

中加货币市场基金

2017年第2季度报告

2017年06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

报告送出日期：2017年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2017年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现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，投资者在做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2017年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	18,342,394,196.26份
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。主要投资策略包括： （1）短期利率水平预期策略；（2）收益率曲线分析策略；（3）组合剩余期限策略、期限配置策略；（4）类别品种配置策略；（5）滚动投资策略；（6）流动性管理策略
业绩比较基准	七天通知存款利率
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	中加货币A	中加货币C
下属分级基金的交易代码	000331	000332
报告期末下属分级基金的份额总额	1,378,205,822.12份	16,964,188,374.14份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年04月01日-2017年06月30日）	
	中加货币A	中加货币C
1. 本期已实现收益	12,565,088.57	177,524,232.38
2. 本期利润	12,565,088.57	177,524,232.38
3. 期末基金资产净值	1,378,205,822.12	16,964,188,374.14

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值收益率①	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	0.9197%	0.0009%	0.3418%	0.0000%	0.5779%	0.0009%

2、中加货币C

阶段	净值收 益率①	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	0.9798 %	0.0009 %	0.3418 %	0.0000%	0.6380 %	0.0009 %

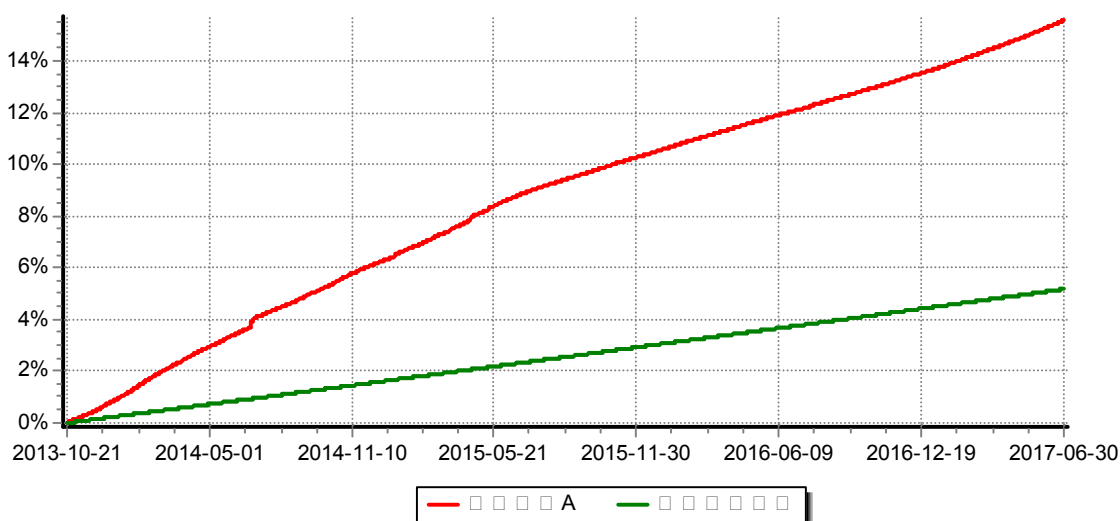
注：本基金（包括中加货币A和中加货币C）的收益分配是按月结转。

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

中加货币A

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

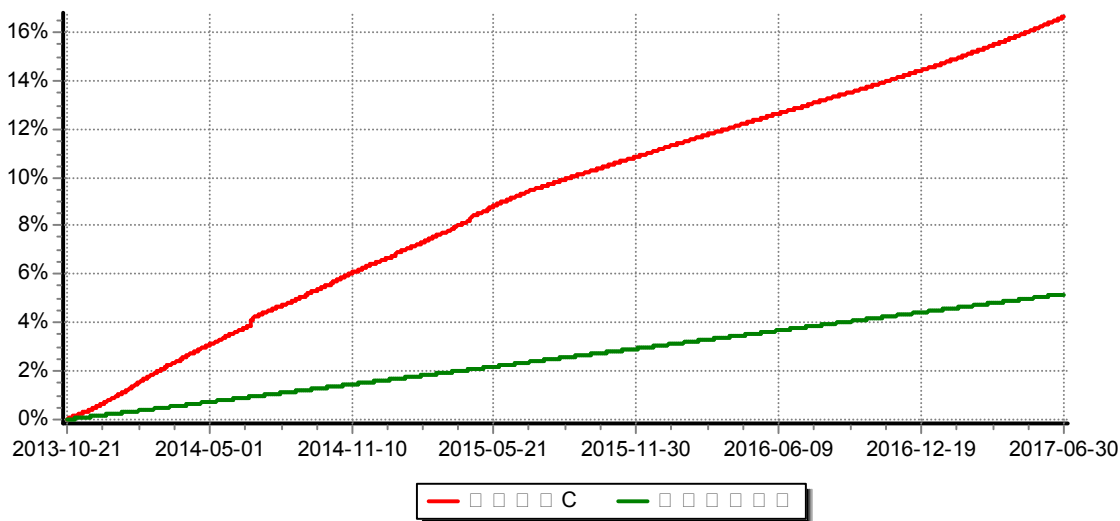
(2013年10月21日-2017年06月30日)



中加货币C

