

中加货币市场基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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:2024 年 03 月 28 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2024年3月27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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 债券回购融资情况	56
8.3 基金投资组合平均剩余期限	57
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	59
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	59
8.8 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	60
8.9 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	61

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.4 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	63
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	66
11.9 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	67
12.1 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	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§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	8,608,060,486.83份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中加货币A	中加货币C	中加货币E
下属分级基金的交易代码	000331	000332	020097
报告期末下属分级基金的份额总额	811,377,693.68份	7,796,369,370.01份	313,423.14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。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（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	刘凌	石立平
	联系电话	400-00-95526	010-63639180
	电子邮箱	service@bobbns.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-00-95526	95595
传真		010-83197627	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		100050	100033
法定代表人		夏远洋	王江

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023年			2022年			2021年		
	中加货币A	中加货币C	中加货币E	中加货币A	中加货币C	中加货币E	中加货币A	中加货币C	中加货币E
本期已实现收益	15,19 5,36 4.92	288,5 41,13 1.98	35 8.2 9	13,35 6,57 5.45	232,7 89,33 0.78	-	16,69 9,66 2.28	351,62 8,833. 63	-
本期利润	15,19 5,36 4.92	288,5 41,13 1.98	35 8.2 9	13,35 6,57 5.45	232,7 89,33 0.78	-	16,69 9,66 2.28	351,62 8,833. 63	-
本期净值收益率	1.895 3%	2.139 0%	0.1 72 6%	1.613 5%	1.857 2%	-	1.971 0%	2.215 7%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023年末			2022年末			2021年末		
期末基金资产净值	811,3 77,69 3.68	7,796, 369,3 70.01	31 3,4 23. 14	789,3 54,48 6.94	8,625, 631,0 41.75	-	814,7 10,99 0.37	10,23 3,286, 037.19	-
期末基金份额净值	1.000 0	1.000 0	1.0 000	1.000 0	1.000 0	-	1.000 0	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2023年末			2022年末			2021年末		
累计净值收益率	34.61 17%	37.92 66%	0.1 72 6%	32.16 06%	35.10 26%	-	30.06 21%	32.639 2%	-

注：1、所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。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、本基金自2023年12月1日起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

中加货币A

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
过去三个月	0.4808%	0.0020%	0.3456%	0.0000%	0.1352%	0.0020%
过去六个月	0.9265%	0.0017%	0.6924%	0.0000%	0.2341%	0.0017%
过去一年	1.8953%	0.0030%	1.3781%	0.0000%	0.5172%	0.0030%
过去三年	5.5741%	0.0025%	4.1916%	0.0000%	1.3825%	0.0025%
过去五年	10.2384%	0.0024%	7.0872%	0.0000%	3.1512%	0.0024%
自基金合同 生效起至今	34.6117%	0.0056%	14.9868%	0.0000%	19.6249%	0.0056%

中加货币C

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
过去三个月	0.5413%	0.0020%	0.3456%	0.0000%	0.1957%	0.0020%
过去六个月	1.0481%	0.0017%	0.6924%	0.0000%	0.3557%	0.0017%
过去一年	2.1390%	0.0030%	1.3781%	0.0000%	0.7609%	0.0030%
过去三年	6.3334%	0.0025%	4.1916%	0.0000%	2.1418%	0.0025%
过去五年	11.5630%	0.0024%	7.0872%	0.0000%	4.4758%	0.0024%
自基金合同 生效起至今	37.9266%	0.0056%	14.9868%	0.0000%	22.9398%	0.0056%

