

中加纯债债券型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

基金管理人:中加基金管理有限公司 基金托管人:广州农村商业银行股份有限公司

重要提示及目录 1.1 重要提示 基金管理人及董事、监事、高级管理人员...

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金存续期间, 基金管理人, 基金托管人

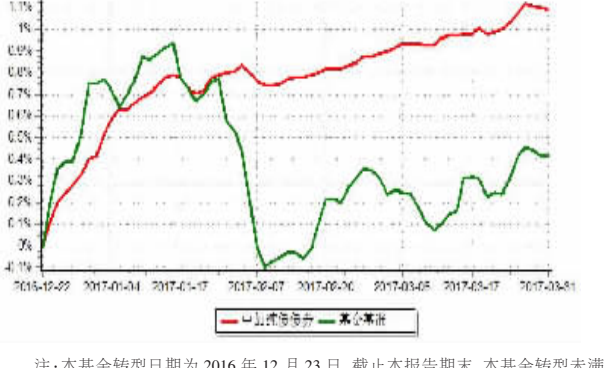
主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ①-③, ②-③

3.2.2 自基金转型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



注:本基金转型日期为2016年12月23日,截止本报告期末,本基金转型未满一年。

8.4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期说明:闫沛沅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。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年第一季度经济运行稳中向好,工业企业利润同比大幅改善,1-3月中采PMI数据回升...

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with columns: 投资者类别, 持有基金份额比例, 期初, 申购, 赎回, 持有份额, 份额占比

8.1 报告期内基金投资运作合规情况的说明

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.3 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.2 存放地点

9.3 查阅方式

9.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年一季度,在经济基本面好转、金融去杠杆和美联储加息的背景下...

中加丰润纯债债券型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

基金管理人:中加基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

重要提示 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人

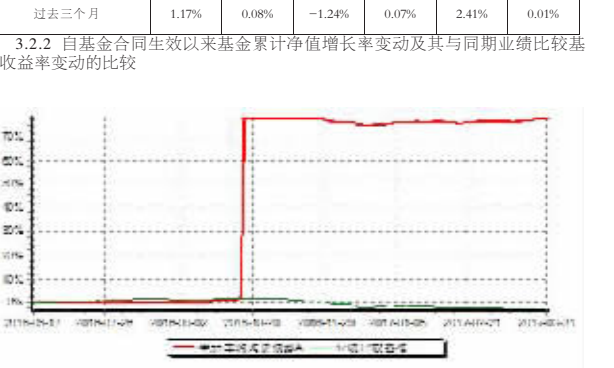
主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日至2017年03月31日)

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ①-③, ②-③

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



注:1.本基金基金合同于2016年6月17日生效,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

8.4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注: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。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年一季度,在经济基本面好转、金融去杠杆和美联储加息的背景下...

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with columns: 投资者类别, 持有基金份额比例, 期初, 申购, 赎回, 持有份额, 份额占比

8.1 报告期内基金投资运作合规情况的说明

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.3 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.2 存放地点

9.3 查阅方式

9.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年一季度,在经济基本面好转、金融去杠杆和美联储加息的背景下...

1.21%,同期业绩比较基准收益率为-1.24%;中加丰润C基金资产净值为232,150,267.70...

重要提示 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人

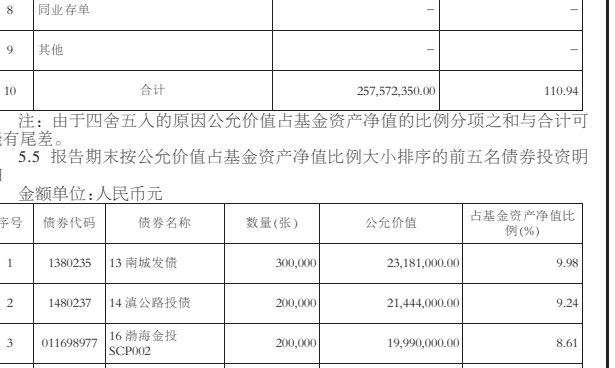
主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ①-③, ②-③

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



注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 本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

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例

5.6 本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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例

5.7 本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

5.8 本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

5.9 本报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 其他资产构成 单位:人民币元

Table with columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 应收申购款, 其他, 合计

注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.1 报告期内基金投资运作合规情况的说明