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-2017年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2013年10月21日生效，至本报告期末，本基金合同生效满一年。
 2、根据基金合同约定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束时，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 基金经理（或基金经理小组）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	投资研究部副总监兼固定收益部总监、本基金基金经理	2013年10月21日	—	9	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)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、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。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债市先跌后涨。中债总财富（总值）指数在二季度内累计下跌0.12%。按10年期国债走势可以将二季度分为三个阶段：1）4月1日-5月11日，2）5月12日-6月25日，3）6月26日-30日。第一阶段在监管压力下10年期国债净价下跌，收益率上升。5月11日央行召集三会讨论监管协调，随后市场对于监管压力的担忧减轻，10年期国债价格重回上行通道。基于R007的5年期利率互换的报价从5月12日开始趋势下行，显示投资者预期利率下行。自6月23日起，由于财政支出，央行开始暂停公开市场逆回购操作，10年期国债收益率随后转而上行。

3月28日银监会下发45号文件，在银行中全面开展“违反金融法律、违反监管规则、违反内部规章”的专项治理工作。3月29日银监会下发6号文件，旨在加强银行风险防控工作。6号文件中对于银行通过表外理财进行委外投资业务要求做到穿透管理，掌握底层债券资产信息，并严格控制委外机构杠杆比例。3月28日银监会印发46号文件，开展银行业“监管套利、空转套利、关联套利”专项治理的通知，要求银行于6月12日前将自查报告报送监管部门。46号文件总体上针对当前银行在同业业务、同业投资、理财业务等跨市场、交叉性金融业务中存在的杠杆高、嵌套多、链条长、套利多等问题开展专项治理。在银监会下发文件之后，保监会加强了对保险业万能险的管理，深圳保监局全面排查非寿险投资型产品风险。证监会加强对券商资管资金池业务的整理。监管措施的相继出台扭转了3月中、下旬债券市场偏乐观的情绪。监管政策旨在限制同业理财-委外投资-债券投资的套利链条，减少资金空转，防止脱实向虚，从而减少进入债券市场的银行资金，导致债券交易萎缩和杠杆去化。10年期国债收益率从3月27日的3.24%一路上行至4月24日的3.47%。之后，虽然出现短暂下行，但是，4月25日，中央政治局集体学习“维护国家金融安全”的议题，进一步强调了防范和化解金融风险的重要性。10年期国债收益率再次上行20bp，至5月11日的3.67%。

5月11日，据金融时报报道，央行召集三会加强监管政策沟通协调，避免竞争监管出现。12日，银监会召开近期重点工作通报会议。肖远企表示，对政策制度的落实也设定了过渡期，设有4-6个月的缓冲期，同时实行新老划断，对已发生的业务允许存续

