中加丰泽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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2017 年 4 月 21 日

§1 重要提示及目录

1.1 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基金合同的规定,于 2017 年 4 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 1 月 1 日起至 3 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	995,554,449.81 份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超越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,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。
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(2017 年 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	5,423,463.17
2.本期利润	5,251,820.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087
4.期末基金资产净值	1,005,919,299.90
5.期末基金份额净值	1.01

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。

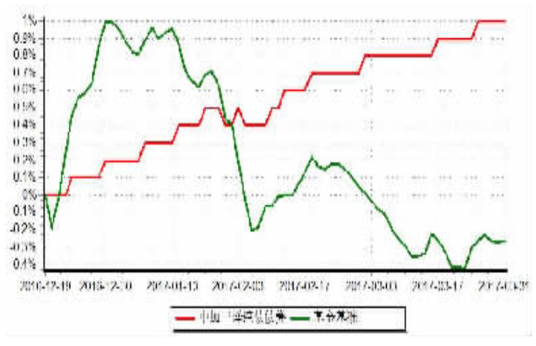
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.80%	0.04%	-1.24%	0.07%	2.04%	-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



注:1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 19 日生效,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同的约定,本基金建仓期 6 个月。截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

§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 年 12 月 19 日	-	9	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。现任中加心安保本混合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)、中加丰享纯债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 28 日至今)。

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、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,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进行分析。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

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,央行货币政策转向稳健中性偏紧,连续两次上调 MLF 利率、OMO 利率,债券市场延续震荡调整走势,整体收益率曲线平坦化上行。以国债为例:10 年期国债从年初开始一路上行,最终在 2 月 7 日达到 3.49%的短期高点,而后进入 3 月,随着 CPI 数据大幅低于预期、美联储加息落地、房地产调控升级等利好提振下,10 年期国债收益率再度下行至 3.28%低位附近。

进入二季度,债市仍面临监管政策尚未落地,金融去杠杆延续,经济基本面继续复苏等因素的考验,我们对债券市场保持相对谨慎的态度。后续我们将密切关注市场的变化,待房地产投资回落、PPI 环比增速转负、监管政策落地后,我们将在严格甄别个券信用风险的前提下,择机加大组合杠杆与久期,提高产品收益。

报告期内,基于对债市基本面、资金面、市场情绪面等进行判断,组合维持较低的杠杆水平与久期水平, 较好地规避了季末资金利率上行及收益率上行带来的风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,中加丰泽纯债债券净值增长率 0.8%,业绩比较基准收益率-1.24%。

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(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	787,826,289.00	78.28
	其中:债券	787,826,289.00	78.28
	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	207,000,830.50	20.57
	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	2,176,978.97	0.22
8	其他资产	9,480,909.16	0.94
9	合计	1,006,485,007.63	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

本报告期内,本基金未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本报告期末,本基金未投资沪港通股票。

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	10,451,700.00	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,880,000.00	3.96
	其中:政策性金融债	39,880,000.00	3.96
4	企业债券	116,668,589.00	11.60
5	企业短期融资券	499,956,000.00	49.70
6	中期票据	23,205,000.00	2.31
7	可转债	-	-
8	同业存单	97,665,000.00	9.71
9	其他	-	-
10	合计	787,826,289.00	78.32

注:由于四舍五入的原因金额占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	011698847	16 大同煤矿 SCP004	900,000	90,054,000.00	8.95
2	011754035	17 中铝国工 SCP001	800,000	79,904,000.00	7.94
3	041664027	16 营口港 CP002	500,000	50,315,000.00	5.00
4	011764006	17 信达 SCP005	500,000	50,045,000.00	4.98
5	011758009	17 镇国投 SCP001	500,000	49,965,000.00	4.97

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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 本基金未投资股票, 不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,060.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,475,849.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,480,909.16

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	200,329,036.53
报告期期间基金总申购份额	795,228,638.15
减:报告期期间基金总赎回份额	3,224.87
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	995,554,449.81

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§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	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	20170101-20170331	199999000.00	79522763 4.19	0	995226634.19	99.97
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,该投资者在赎回其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