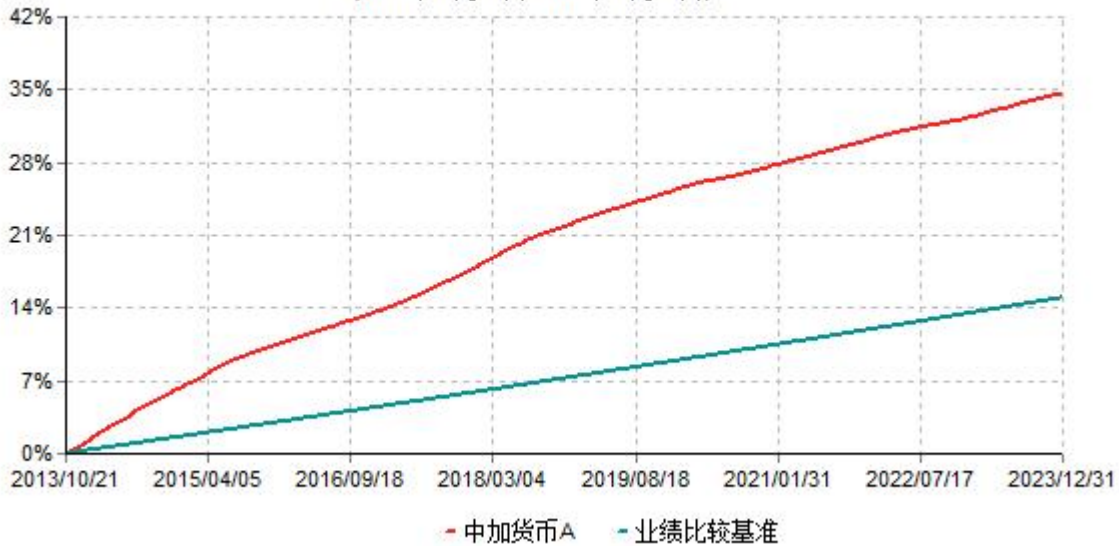
中加货币E

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
自基金合同	0.1726%	0.0028%	0.1051%	0.0000%	0.0675%	0.0028%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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A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-2023年12月31日)



中加货币C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-2023年12月31日)

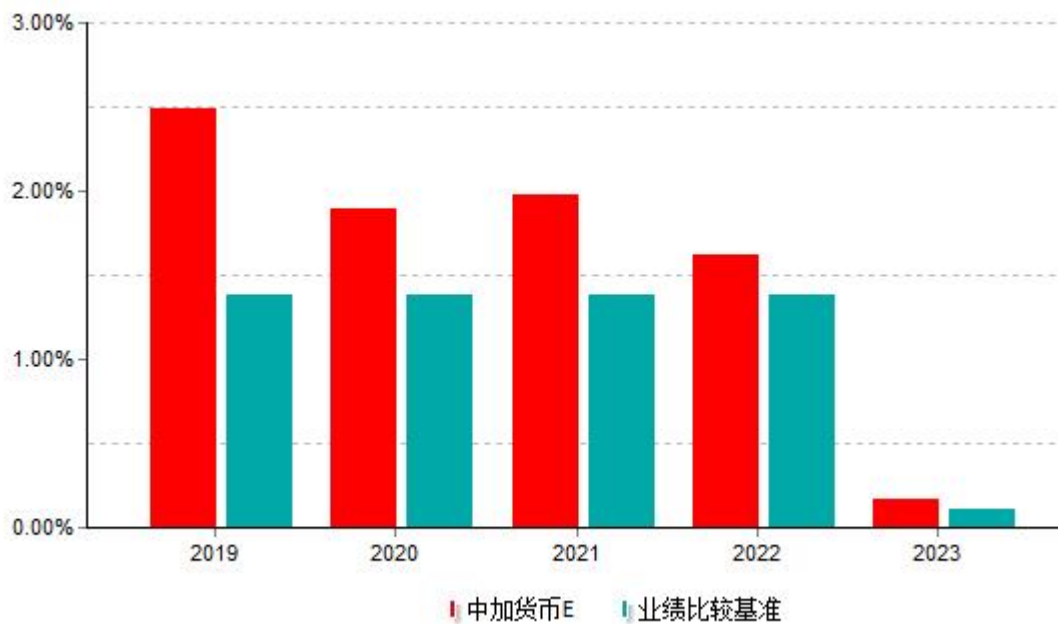


中加货币E累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年12月04日-2023年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：（1）本基金自2023年12月1日起收益分配按日结转份额。

（2）本基金于2023年12月1日增设E类基金份额，份额首次确认日为2023年12月4日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

中加货币A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023年	16,939,982.72	497,953.53	-2,242,571.33	15,195,364.92	-
2022年	14,625,017.58	778,353.58	-2,046,795.71	13,356,575.45	-
2021年	17,675,455.04	2,017,882.48	-2,993,675.24	16,699,662.28	-
合计	49,240,455.34	3,294,189.59	-7,283,042.28	45,251,602.65	-