到期自然消化，没有强行赎回等要求。银监会态度的缓和缓解了市场对于疾风暴雨式监管的担忧。此后，央行在公开市场上超额对冲到期的MLF，保证资金供给，平稳跨季。4月17日，央行开展4955亿MLF操作，对冲到期4515亿。5月12日，央行开展4590亿元MLF操作，对冲到期4095亿。6月6日，央行开展4980亿元的1年期MLF操作，对冲到期4313亿。6月5日重启28天逆回购，提供跨半年末资金。6月15、16、19三日，央行公开市场分别净投放900、2500、1100亿元。临近6月末，由于财政支出加大，银行间市场流动性较充裕，央行暂停了公开市场逆回购操作。

5月债券市场出现国债收益率期限倒挂。10年期国债收益率和3年、5年、7年均在二级市场出现倒挂。在国债和政策性金融债一级招标中，1、3、5年品种的招标结果也明显弱于7年和10年品种。市场对于短端的利率债配置需求不高，原因是银行负债高成本。5月中旬，股份行发行的6个月的同业存单的收益率在4.65%。相对这样的资金成本，短端利率债的收益率缺乏吸引力。从6月开始，国债供给量增大。6月7日，400亿1年期国债170009续发，中标利率3.67，与10年期国债收益率形成倒挂。在MPA考核压力下，同业存单发行利率于6月中旬大幅跳升。进入6月下旬，由于机构“屯钱效应”，同业存单被大量购买，收益率下行。6月20日，财政部首次开展随买操作，从二级市场购入12亿1年期国债。当日1年期债券收益率下降6个基点至3.52%，为3个月以来最大降幅。随买操作作为国债收益率短端打开下行空间。

二季度经济运行较平稳，并不是主导债券市场运行的主要矛盾。4月份公布的一季度GDP同比增长6.9%，超预期。由于返乡置业和棚改货币化安置的共同作用，三四线城市房地产销售好于普遍预期—对于黑色系商品价格提供支撑。CPI由于蔬菜和猪肉价格同比下降，总体上涨幅度较温和。PPI同比较一季度回落，但仍然在5.6%左右。值得一提的是，由于去杠杆的深入和监管逐步加强，金融体系主动调整业务降低内部杠杆，表现在与同业、资管、表外以及影子银行活动高度关联的商业银行股权及其他投资等科目扩张放缓，由此派生的存款及M2增速也相应下降。5月份M2同比增速9.6%，跌破10%。6月15日，美联储宣布上调联邦基金利率0.25%至1-1.25%。中国央行并未像3月份跟随美联储上调公开市场操作利率。相比3月份，此时人民币兑美元贬值压力已经大幅降低；外汇占款下降大幅减少（外汇储备估值增长）；中美1年期国债利率已由180bp上涨至240bp，10年期国债利率由85bp上涨至140bp，资本外流压力缓解。

展望下半年，经济增长预计保持平稳。进入四季度由于去年基数偏高，同比数据或有所下降。今后一段时间，对于国内债市的潜在风险主要有两方面：1) 监管政策的落地方式和执行力度，2) 海外主要央行收紧货币政策带来的外溢效应。从美联储6月份议息会议声明来看，最快将于9月份开始减少兑付本金再投资规模。并且，预计今年

还将有一次联邦基金利率上调。18年预计有三次联邦基金利率上调。6月27日，在欧洲央行行长会议上，德拉吉表示货币紧缩因素已经被通货再膨胀因素所取代，释放出了明年开始缩减量宽买债幅度的信号。预计欧央行从明年1月开始削减每月购债规模，从当前每月600亿欧元降至400亿欧元。承担了最大购债份额的德国央行已经开始减缓购债，因为预料到未来德债稀缺的困境。有鉴于此，我们认为在投资风格上应避免过于激进，保持适当的谨慎。

投资运作上，由于货币基金对于流动性要求很高，在配置债券上主要选取流动性较好的短久期品种，包括但不限于，政策性金融债、高等级信用债和同业存单。通过对于资金面进行阶段性判断，我们将适时调整杠杆水平。在对于整体市场趋势判断的基础上，博取杠杆和价差收益。

4.5 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0.9197%，中加货币C净值收益率为0.9798%，业绩比较基准收益率0.3418%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告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	6,396,521,118.72	34.77
	其中：债券	6,396,521,118.72	34.77
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	2,748,777,283.17	14.94
	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	9,100,069,143.45	49.46
4	其他资产	153,872,376.02	0.84

