

中加丰盈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:杭州银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

1.1 重要提示 基金管理人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。

基金托管人杭州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。

本报告中期财务资料未经审计。 本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 基金简称, 中加丰盈纯债债券; 基金主代码, 003428; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年11月2日; 报告期末基金份额总额, 270,173,870.59份; 投资目标, 力争在严格控制投资风险的前提下,长期内实现超越业绩比较基准的投资回报;

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 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, 1,720,307.05; 2.本期利润, 1,950,087.33; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0072; 4.期末基金资产净值, 270,517,042.04; 5.期末基金份额净值, 1.0013

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。

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长, 净值增长率, 业绩比较基准收益, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.72%, 0.05%, -1.24%, 0.07%, 1.90%, -0.02%

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

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长, 净值增长率, 业绩比较基准收益, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.55%, 0.03%, -1.24%, 0.07%, 1.79%, -0.04%

注:1.本基金基金合同于2016年11月2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,至本报告期末,本基金合同生效未满6个月。截至报告期末,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 杨宇俊, 本基金基金经理, 2016年11月2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。

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。

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1.权益投资, -; 2.基金投资, -; 3.固定收益投资, 367,332,050.00, 98.35; 4.贵金属投资, -; 5.金融衍生品投资, -; 6.买入返售金融资产, -; 7.银行存款和结算备付金合计, 110,378.74, 0.03; 8.其他资产, 6,068,259.58, 1.62; 9.合计, 373,510,688.32, 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 5.2.2 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

Table with 2 columns: 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. 111092709, 16西安银行 CD006, 600,000, 58,104,000.00, 21.48; 2. 111681045, 16杭州银行 CD192, 500,000, 47,975,000.00, 17.73; 3. 111681339, 16重庆农村商行 CD154, 400,000, 38,332,000.00, 14.17; 4. 111681606, 16郑州银行 CD138, 265,000, 25,371,100.00, 9.38; 5. 011698380, 16华夏国债 SCP001, 250,000, 25,037,500.00, 9.26

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五名债券投资明细

Table with 2 columns: 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. 111092709, 16西安银行 CD006, 600,000, 58,104,000.00, 21.48; 2. 111681045, 16杭州银行 CD192, 500,000, 47,975,000.00, 17.73; 3. 111681339, 16重庆农村商行 CD154, 400,000, 38,332,000.00, 14.17; 4. 111681606, 16郑州银行 CD138, 265,000, 25,371,100.00, 9.38; 5. 011698380, 16华夏国债 SCP001, 250,000, 25,037,500.00, 9.26

5.4 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资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额; 1. 存出保证金, -; 2. 应收证券清算款, -; 3. 应收股利, -; 4. 应收利息, 6,068,259.58; 5. 应收申购款, -; 6. 其他应收款, -; 7. 待摊费用, -; 8. 其他, -; 9. 合计, 6,068,259.58

5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.5.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券 5.5.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.6 开放式基金份额变动 单位:份 报告期初基金份额总额 270,192,742.77 报告期间基金总申购份额 1,010.94 减:报告期间基金总赎回份额 19,883.12 报告期间基金份额变动份额(份额减少以“-”填列) - 报告期末基金份额总额 270,173,870.59

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

Table with 2 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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, 10000100.00, 0, 0, 100001000.00, 37.01; 机构 2, 20170101-20170331, 12000140.00, 0, 0, 120001400.00, 44.42

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 9.1 备查文件目录 1.中国证监会批准中加丰盈纯债债券型证券投资基金设立的文件 2.《中加丰盈纯债债券型证券投资基金合同》 3.《中加丰盈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

中加基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

中加丰裕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:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

1.1 重要提示 基金管理人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。

基金托管人兴业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。

本报告中期财务资料未经审计。 本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 基金简称, 中加丰裕纯债债券; 基金主代码, 003673; 基金运作方式, 契约开放式; 基金合同生效日, 2016年11月28日; 报告期末基金份额总额, 1,491,866,061.54份; 投资目标, 力争在严格控制风险的前提下,长期内实现超越业绩比较基准的投资回报;

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 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, 10,796,179.53; 2.本期利润, 6,560,900.82; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0048; 4.期末基金资产净值, 1,515,264,369.51; 5.期末基金份额净值, 1.0157

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。

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长, 净值增长率, 业绩比较基准收益, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.55%, 0.03%, -1.24%, 0.07%, 1.79%, -0.04%

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

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长, 净值增长率, 业绩比较基准收益, ①-③, ②-④; 过去三个月, 0.55%, 0.03%, -1.24%, 0.07%, 1.79%, -0.04%

注:1、本基金基金合同于2016年11月28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,本基金合同生效未满6个月。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 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。

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。

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1.权益投资, -; 2.基金投资, -; 3.固定收益投资, 1,490,953,200.00, 98.35; 4.贵金属投资, -; 5.金融衍生品投资, -; 6.买入返售金融资产, 5,078,128.97, 0.39; 7.银行存款和结算备付金合计, 1,144,475.80, 0.08; 8.其他资产, 17,834,210.99, 1.18; 9.合计, 1,515,910,015.76, 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 5.2.2 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

Table with 2 columns: 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. 011698396, 16华能电力 SCP001, 1,000,000, 100,070,000.00, 6.60; 2. 011697031, 16南电 SCP002, 1,000,000, 99,970,000.00, 6.60; 3. 011698738, 16广新控制 SCP009, 1,000,000, 99,660,000.00, 6.58; 4. 04166068, 16西安高新 CP002, 1,000,000, 99,320,000.00, 6.55; 5. 101658202, 16南电集 MTN001, 1,000,000, 99,070,000.00, 6.54

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五名债券投资明细

Table with 2 columns: 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. 011698396, 16华能电力 SCP001, 1,000,000, 100,070,000.00, 6.60; 2. 011697031, 16南电 SCP002, 1,000,000, 99,970,000.00, 6.60; 3. 011698738, 16广新控制 SCP009, 1,000,000, 99,660,000.00, 6.58; 4. 04166068, 16西安高新 CP002, 1,000,000, 99,320,000.00, 6.55; 5. 101658202, 16南电集 MTN001, 1,000,000, 99,070,000.00, 6.54

5.4 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资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额; 1. 存出保证金, -; 2. 应收证券清算款, -; 3. 应收股利, -; 4. 应收利息, 17,834,210.99; 5. 应收申购款, -; 6. 其他应收款, -; 7. 待摊费用, -; 8. 其他, -; 9. 合计, 17,834,210.99

5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.5.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券 5.5.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.6 开放式基金份额变动 单位:份 报告期初基金份额总额 998,573,870.96 报告期间基金总申购份额 493,292,210.46 减:报告期间基金总赎回份额 1988 报告期间基金份额变动份额(份额减少以“-”填列) - 报告期末基金份额总额 1,491,866,061.54

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

Table with 2 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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, 99848888.442, 493292025.257, 0, 149177136.99, 99.99

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 9.1 备查文件目录 1.中国证监会批准中加丰裕纯债债券型证券投资基金设立的文件 2.《中加丰裕纯债债券型证券投资基金合同》 3.《中加丰裕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

中加基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日