
中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

2024年第2季度报告

2024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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月18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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月17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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	016083
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月29日
报告期末基金份额总额	505,851,063.14份
投资目标	紧密跟踪标的指数，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民

	币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	3,990,550.76
2.本期利润	4,148,658.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0048
4.期末基金资产净值	526,356,166.64
5.期末基金份额净值	1.0405

注：1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

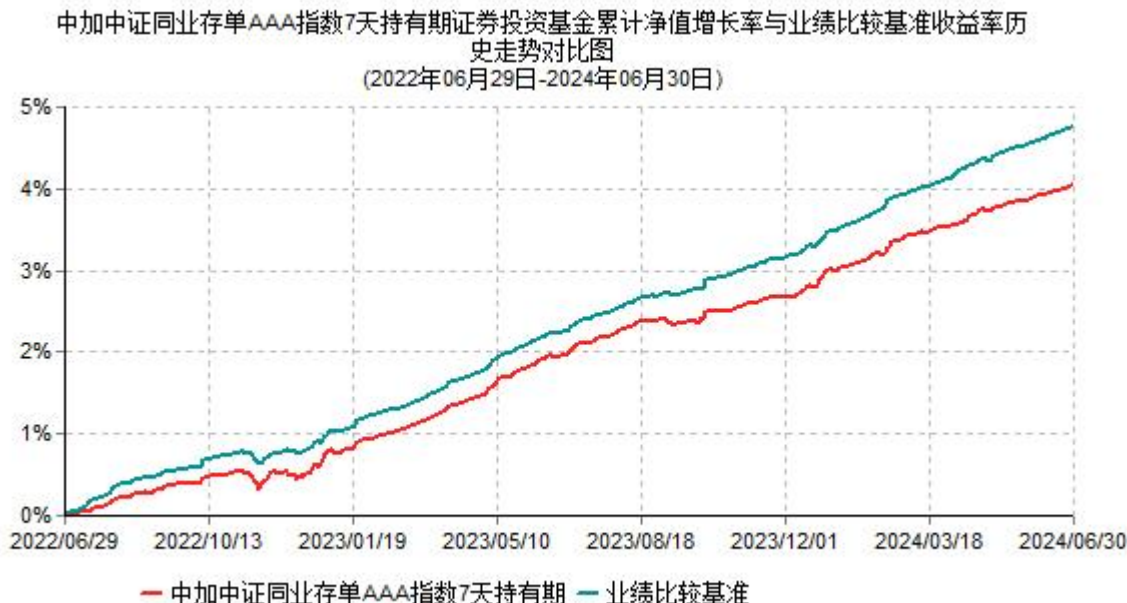
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.48%	0.01%	0.62%	0.01%	-0.14%	0.00%
过去六个月	1.00%	0.01%	1.25%	0.01%	-0.25%	0.00%
过去一年	1.99%	0.01%	2.42%	0.01%	-0.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.05%	0.02%	4.76%	0.01%	-0.71%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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		
魏泰源	本基金基金经理	2022-06-29	-	12	魏泰源先生，2011年至2020年，曾先后任中国银行司库助理投资经理；招商银行金融市场部投资经理、自营交易员；兴业基金管理有限公司基金经理；2020年加入中加基金管理有限公司，曾任中加颐智纯债债券型证券投资基金（2020年11月6日至2022年10月10日）、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金（2020年11月30日至2022年11月15日）、中加聚庆六个月定期开放

					<p>混合型证券投资基金（2020年12月14日至2024年2月26日）的基金经理，现任中加货币市场基金（2020年10月30日至今）、中加优选中高等级债券型证券投资基金（2020年11月6日至今）、中加颐合纯债债券型证券投资基金（2020年11月30日至今）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（2020年12月14日至今）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金（2021年6月24日至今）、中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金（2022年6月29日至今）、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金（2023年7月12日至今）、中加聚安60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金（2024年5月6日至今）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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遵规守信情况的说明

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部规章，制定了《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。本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易制度的相关规定，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，并且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进行分析。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%。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。本基金本报告期内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

二季度货币市场走势整体较为平稳，市场流动性延续合理充裕状态，整体资金面体感较为宽松，央行在公开市场持续投放流动性，整体政策面对资金面较为呵护，但季度末市场资金有所收敛，整体波动略有增大；货币市场利率在二季度呈现低位震荡态势，短期流动性虽然较为充裕，但资金利率基本维持在OMO利率附近，受此影响，包括短期利率债以及1Y国股存单在内的主要货币市场资产利率也呈现出窄区间震荡的行情。展望三季度，关注政府债发行对整体流动性的扰动，以及实体经济渐进式修复过程中有效需求的恢复程度以及可能导致的央行政策态度的边际改变。

组合操作方面，二季度组合整体保持了一个较为灵活的操作思路，根据市场情况稳妥调整组合仓位，控制组合回撤；展望未来，组合将继续密切跟踪标的指数，控制跟踪误差，提高组合业绩表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0405元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.48%，同期业绩比较基准收益率为0.62%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	495,368,045.22	94.04
	其中：债券	495,368,045.22	94.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,653,154.57	1.83
8	其他资产	21,719,692.16	4.12
9	合计	526,740,891.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,953,804.95	9.49
	其中：政策性金融债	49,953,804.95	9.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	445,414,240.27	84.62
9	其他	-	-
10	合计	495,368,045.22	94.11

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	2404103	24农发贴现03	500,000	49,953,804.95	9.49
2	112496061	24长沙银行CD063	500,000	49,749,747.54	9.45
3	112405148	24建设银行CD148	500,000	49,385,557.61	9.38
4	112498914	24南京银行CD129	500,000	49,375,050.00	9.38
5	112414042	24江苏银行CD042	500,000	49,335,343.97	9.37

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵州银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。招商银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。长沙银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。江苏银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。兴业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。农业发展银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和国家外汇管理局处罚。中国建设银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和中国人民银行处罚。南京银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和国家外汇管理局处罚。中国工商银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和国家外汇管理局处罚。农业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和国家外汇管理局处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其他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。

5.11.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,519.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,708,172.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,719,692.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	2,658,398,860.87
报告期期间基金总申购份额	863,080,138.59
减：报告期期间基金总赎回份额	3,015,627,936.32
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	505,851,063.14

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；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情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

§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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金设立的文件
- 2、《中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》
- 3、《中加中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》
- 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

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

2024年07月18日