中加货币C

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023年	216,716,646.78	78,509,466.80	-6,684,981.60	288,541,131.98	-
2022年	154,307,560.57	84,640,428.75	-6,158,658.54	232,789,330.78	-
2021年	277,308,296.52	79,981,716.40	-5,661,179.29	351,628,833.63	-
合计	648,332,503.87	243,131,611.95	-18,504,819.43	872,959,296.39	-

中加货币E

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023年	318.38	0.04	39.87	358.29	-
合计	318.38	0.04	39.87	358.29	-

§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，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理七十三只基金，分别是中加货币市场基金、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、中加丰润纯债债券型证券投资基金、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金、中加颐睿纯债债券型证券投资基金、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金、中加科盈混合型证券投资基金、中加优享纯债债券型证券投资基金、中加瑞享纯债债券型证券投资基金、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金、中加核心智造混合型证券投资基金、中加优势企业混合型证券投资基金、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金、中加中证 500 指数增强型证券投资基金、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金、中加中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金、中加消费优选混合型证券投资基金、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金、中加中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金、中加龙头精选混合型证券投资基金、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金、中加量化研选混合型证券投资基金、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中债-新综合债券指数发起

式证券投资基金、中加医疗创新混合型发起式证券投资基金、中加安瑞积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

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		
魏泰源	本基金基金经理	2020-10-30	-	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）、中加科瑞混合型证券投资基金（2021年10月26日至2022年12月5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

					聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（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）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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》中关于证券投资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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

4.3.2 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，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.3 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 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

2023年全年货币市场走势整体偏震荡，一季度整体保持较为中性态势，进入二季度，随着经济恢复不及预期，实体经济实际有效需求偏弱，流动性整体淤积在银行间市场，资金中枢显著下行，带动各类货币市场资产利率显著下行，进入三季度后半段，随着地方政府债大规模发行以及促进资金从金融市场流向实体的各项举措的落地，银行间市场资金中枢显著抬升，包括同业存单在内的货币市场各类资产利率也显著上行，上行持续到12月中旬有所缓和，利率逐步见顶。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.8953%，同期业绩比较基准收益率为1.3781%；截至报告期末中加货币C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为2.1390%，同期业绩比较基准收益率为1.3781%；截至报告期末中加货币E基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.1726%，同期业绩比较基准收益率为0.1051%。

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2024年，实体经济有效需求的恢复程度依然是决定银行间资金市场利率中枢的重要宏观背景，而地方债以及国债的发行节奏等因素，将是影响资金波动的重要因素，预计在经济依然处于逐步恢复的过程中，维持一个较好的金融环境依然较为必要，预计

整体银行间流动性也将延续合理充裕的整体环境，主要市场利率围绕政策利率波动的格局将得到持续。

组合操作方面，组合整体侧重流动性管理，总体策略保持稳健；展望未来，组合将继续在流动性、安全性、收益性中取得平衡，在确保流动性安全的前提下，为持有人创造最大的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规，切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、监察稽核部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司监察稽核部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体、严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

4.7 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。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、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（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），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。公司分管风险管理业务的副总经理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、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），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，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，中加基金管理有限公司自2023年12月1日起修改本基金的收益分配原则，收益分配方式由“每日分配，按月支付”变更为“每日分配，按日支付”。

(2) 本报告期内，本基金中加货币A已实现收益为15,195,364.92元，合计分配：15,195,364.92元；中加货币C已实现收益为288,541,131.98元，合计分配：288,541,131.98元；中加货币E已实现收益为358.29元，合计分配：358.29元。

4.9 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中加货币市场基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集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，对本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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集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运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对中加基金管理有限公司编制的《中加货币市场基金2023年年度报告》进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容是真实、准确。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2404035号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中加货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中加货币市场基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“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的规定编制,公允反映了该基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报

	<p>告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人中加基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2023年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2所列示的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的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于</p>

舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的

	内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	管祎铭、贾君宇
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2024-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中加货币市场基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,486,651,397.24	1,917,930,430.21
结算备付金		-	-
存出保证金		45,039.65	36,140.44
交易性金融资产	7.4.7.2	6,009,500,502.78	4,700,347,128.94
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,009,500,502.78	4,700,347,128.94
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,039,954,014.72	2,612,807,779.27
应收清算款		-	198,090,272.53
应收股利		-	-
应收申购款		46,912,245.00	24,804.26
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		9,583,063,199.39	9,429,236,555.65
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		970,270,421.35	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	49.60
应付管理人报酬		2,199,714.09	2,640,744.93
应付托管费		499,934.99	717,427.14
应付销售服务费		266,036.62	262,789.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		108,023.42	26,153.56
应付利润		1,079,129.67	10,006,642.73
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	579,452.42	597,219.16
负债合计		975,002,712.56	14,251,026.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	8,608,060,486.83	9,414,985,528.69
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		8,608,060,486.83	9,414,985,528.69
负债和净资产总计		9,583,063,199.39	9,429,236,555.65

