告期内人事变动情况：自2016年5月17日起，因工作变动原因，霍向辉先生不再担任中加基金管理有限公司督察长，由刘向途先生自该日起担任公司督察长一职。

本报告期内，基金托管人托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日（2013年10月21日）起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注

注：本期基金未租用证券公司交易单元。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	中加货币市场基金关于限制大额申购业务的公告	公司网站	2016-01-14
2	中加货币市场基金2015年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016-01-22
3	中加货币市场基金关于春节假期期间暂停申购业务的公告	公司网站	2016-02-01
4	中加基金管理有限公司关于增加	公司网站	2016-03-25

	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下基金代销机构的公告		
5	中加货币市场基金2015年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016-03-28
6	中加货币市场基金2015年年度报告	公司网站	2016-03-28
7	中加货币市场基金关于清明节假期期间暂停申购业务的公告	公司网站	2016-03-29
8	中加基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司网站	2016-04-15
9	中加货币市场基金2016年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016-04-21
10	中加货币市场基金关于劳动节假期期间暂停申购业务的公告	公司网站	2016-04-25
11	中加基金管理有限公司关于北京增财基金销售有限公司终止代理销售旗下部分开放式基金的公告	公司网站	2016-05-19
12	中加基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	公司网站	2016-05-25
13	中加基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	公司网站	2016-05-30
14	中加货币市场基金关于端午节假期期间暂停申购业务的公告	公司网站	2016-06-03
15	中加货币市场基金招募说明书更新摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016-06-04
16	中加货币市场基金招募说明书更新	公司网站	2016-06-04
17	中加基金管理有限公司关于在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告	公司网站	2016-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加货币市场基金募集的文件
- 2、《中加货币市场基金基金合同》
- 3、《中加货币市场基金托管协议》
- 4、《中加货币市场基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅、或登录基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人-中加基金管理有限公司客户服务中心电话：400-00-95526。

网址：www.bobbns.com。

中加基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日