二〇一七年四月二十一日

中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金 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
报告送出日期:2017 年 4 月 21 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 4 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加改革红利混合
基金主代码	001537
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 13 日
报告期末基金份额总额	208,520,297.58 份
投资目标	在深入研究的基础上,运用"价值+主题"的投资方法,发现并精选能够分享中国改革红利的上市公司构建投资组合。在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报,本基金采用积极灵活的投资策略,通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益,完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上,精选个股,完成股票组合的构建,并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建,在严格的风险控制基础上,力争实现长期稳健的绝对收益,在深入研究的基础上,运用"价值+主题"的投资方法,发现并精选能够分享中国改革红利的上市公司构建投资组合。在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略,通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益,完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上,精选个股,完成股票组合的构建,并通过运用久期策略、完成股票组合的构建,并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建,在严格的风险控制基础上,力争实现长期稳健的绝对收益
业绩比较基准	60%* 沪深 300 指数收益率+40%* 中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§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 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	3,731,103.55
2.本期利润	12,882,814.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0576
4.期末基金资产净值	233,426,335.91
5.期末基金份额净值	1.1194

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。

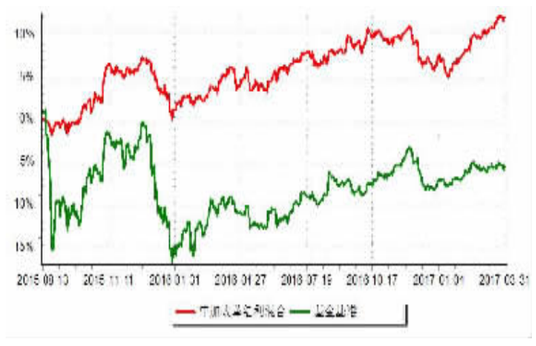
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	5.42%	0.34%	2.59%	0.31%	2.83%	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



注:按基金合同规定,本基金建仓期为 6 个月,截至报告期末,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		
张旭	投资研究部权益投资负责人、本基金基金经理	2015 年 8 月 13 日	-	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、嘉圣投资管理有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月就职于银华基金管理有限公司,任年金和特定客户资产管理计划投资经理,2015 年 3 月加入中加基金管理有限公司,任投资研究部权益投资负责人,中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015 年 8 月 13 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 2 日至今)、中加心安保本混合型证券投资基金基金经理(2016 年 3 月 23 日至今)。

注:1、任职日期说明:张旭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,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

2017 年第一季度,国民经济在价格、基建、补库存等因素驱动下基本面呈复苏态势,货币政策维持中性略紧状态,未来依然存在不确定性,仍须着重观察宏观经济复苏的持续性。

本季度 A 股市场呈上行态势,本产品本着稳健投资原则,年初选取了部分确定性较强的投资机会参与,并在季度末对前期涨幅过高的股票进行了一定减仓,持有业绩确定性较强、估值不高的龙头公司,希望在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,中加改革红利混合净值增长率 5.42%,业绩比较基准收益率 2.59%。

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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	78,393,139.18	33.31
	其中:股票	78,393,139.18	33.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	155,448,063.85	66.04
8	其他资产	1,536,276.18	0.65
9	合计	235,377,479.21	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,402,637.76	22.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,666,721.84	2.00
F	批发和零售业	622,061.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	2,418,747.00	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	16,925,331.58	7.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,357,640.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,393,139.18	33.58

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。

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	473,924	5,696,566.48	2.44
2	002456	欧菲光	144,797	5,482,014.42	2.35
3	600690	青岛海尔	441,658	5,379,394.44	2.30
4	600309	万华化学	172,298	4,670,998.78	2.00
5	601997	贵阳银行	260,698	4,559,608.02	1.95
6	600418	江淮汽车	386,058	4,524,599.76	1.94
7	002594	比亚迪	91,067	4,373,037.34	1.87
8	000895	双汇发展	183,800	4,144,690.00	1.78
9	000423	东阿阿胶	54,604	3,582,022.40	1.53
10	600079	人福医药	180,100	3,555,174.00	1.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有债券。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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 本基金本报告期内投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	122,187.40
2	应收证券清算款	1,378,836.54
3	应收股利	-
4	应收利息	33,281.84
5	应收申购款	1,970.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,536,276.18

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	234,300,791.76
报告期期间基金总申购份额	604,208.31
减:报告期期间基金总赎回份额	26,384,702.49
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	208,520,297.58

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	50,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	50,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.98

§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	20170101-20170331	50000000	0	0	50000000	23.98
	2	20170101-20170331	50000000	0	0	50000000	23.98
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,该投资者在赎回其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改革红利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2、《中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、《中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅、或登录基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人-中加基金管理有限公司客户服务中心电话:400-00-95526。

网址:www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

二〇一七年四月二十一日