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额8,608,060,486.83份；其中，中加货币A基金份额净值1.0000元，基金份额总额811,377,693.68份；中加货币C基金份额净值1.0000元，基金份额总额7,796,369,370.01份；中加货币E基金份额净值1.0000元，基金份额总额313,423.14份。

7.2 利润表

会计主体：中加货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		367,300,553.81	325,121,586.58
1.利息收入		183,346,080.32	189,324,286.35
其中：存款利息收入	7.4.7.9	78,905,321.93	96,760,000.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		104,440,758.39	92,564,286.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		183,954,473.49	135,797,300.23
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	183,954,473.49	135,797,300.23
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.18	-	-

减：二、营业总支出		63,563,698.62	78,975,680.35
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	32,728,813.25	46,075,405.46
2.托管费	7.4.10.2.2	7,438,366.50	13,879,445.57
3.销售服务费	7.4.10.2.3	3,428,331.13	3,412,358.45
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		19,693,977.38	15,361,500.14
其中：卖出回购金融资产支出		19,693,977.38	15,361,500.14
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		42,010.36	14,890.73
8.其他费用	7.4.7.20	232,200.00	232,080.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		303,736,855.19	246,145,906.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		303,736,855.19	246,145,906.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		303,736,855.19	246,145,906.23

7.3 净资产变动表

会计主体：中加货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	9,414,985,528.69	-	9,414,985,528.69
二、本期期初净资产	9,414,985,528.69	-	9,414,985,528.69
三、本期增减变动	-806,925,041.86	-	-806,925,041.86

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	303,736,855.19	303,736,855.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-806,925,041.86	-	-806,925,041.86
其中：1.基金申购款	94,392,925,415.79	-	94,392,925,415.79
2.基金赎回款	-95,199,850,457.65	-	-95,199,850,457.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-303,736,855.19	-303,736,855.19
四、本期期末净资产	8,608,060,486.83	-	8,608,060,486.83
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,047,997,027.56	-	11,047,997,027.56
二、本期期初净资产	11,047,997,027.56	-	11,047,997,027.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,633,011,498.87	-	-1,633,011,498.87
（一）、综合收益总额	-	246,145,906.23	246,145,906.23
（二）、本期基金份额交易产生的净	-1,633,011,498.87	-	-1,633,011,498.87

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	108,422,137,015.95	-	108,422,137,015.95
2.基金赎回款	-110,055,148,514.82	-	-110,055,148,514.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-246,145,906.23	-246,145,906.23
四、本期期末净资产	9,414,985,528.69	-	9,414,985,528.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

夏远洋

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

7.4 报表附注

7.4.1 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》(以下简称“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。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中加货币市场基金招募说明书》的相关内容，本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量进行基金份额类别划分。A类、C类和E类三类基金份额，三类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，三类基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别，不同基金份额类别之间不得互相转换，但依据招募说明书约定因认购、申购、赎回、基金转换等交易而发生基金份额自动升级或者降级的除外。当投资者在单个基金账户保留的A类基金份额达到C类基金份额的最低份额要求500万份时，登记机构自动将投资者在该基金账户保留的A类基金份额全部升级为C类基金份额。当投资者在单个基金账户保留的C类基金份额不能满足C类基金份额最低份额要求500万份时，登记机构自动将投资者在该基金账户保留的C类基金份额全部降级为A类基金份额，E类基金份额不进行基金份额升降级。。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《货币市场基金监督管理办法》、基金合同和《中加货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为现金；期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债券融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合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和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，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<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的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的规定要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况、2023年年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自2023年1月1日至2023年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

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，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于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以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 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，且该种法定权利是当前可执行的；
- (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。

7.4.4.7 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份额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，以及因类别调整而引起的A、C、E级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认利息收入。

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，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实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

