中加丰泽纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年04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2019年4月16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2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加丰泽纯债债券
基金主代码	003417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
报告期末基金份额总额	826,490,499.66份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,通过定量分析增强组合策略操作的方法,确定资产在基础配置,行业配置,公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果,利用自主开发的信用分析系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括:期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种。
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(2019年01月01日－2019年03月31日)
1.本期已实现收益	11,445,093.11
2.本期利润	14,037,500.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0178
4.期末基金资产净值	897,727,448.46
5.期末基金份额净值	1.086

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。

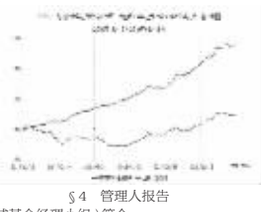
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	1.67%	0.08%	0.47%	0.05%	1.20%	0.03%

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		
杨宇俊	本基金基金经理	2016-12-19	-	11	杨宇俊先生,金融工程博士,北京银行博士后,具有多年债券市场投资研究经验。曾任北京银行总行资金交易部分析师,负责债券市场和货币市场的研究与投资工作。2013年加入中加基金,任专户投资经理,具备基金从业资格。现任中加瑞盈债券型证券投资基金基金经理(2016年3月23日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今)、中加丰尚纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年8月19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)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年11月2日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2016年11月11日至今)、中加丰裕纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年11月20日至今)、中加顺兴定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年6月8日至今)、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金基金经理(2019年1月17日至今)

1、任职日期说明:杨宇俊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《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,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

2019年第一季度,债市维持震荡走势。以10年期国债为例,该品种收益率从年初的3.61%震荡下行至3.47%的低位后逐渐上行至季末的3.58%。主要原因是,年初市场对经济预期较为悲观,加上央行再次下调存款准备金率, 货币市场资金面宽松使得各期限利率出现下行走势,但春节过后随着股票市场上涨带来风险偏好上升,猪肉价格快速上涨使得通胀预期升温,以及信贷社融的启稳回升引发经济见底启稳预期,国内债市持续承压,债市收益率开始缓慢上行。

展望二季度,债市的不确定性加大。一是市场对经济的预期差将决定市场走势,当前市场对经济一季度是否是全年低点的分歧加大;二是央行的货币政策进入观察期后下一步操作决定市场方向; 三是猪周期启动后通胀走势成为重要变量;四是风险偏好面临反复将持续对市场产生重大影响。但我们认为总体而言,债券市场的牛市未尽,机会是跌出来的,待收益率反弹到历史均值附近后,将迎来较好的波段操作机会。

本报告期内,通过对经济基本面、资金面、政策面、市场情绪等的密切跟踪和预判,积极调整组合杠杆和久期水平,及时进行券种切换,严格甄别个券的估值和信用风险,把握住了这波收益率波动的行情,提高了组合的收益水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加丰泽纯债债券基金份额净值为1.086元,本报告期内,基金份额净值增长率为1.67%,同期业绩比较基准收益率为0.47%。

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	1,161,917,400.00	98.10
	其中:债券	1,161,917,400.00	98.10
	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	3,425,426.72	0.29
8	其他资产	19,125,739.34	1.61
9	合计	1,184,468,566.06	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	98,900,200.00	11.02
	其中:政策性金融债	98,900,200.00	11.02
4	企业债券	433,086,200.00	48.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	600,906,000.00	66.94
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,025,000.00	3.23
9	其他	-	-
10	合计	1,161,917,400.00	129.43

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	101801238	18甘国投MTN001	600,000	61,128,000.00	6.81
2	136313	16西高科	600,000	59,238,000.00	6.60
3	124302	12挂交投	500,000	52,545,000.00	5.85
4	101800606	18滨海高新MTN001	500,000	52,220,000.00	5.82
5	101801252	18鄂联投MTN005A	500,000	51,210,000.00	5.70

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 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本报告期内,本基金未投资于股票,不存在投资的前十名股票超过基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,194.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,083,544.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	19,125,739.34

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	780,633,220.29
报告期期间基金总申购份额	45,857,279.37
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	826,490,499.66

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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	20190101-20190331	695,194,528.02	0.00	0.00	695,194,528.02	84.11%	
产品特有风险								
本基金本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。								

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丰泽纯债债券型证券投资基金设立的文件

2、《中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金合同》

3、《中加丰泽纯债债券型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、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:北京市西城区金融街3号A座

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

2019年04月18日

中加货币市场基金

2019年第一季度报告

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:2019年04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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月16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2019年01月01日起至2019年03月31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	29,374,099,633.51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)流动投资策略;(6)流动性管理策略	
业绩比较基准	七天通知存款利率(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。	
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	1,563,473,765.32份	27,810,625,868.19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(2019年01月01日－2019年03月31日)	
	中加货币A	中加货币C
1.本期已实现收益	11,134,646.66	269,324,580.72
2.本期利润	11,134,646.66	269,324,580.72
3.期末基金资产净值	1,563,473,765.32	27,810,625,868.19

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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

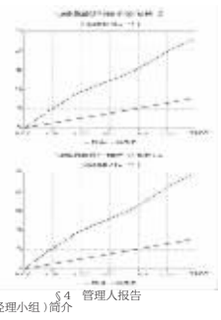
中加货币A净值表现

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	0.6762%	0.0018%	0.3381%	0.0000%	0.3381%	0.0018%

中加货币C净值表现

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	0.7357%	0.0018%	0.3381%	0.0000%	0.3976%	0.0018%

