

中加纯债两年定期开放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:杭州银行股份有限公司

重要提示 基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

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...

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 03 月 31 日止。

基金简称:中加纯债两年 基金代码:000660

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2016 年 11 月 11 日

报告期末基金份额总额:1,000,162,128.92 份

投资目标:在控制风险并持有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:1. 资产配置策略 本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究...

业绩比较基准:中债综合全价(总值)指数收益率

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,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,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:杭州银行股份有限公司

基金简称:中加纯债两年 A 中加纯债两年 C 基金代码:000660 000661

报告期末基金份额总额:1,000,159,948.92 份 2,180.00 份

主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元

主要财务指标 报告期末(2017 年 01 月 01 日-2017 年 03 月 31 日)

1. 本期已实现收益 9,906,218.64 19.77 2. 本期利润 682,906.49 -0.34

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0007 -0.0002 4. 期末基金资产净值 1,007,560,697.98 2,193.25

5. 期末基金份额净值 1.0074 1.0061

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

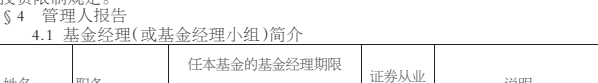
中加纯债两年 A 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07% 0.07% -1.24% 0.07% 1.31% 0.00%

中加纯债两年 C 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.01% 0.07% -1.24% 0.07% 1.23% 0.00%

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 11 月 11 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,自本报告期末,基金合同生效满 6 个月。截至本报告期末,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。

基金管理人报告 4.1 基金管理人(或基金基金经理)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

杨宇俊 基金经理 2016 年 11 月 11 日 9 金融工程博士,北京银行博士后,具有多年债券市场投资经验...

注:1. 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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.1 公平交易专项说明 为了公平对待各类投资者,保护各类投资者利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行...

4.2 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.3 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017 年一季度,在经济基本面持续企稳、金融去杠杆和美联储加息的背景下,央行货币政策转向中性偏紧...

基金管理人:中加基金管理有限公司 基金托管人:杭州银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 基金代码:000552

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2016 年 04 月 21 日

报告期末基金份额总额:3,345,901,399.04 份

投资目标:在控制风险并持有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:本基金的主要投资策略包括:期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中,投资策略及资产配置支持等品种投资策略...

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率+1.3%

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,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,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:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 A 中加纯债一年 C 基金代码:000552 000553

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元

主要财务指标 报告期末(2017 年 01 月 01 日-2017 年 03 月 31 日)

1. 本期已实现收益 37,554,470.05 4.712,253.38 2. 本期利润 24,806,458.05 2,967,868.29

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0084 0.0073 4. 期末基金资产净值 3,341,706,420.15 457,094,678.25

5. 期末基金份额净值 1.137 1.123

注: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

中加纯债一年 A 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.71% 0.08% 0.70% 0.01% 0.01% 0.07%

中加纯债一年 C 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.63% 0.08% 0.70% 0.01% -0.07% 0.07%

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 2014 年 3 月 24 日生效,至本报告期末,本基金合同生效满一年。

2. 根据基金合同约定,本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时,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。

基金管理人报告 4.1 基金管理人(或基金基金经理)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

同洪涛 基金经理 2014 年 03 月 24 日 9 英国南理工大学金融学硕士,南开大学计算机硕士学位,2008 年至 2013 年曾任平安银行资产管理部,北京银行交易部,担任债券交易员...

注:1. 任洪涛的任职日期:同洪涛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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.1 公平交易专项说明 本基金管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.2 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.3 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017 年一季度,在经济基本面持续企稳、金融去杠杆和美联储加息的背景下,央行货币政策转向中性偏紧...

基金管理人:中加基金管理有限公司 基金托管人:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 基金代码:000552

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2016 年 04 月 21 日

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

投资目标:在控制风险并持有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:本基金的主要投资策略包括:期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中,投资策略及资产配置支持等品种投资策略...