7.4.4.9 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.10 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。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益等于零，则保持投资人基金份额不变；若当日净收益小于零，则相应缩减投资人基金份额；若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除。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。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	55,580,647.96	530,125.70
等于：本金	55,570,334.91	486,682.01
加：应计利息	10,313.05	43,443.69
减：坏账准备	-	-
定期存款	2,431,070,749.28	1,917,400,304.51
等于：本金	2,410,000,000.00	1,900,000,000.00
加：应计利息	21,070,749.28	17,400,304.51
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	800,633,055.66	400,199,999.98
存款期限3个月以上	1,630,437,693.62	1,517,200,304.53
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

减：坏账准备	-	-
合计	2,486,651,397.24	1,917,930,430.21

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,009,500,502.78	6,009,663,694.59	163,191.81	0.0019
	合计	6,009,500,502.78	6,009,663,694.59	163,191.81	0.0019
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,009,500,502.78	6,009,663,694.59	163,191.81	0.0019
项目		上年度末 2022年12月31日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,700,347,128.94	4,696,189,958.36	-4,157,170.58	-0.0442
	合计	4,700,347,128.94	4,696,189,958.36	-4,157,170.58	-0.0442
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,700,347,128.94	4,696,189,958.36	-4,157,170.58	-0.0442

注：本基金于本报告期末及上年度末交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

1. 偏离金额=影子定价 - 摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,039,954,014.72	-
合计	1,039,954,014.72	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,612,807,779.27	-
合计	2,612,807,779.27	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	0.40
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	375,452.42	393,218.76
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	375,452.42	393,218.76
应付利息	-	-
预提费用-审计费	75,000.00	75,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提费用-账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	579,452.42	597,219.16

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 中加货币A

金额单位：人民币元

项目 (中加货币A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	789,354,486.94	789,354,486.94
本期申购	1,404,086,124.68	1,404,086,124.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,382,062,917.94	-1,382,062,917.94
本期末	811,377,693.68	811,377,693.68

7.4.7.7.2 中加货币C

金额单位：人民币元

项目 (中加货币C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,625,631,041.75	8,625,631,041.75
本期申购	92,988,483,996.82	92,988,483,996.82
本期赎回（以“-”号填列）	-93,817,745,668.56	-93,817,745,668.56
本期末	7,796,369,370.01	7,796,369,370.01

7.4.7.7.3 中加货币E

金额单位：人民币元

项目 (中加货币E)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	355,294.29	355,294.29
本期赎回（以“-”号填列）	-41,871.15	-41,871.15
本期末	313,423.14	313,423.14

注：申购含转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 中加货币A

单位：人民币元

项目 (中加货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	15,195,364.92	-	15,195,364.92
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	-15,195,364.92	-	-15,195,364.92
本期末	-	-	-

7.4.7.8.2 中加货币C

单位：人民币元

项目 (中加货币C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-

本期利润	288,541,131.98	-	288,541,131.98
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	-288,541,131.98	-	-288,541,131.98
本期末	-	-	-

7.4.7.8.3 中加货币E

单位：人民币元

项目 (中加货币E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	358.29	-	358.29
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	-358.29	-	-358.29
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	429,811.35	450,930.81
定期存款利息收入	77,723,833.66	95,578,580.07
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	142,918.65	64,734.11
其他	608,758.27	665,755.24

合计	78,905,321.93	96,760,000.23
----	---------------	---------------

注：本报告期内及上年度其他均为存出保证金利息收入和申购款利息收入

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期及上年度均无股票投资收益。

7.4.7.11 基金投资收益

本基金在报告期内及上年度均无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	168,551,131.43	111,745,756.22
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	15,403,342.06	24,051,544.01
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	183,954,473.49	135,797,300.23

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	62,025,999,435.74	82,676,434,882.70

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	61,792,000,000.00	82,419,000,000.00
减：应计利息总额	218,598,203.68	233,382,523.66
减：交易费用	-2,110.00	815.03
买卖债券差价收入	15,403,342.06	24,051,544.01

7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期及上年度均无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他衍生工具投资。

7.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	75,000.00	75,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	35,880.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	232,200.00	232,080.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

本报告期不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。

7.4.9.2 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、基金注册登记机构及基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
The Bank of Nova Scotia	基金管理人股东

中国有研科技集团有限公司	基金管理人股东
北京乾融投资（集团）有限公司	基金管理人股东
中地种业（集团）有限公司	基金管理人股东
绍兴越华开发经营有限公司	基金管理人股东
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
北银国际资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	32,728,813.25	46,075,405.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,705,922.08	3,250,122.25
应支付基金管理人的净管理费	30,022,891.17	42,825,283.21