5	合计	18,399,239,921.36	100.00
---	----	-------------------	--------

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.46	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2017年04月01日	21.12	2017年3月28日和3月29日发生巨额赎回	3个交易日
2	2017年04月02日	21.12	2017年3月28日和3月29日发生巨额赎回	3个交易日
3	2017年04月03日	21.12	2017年3月28日和3月29日发生巨额赎回	3个交易日
4	2017年04月04日	21.12	2017年3月28日和3月29日发生巨额赎回	3个交易日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

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。

5.3.2 报告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	34.55	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	18.35	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	11.55	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	13.04	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	21.99	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.48	—

注：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。

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

注：本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期限超过240天的情形。

5.5 报告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	1,042,547,216.58	5.68
	其中：政策性金融债	1,042,547,216.58	5.68
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	369,900,082.29	2.02
6	中期票据	—	—
7	同业存单	4,984,073,819.85	27.17
8	其他	—	—
9	合计	6,396,521,118.72	34.87
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

5.6 报告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(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111720124	17广发银行 CD124	10,000,000	996,664,209.90	5.43
2	111719203	17恒丰银行 CD203	5,000,000	483,316,036.21	2.63
3	111780298	17贵州银行 CD032	5,000,000	476,894,443.02	2.60
4	170401	17农发01	4,710,000	469,814,344.16	2.56
5	111794029	17九江银行 CD063	4,000,000	387,222,643.29	2.11

6	111795323	17广西北部湾 银行CD031	3,700,000	365,247,725.04	1.99
7	111795974	17邯郸银行 CD047	3,000,000	295,904,533.70	1.61
8	111798780	17东营银行 CD053	3,000,000	293,775,370.90	1.60
9	111799582	17青岛银行 CD081	3,000,000	293,118,404.23	1.60
10	111795162	17广西北部湾 银行CD030	3,000,000	289,440,426.35	1.58

5.7 “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	0.0134%
报告期内偏离度的最低值	-0.0287%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0127%

5.7 报告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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本基金报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明。

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。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持1.00元。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。

5.9.2 本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。

5.9.3 其他资产构成

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	135,904,271.74
4	应收申购款	17,968,104.28
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	153,872,376.02

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中加货币A	中加货币C
报告期期初基金份额总额	1,287,193,732.23	12,848,284,110.63

报告期基金总申购份额	1,925,620,645.51	27,454,128,048.00
减：报告期基金总赎回份额	1,834,608,555.62	23,338,223,784.49
报告期期末基金份额总额	1,378,205,822.12	16,964,188,374.14

注：总申购份额中包含红利再投份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年04月 05日	840,487.01	840,487.01	—
2	红利再投	2017年05月 02日	699,547.06	699,547.06	—
3	赎回	2017年05月 23日	15,000,000.00	15,000,000.00	—
4	申购	2017年05月 23日	24,800,000.00	24,800,000.00	—
5	红利再投	2017年06月 01日	818,007.52	818,007.52	—
6	申购	2017年06月 30日	4,960,000.00	4,960,000.00	—
合计			47,118,041.59	47,118,041.59	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	20170401-20170418,20170427-20170503,20170519-20170522,2017	4,067,646.46 5.12	1,038,138.19 4.26	—	5,105,784.659.38	27.8400%

		0609- 20170630					
产品特有风险							
<p>本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。</p>							

注：

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人根据法律法规和基金合同约定，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，在履行适当程序后，于2017年3月17日至4月17日以通讯方式召开了中加货币市场基金基金份额持有人大会，在托管人代表、律师、公证员的监督见证下，经参与本次持有人大会的基金份额持有人及代理人投票表决，通过了《关于〈修改中加货币市场基金基金合同〉有关事项的议案》，该议案已于当日生效，并已向中国证监会备案。修订后的基金合同、托管协议、招募说明书已在指定媒介公布。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加货币市场基金设立的文件
- 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、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇一七年七月二十一日