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



§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		
同沛贤	投资研究部副总监兼固定收益部总监、本基金基金经理	2013-10-21	-	11	同沛贤,英国帝国理工大学金融学硕士、伯明翰大学计量机硕士学位。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,曾任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2018年6月22日)。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)、中加融合纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年9月13日至今)、中加聚鑫纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年11月8日至今)、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理(2018年11月27日至今)、中加顺兴定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年12月13日至今)。

1、任职日期说明:同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《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,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

2019年第一季度,债券收益率震荡上行,尤其是利率债收益率的波动幅度明显增大。负面因素一是来自于社融数据的触底企稳,以及经济数据较预期中更为稳健,纠偏了此前过于悲观的经济预期;二是由于货币政策并未如期进行继续宽松,而是进入了类"观察期"的阶段;市场普遍预期的4月份降准并未到来,反而央行进行了高调辟谣,使得降准的预期短期落空;三是非洲猪瘟导致生猪存栏量大幅下滑,市场对猪周期提前启动以及猪肉从底部反弹的高度有很高的预期,对通胀的担忧上升;四是股市春节后高歌猛进,一扫颓势,市场风险偏好的提升对债券特别是利率债和高等级信用债有较明显的打击。从收益率绝对水平的历史分位数来看,确实利率债和高等级信用债的收益率都处于历史较低水平,在这种位置收益率的阻力最小方向暂时为向上调整。

但不能忽视的是,经济企稳尚需更时间,也需要数据的验证。特别是占比较高的三四线房地产销售一直向下,而房地产又坚持房住不炒,其后所带来的连锁效应,还未发挥威力。基建的对冲,也受制于地方政府隐性债务的控制,消费是否可以独立支撑?而今年利率债波段机会就来自于大跌之后的修复。

报告期内,基金进行了部分信用债的配置,以短久期中高评级的债券为主,匹配基金的开放期长度;并适当投资了部分长久期高评级的信用债,进行波段操作。此外,基金积极抓住机会进行可转债的打新操作,以增厚收益。后续遇机会可进行利率债波段操作提升收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加聚鑫纯债一年A基金份额净值为1.0698元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.86%,同期业绩比较基准收益率为0.47%;截至报告期末中加聚鑫纯债一年C基金份额净值为1.0649元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.78%,同期业绩比较基准收益率为0.47%。

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	656,696,200.00	95.91
	其中:债券	656,696,200.00	95.91
	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	9,950,214.93	1.45
	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	5,338,968.14	0.78
8	其他资产	12,693,474.44	1.85
9	合计	684,678,857.51	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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	8.29
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	3,320,277,119.81	11.30
	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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未出现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	44.75	11.30
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	2.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	38.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.75	11.30

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	2,141,057,085.36	7.29
	其中:政策性金融债	2,141,057,085.36	7.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,000,000.00	0.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	16,658,188,780.87	56.71
8	其他	-	-
9	合计	18,999,245,866.23	64.68
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

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	111819459	18恒丰银行CD459	15,000,000	1,479,321,296.17	5.04
2	160420	16农发20	11,700,000	1,168,912,437.65	3.98
3	111819356	18恒丰银行CD356	10,000,000	994,272,125.32	3.38
4	111906598	19盛京银行CD019	8,500,000	835,408,091.12	2.84
5	111906353	19宁波银行CD015	7,500,000	749,045,649.15	2.55
6	111888254	18宁波银行CD221	7,000,000	698,128,711.58	2.38
7	111887816	18锦州银行CD237	6,000,000	593,090,743.83	2.02
8	111819621	18恒丰银行CD521	5,500,000	549,954,105.02	1.87
9	111886813	18成都银行CD240	5,400,000	535,243,069.25	1.82
10	111894953	18江西银行CD038	5,000,000	499,672,578.60	1.70

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	0.1053%
报告期内偏离度的最低值	0.0320%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0646%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金未发生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

本报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本报告期编制日前一年内,恒丰银行2018年1月16日-2018年11月2日期间因违规办理票据业务、虚增存贷款、信贷资金入股市、违法违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票、严重违法审慎经营原则、违法违规办理商业承兑汇票转贴现业务、违规办理无真实贸易背景的银行承兑汇票、采取不正当手段违规发放贷款、违法违规办理票据业务员、内控管理失控严重违反审慎经营规则、内控管理不到位严重违反审慎经营规则、对支行内控管理失控严重违反审慎经营规则未进行有效监督、银行承兑汇票贴现资金回流出票人账户用作开立银行承兑汇票保证金、银行承兑汇票业务贸易背景审查不严格、违规办理银行承兑汇票业务、贸易背景真实性审查不审慎、企业信贷资金用途管理不到位等原因受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚743万元。

本报告期内,本基金投资的其他前九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	135,991,274.63
4	应收申购款	114,064,849.13
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	250,056,123.76

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	1,651,176,996.54	19,354,321,646.12
报告期期间基金总申购份额	1,137,010,730.56	42,242,231,993.30
报告期期间基金总赎回份额	1,224,713,961.79	33,789,927,771.23
报告期期末基金份额总额	1,563,473,765.32	27,810,625,868.19

注:总申购份额含红利再投、转换入和分级份额调增份额;总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§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	2019-01-02	784,837.53	784,837.53	-
2	红利再投	2019-02-01	761,029.37	761,029.37	-
3	红利再投	2019-03-01	637,429.74	637,429.74	-
4	申购	2019-03-28	42,984,118.00	42,984,118.00	-
合计			45,167,414.64	45,167,414.64	

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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	20190101-20190331	290,661,589.72	0.00	0.00	290,661,589.72	62.16%	
产品特有风险								
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。								

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复文件、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:北京市西城区大手桥大街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