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乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 管理费率 / 当年天数

2022年12月16日前，本基金管理费率为0.33%。本基金管理人自2022年12月16日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为0.22%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,438,366.50	13,879,445.57

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乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 托管费率 / 当年天数

2022年12月16日前，本基金管理费率为0.10%。本基金管理人自2022年12月16日起对本基金实施调整后的基金托管费率，调整后的基金托管费率为0.05%。

7.4.10.2.3 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 2023年01月01日至2023年12月31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	中加货币E	合计
中加基金 管理有限 公司	75,205.57	1,098,208.69	1.19	1,173,415.45
北京银行	1,837,179.32	2,716.27	0.00	1,839,895.59

股份有限公司				
中国光大银行股份有限公司	14,665.61	0.00	0.00	14,665.61
合计	1,927,050.50	1,100,924.96	1.19	3,027,976.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	中加货币E	合计
中加基金管理有限公司	71,623.32	1,067,349.35	0.00	1,138,972.67
北京银行股份有限公司	1,900,054.43	1,974.60	0.00	1,902,029.03
中国光大银行股份有限公司	15,446.32	0.00	0.00	15,446.32
合计	1,987,124.07	1,069,323.95	0.00	3,056,448.02

注：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，逐日累计至每月月末，按月支付。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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人中加基金向基金托管人光大银行发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后由基金管理人按照相关合同规定支付给各基金销售机构。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。计算公式为：各类基金份额每日应计提的销售服务费=各类基金份额前一日基金资产净值×年销售服务费率/当期天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国光大银行股份有限公司	-	-	-	-	200,005,000.00	18,904.58

本基金上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中加货币C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	416,796,448.57	386,754,968.89
报告期间申购/买入总份额	135,624,240.49	30,041,479.68
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	242,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	310,420,689.06	416,796,448.57
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.98%	4.83%

报告期内基金管理人未投资本基金A类、E类份额。

7.4.10.5.2 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

中加货币C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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
北京银行股份有限公司	1,000,573,155.12	12.8300%	500,000,000.00	5.8000%
北银丰业资产管理有限公司	353,230,457.73	4.5300%	388,197,440.76	4.5000%
中国光大银行股份有限公司	300,056,926.11	3.8500%	0.00	0.0000%

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金A类、E类份额。

7.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	55,580,647.96	429,811.35	530,125.70	450,930.81
北京银行股份有限公司	-	1,236,833.69	301,628,999.64	25,478,998.72

注：本基金的活期存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金

中加货币A

单位：人民币元

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
16,939,982.72	497,953.53	-2,242,571.33	15,195,364.92	-

中加货币C

单位：人民币元

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
216,716,646.78	78,509,466.80	-6,684,981.60	288,541,131.98	-

中加货币E

单位：人民币元

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
318.38	0.04	39.87	358.29	-

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

于2023年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2023年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额970,270,421.35元，是以如下债券作为质押：

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
112306204	23交通银行CD204	2024-01-02	98.60	718,000	70,795,000.03
210213	21国开13	2024-01-02	100.37	790,000	79,289,317.79
210409	21农发09	2024-01-02	100.32	6,769,000	679,040,942.77
230304	23进出04	2024-01-02	101.08	1,068,000	107,954,621.69
230406	23农发06	2024-01-02	101.35	984,000	99,727,233.91
合计				10,329,000	1,036,807,116.19

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2023年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

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方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。

7.4.13.2 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和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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。

7.4.13.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	590,390,089.48	598,367,746.03
合计	590,390,089.48	598,367,746.03

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的短期融资券。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	3,877,411,347.28	3,671,919,827.40
A-1以下	597,734,111.28	348,486,808.01

未评级	-	-
合计	4,475,145,458.56	4,020,406,635.41

注：短期同业存单A-1所填列的同业存单均为主体评级为AAA的短期同业存单；短期同业存单A-1以下所填列的同业存单均为主体评级为AAA以下的短期同业存单。

7.4.13.2.4 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	40,023,203.52	-
未评级	903,941,751.22	81,572,747.50
合计	943,964,954.74	81,572,747.50

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）计息但该利息金额不重大以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然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度缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	65,657,730.80	1,607,939,445.14	813,054,221.30	-	-	-	2,486,651,397.24