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率+1.3%

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,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,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:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 A 中加纯债一年 C 基金代码:000552 000553

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元

主要财务指标 报告期末(2017 年 01 月 01 日-2017 年 03 月 31 日)

1. 本期已实现收益 45,343,072.00 1.10 2. 本期利润 60,483,472.00 1.46

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0084 0.0073 4. 期末基金资产净值 4,534,343,072.00 597.25

5. 期末基金份额净值 1.517 1.461

注: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

中加纯债一年 A 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.71% 0.08% 0.70% 0.01% 0.01% 0.07%

中加纯债一年 C 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.63% 0.08% 0.70% 0.01% -0.07% 0.07%

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 2014 年 3 月 24 日生效,至本报告期末,本基金合同生效满一年。

2. 根据基金合同约定,本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时,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。

基金管理人报告 4.1 基金管理人(或基金基金经理)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

同洪涛 基金经理 2014 年 03 月 24 日 9 英国南理工大学金融学硕士,南开大学计算机硕士学位,2008 年至 2013 年曾任平安银行资产管理部,北京银行交易部,担任债券交易员...

注:1. 任洪涛的任职日期:同洪涛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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.1 公平交易专项说明 本基金管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.2 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.3 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017 年一季度,在经济基本面持续企稳、金融去杠杆和美联储加息的背景下,央行货币政策转向中性偏紧...

基金管理人:中加基金管理有限公司 基金托管人:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 基金代码:000552

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2016 年 04 月 21 日

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

投资目标:在控制风险并持有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:本基金的主要投资策略包括:期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中,投资策略及资产配置支持等品种投资策略...

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率+1.3%

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,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,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:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 A 中加纯债一年 C 基金代码:000552 000553

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元

主要财务指标 报告期末(2017 年 01 月 01 日-2017 年 03 月 31 日)

1. 本期已实现收益 45,343,072.00 1.10 2. 本期利润 60,483,472.00 1.46

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0084 0.0073 4. 期末基金资产净值 4,534,343,072.00 597.25

5. 期末基金份额净值 1.517 1.461

注: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

中加纯债一年 A 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.71% 0.08% 0.70% 0.01% 0.01% 0.07%

中加纯债一年 C 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.63% 0.08% 0.70% 0.01% -0.07% 0.07%

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 2014 年 3 月 24 日生效,至本报告期末,本基金合同生效满一年。

2. 根据基金合同约定,本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时,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。

基金管理人报告 4.1 基金管理人(或基金基金经理)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

同洪涛 基金经理 2014 年 03 月 24 日 9 英国南理工大学金融学硕士,南开大学计算机硕士学位,2008 年至 2013 年曾任平安银行资产管理部,北京银行交易部,担任债券交易员...

注:1. 任洪涛的任职日期:同洪涛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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.1 公平交易专项说明 本基金管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.2 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.3 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指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则...

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017 年一季度,在经济基本面持续企稳、金融去杠杆和美联储加息的背景下,央行货币政策转向中性偏紧...

基金管理人:中加基金管理有限公司 基金托管人:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 基金代码:000552

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2016 年 04 月 21 日

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

投资目标:在控制风险并持有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:本基金的主要投资策略包括:期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中,投资策略及资产配置支持等品种投资策略...

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率+1.3%

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,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,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:中国邮储银行股份有限公司

基金简称:中加纯债一年 A 中加纯债一年 C 基金代码:000552 000553

报告期末基金份额总额:2,938,955,033.30 份 406,946,365.74 份

主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元

主要财务指标 报告期末(2017 年 01 月 01 日-2017 年 03 月 31 日)

1. 本期已实现收益 45,343,072.00 1.10 2. 本期利润 60,483,472.00 1.46

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0084 0.0073 4. 期末基金资产净值 4,534,343,072.00 597.25

5. 期末基金份额净值 1.517 1.461

注: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

中加纯债一年 A 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.71% 0.08% 0.70% 0.01% 0.01% 0.07%

中加纯债一年 C 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.63% 0.08% 0.70% 0.01% -0.07% 0.07%

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 2014 年 3 月 24 日生效,至本报告期末,本基金合同生效满一年。

2. 根据基金合同约定,本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时,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。

基金管理人报告 4.1 基金管理人(或基金基金经理)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

同洪涛 基金经理 2014 年 03 月 24 日 9 英国南理工大学金融学硕士,南开大学计算机硕士学位,2008 年至 2013 年曾任平安银行资产管理部,北京银行交易部,担任债券交易员...

注:1. 任洪涛的任职日期:同洪涛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 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

4.1 公平交易专项说明 本基金管理人对于报告期内本基金遵守