存出保证金	45,039.65	-	-	-	-	-	45,039.65
交易性金融资产	645,488,484.89	1,831,753,204.11	3,532,258,813.78	-	-	-	6,009,500,502.78
买入返售金融资产	1,039,954,014.72	-	-	-	-	-	1,039,954,014.72
应收申购款	-	-	-	-	-	46,912,245.00	46,912,245.00
资产总计	1,751,145,270.06	3,439,692,649.25	4,345,313,035.08	-	-	46,912,245.00	9,583,063,199.39
负债							
卖出回购金融资产款	970,270,421.35	-	-	-	-	-	970,270,421.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,199,714.09	2,199,714.09
应付托管费	-	-	-	-	-	499,934.99	499,934.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	266,036.62	266,036.62
应交税费	-	-	-	-	-	108,023.42	108,023.42
应付利润	-	-	-	-	-	1,079,129.67	1,079,129.67
其他负债	-	-	-	-	-	579,452.42	579,452.42
负债总计	970,270,421.35	-	-	-	-	4,732,291.21	975,002,712.56
利率敏感度缺口	780,874,848.71	3,439,692,649.25	4,345,313,035.08	-	-	42,179,953.79	8,608,060,486.83
上年度末 2022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							
货币资	400,730,125.68	809,337,332.48	707,862,972.05	-	-	-	1,917,930,430.2

金							1
存出保证金	36,140.44	-	-	-	-	-	36,140.44
交易性金融资产	867,309,231.59	2,043,261,037.39	1,789,776,859.96	-	-	-	4,700,347,128.94
买入返售金融资产	2,612,807,779.27	-	-	-	-	-	2,612,807,779.27
应收清算款	-	-	-	-	-	198,090,272.53	198,090,272.53
应收申购款	-	-	-	-	-	24,804.26	24,804.26
资产总计	3,880,883,276.98	2,852,598,369.87	2,497,639,832.01	-	-	198,115,076.79	9,429,236,555.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	49.60	49.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,640,744.93	2,640,744.93
应付托管费	-	-	-	-	-	717,427.14	717,427.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	262,789.84	262,789.84
应交税费	-	-	-	-	-	26,153.56	26,153.56
应付利润	-	-	-	-	-	10,006,642.73	10,006,642.73
其他负债	-	-	-	-	-	597,219.16	597,219.16
负债总计	-	-	-	-	-	14,251,026.96	14,251,026.96
利率敏感度缺口	3,880,883,276.98	2,852,598,369.87	2,497,639,832.01	-	-	183,864,049.83	9,414,985,528.69

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末及上年度末，在"影子定价"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，本基金资产净值可参考的公允价值不会发生重大变动。

7.4.13.4.2 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波动的风险。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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	6,009,500,502.78	4,700,347,128.94
第三层次	-	-
合计	6,009,500,502.78	4,700,347,128.94

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2022年12月31日：无）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	6,009,500,502.78	62.71
	其中：债券	6,009,500,502.78	62.71
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,039,954,014.72	10.85
	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	2,486,651,397.24	25.95
4	其他各项资产	46,957,284.65	0.49
5	合计	9,583,063,199.39	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.32	
	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	970,270,421.35	11.27
	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。对货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日。如遇报告期末为非交易日，一并计入。

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	2023-09-26	21.59	巨额赎回	1个交易日

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

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。

8.3.2 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	各期限负债占基金资
----	--------	-----------	-----------

		产净值的比例(%)	产净值的比例(%)
1	30天以内	20.86	11.27
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.66	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	45.47	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	12.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	29.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.40	11.27

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。

8.4 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限超过240天的情形。

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,288,504,708.26	14.97
	其中：政策性金融债	1,288,504,708.26	14.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	205,827,132.44	2.39

6	中期票据	40,023,203.52	0.46
7	同业存单	4,475,145,458.56	51.99
8	其他	-	-
9	合计	6,009,500,502.78	69.81
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值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)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	210409	21农发09	7,100,000	712,245,633. 57	8.27
2	112380481	23蒙商银行CD033	5,000,000	497,782,783. 70	5.78
3	112321288	23渤海银行CD288	5,000,000	495,841,456. 48	5.76
4	112321246	23渤海银行CD246	4,500,000	444,464,709. 63	5.16
5	230304	23进出04	2,100,000	212,270,323. 55	2.47
6	112388257	23广东南粤银行CD20 7	2,000,000	199,839,764. 01	2.32
7	112388330	23深圳前海微众银行 CD037	2,000,000	199,798,384. 92	2.32
8	112374531	23富邦华一银行CD11 9	2,000,000	198,695,907. 50	2.31
9	112321415	23渤海银行CD415	2,000,000	197,390,288. 27	2.29
10	112305205	23建设银行CD205	2,000,000	197,200,719. 76	2.29

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0551%
报告期内偏离度的最低值	-0.0816%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0309%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内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

报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

8.8 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

本基金在本报告期末未取得资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国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及原银保监会处罚。中国进出口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。渤海银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局及原银保监会、中国人民银行处罚。广东南粤银行在报告编制日前一年内受到原银保监会处罚。蒙商银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行处罚。富邦华一银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局及原银保监会处罚。深圳前海微众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。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及原银保监会、中国人民银行处罚。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。

8.9.3 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	45,039.65
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	46,912,245.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	46,957,284.65

8.9.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有人户数(户)	基金份额	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	12,124	6,693.21	45,342,938.01	5.59%	766,034,755.67	94.41%
中加货币C	62	125,747,893.06	7,791,334,048.30	99.94%	5,035,321.71	0.06%
中加货币E	22	14,246.51	0.00	0.00%	313,423.14	100.00%
合计	12,1308	70,960.37	7,836,676,986.31	91.04%	771,383,500.52	8.96%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	1,013,977,532.13	11.78%
2	银行类机构	1,000,573,155.12	11.62%
3	银行类机构	679,815,841.64	7.90%
4	银行类机构	584,130,428.61	6.79%
5	银行类机构	508,312,183.11	5.91%
6	基金类机构	353,230,457.73	4.10%
7	银行类机构	301,498,097.93	3.50%
8	银行类机构	300,056,926.11	3.49%
9	银行类机构	300,000,000.00	3.49%
10	银行类机构	203,808,058.94	2.37%

9.3 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	中加货币A	565,457.30	0.07%

有本基金	中加货币C	0.00	0.00%
	中加货币E	107,306.53	34.24%
	合计	672,763.83	0.01%

9.4 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

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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中加货币A	中加货币C	中加货币E
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	789,354,486.94	8,625,631,041.75	-
本报告期基金总申购份额	1,404,086,124.68	92,988,483,996.82	355,294.29
减：本报告期基金总赎回份额	1,382,062,917.94	93,817,745,668.56	41,871.15
本报告期期末基金份额总额	811,377,693.68	7,796,369,370.01	313,423.14

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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重大人事变动情况：本报告期内，夏英先生于2023年3月10日离任公司董事长、法定代表人，夏远洋先生自同日起担任公司董事长、法定代表人；宗喆先生于2023年8月28日离任公司总经理，自离任之日起由夏远洋董事长暂时代履行总经理职责；魏忠先生于2023年9月25日离任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。本报告期内应支付审计费75000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东方	2	-	-	-	-	-

财富证券						
华西证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

(1) 权益投资部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

(2) 公司投资决策委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核部负责审查相关协议内容，集中交易部负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3.权益投资部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司投资决策委员会审批、确定。

11.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	857,363,962.08	100.00%	20,832,892,000.00	100.00%	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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。

11.9 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	中加货币市场基金关于春节假期期间暂停申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-16
2	中加货币市场基金2022年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-20
3	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-10
4	中加货币市场基金2022年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
5	中加货币市场基金2023年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-21
6	中加货币市场基金关于劳动节假期期间暂停申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-24
7	中加货币市场基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-01
8	关于中加货币市场基金基金份额升降级相关规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-14
9	中加货币市场基金关于端午节假期期间暂停申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-16
10	中加货币市场基金调整大额	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-28

	申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告		
11	中加货币市场基金2023年第2季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-20
12	中加货币市场基金2023年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-30
13	中加货币市场基金关于中秋节及国庆节假期期间暂停申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-25
14	中加货币市场基金2023年第3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-24
15	关于中加货币市场基金增加E类基金份额并变更收益分配方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-29
16	中加货币市场基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-29
17	中加货币市场基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-29
18	中加货币市场基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2023-12-04
19	中加货币市场基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023-12-04

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20230101-20230403	2,047,573,667.52	336,556,761.09	1,800,000,000.00	584,130,428.61	6.79%
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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人处

13.3 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
二〇二四年三月二十八日