

中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 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:招商银行股份有限公司
送出日期:2018年03月30日

1.1 重要提示

1.1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
基金合同已于 2015 年 01 月 13 日正式生效。
基金管理人招商银行股份有限公司根据基金合同约定,于 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配数据、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。
本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

1.2 基金简介

基金名称	中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中加改革红利混合
基金代码	001537
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 08 月 13 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
报告期末基金份额总额	192,814,114.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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股票资产,在充分分散风险的前提下实现基金资产的稳健增值,为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。

投资策略
本基金采用积极主动的投资策略,通过前瞻性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,完成投资组合的构建,并通过运用长期策略、中期策略和个股投资策略实现基金资产的稳健增值,在严格的风险控制基础上,力争实现长期稳健的绝对收益。

2.3 基金管理人

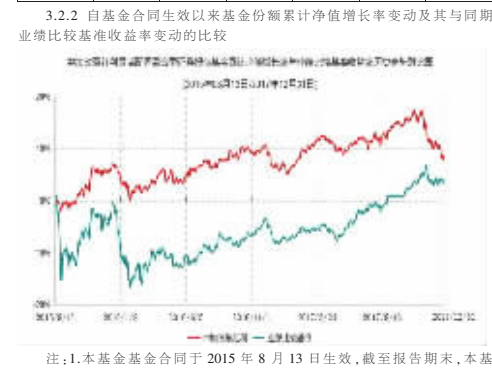
姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2017 年	2016 年	2015 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	12,340,664.06	6,776,588.14	11,661,536.84
本期利润	7,290,275.54	1,410,711.57	14,913,360.23
加权平均基金份额本期利润	0.0367	-0.0067	0.0664
本期加权平均净值增长率	3.39%	-0.63%	6.47%
本期基金份额净值增长率	2.44%	-0.44%	6.65%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	5,650,200.64	14,487,199.31	11,509,963.69
期末可供分配基金份额利润	0.0293	0.0618	0.0525
期末基金资产净值	198,464,248.79	248,789,910.07	233,771,485.58
期末基金份额净值	1.0293	1.0618	1.0665
3.1.3 累计指标情况	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额净值增长率	8.77%	6.18%	6.65%

3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准②	业绩比较基准差③	①-③	②-③	
过去三个月	-5.26%	0.59%	2.86%	0.49%	-8.12%	0.10%
过去六个月	-3.12%	0.53%	5.99%	0.42%	-9.11%	0.11%
过去一年	2.44%	0.44%	12.81%	0.38%	-10.37%	0.06%



3.3 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准变动的比较

项目	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 8 月 13 日至 2015 年 12 月 31 日
基金份额净值增长率	8.77%	6.18%	6.65%

4.1 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

4.2 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

4.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%。

4.4 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。

5.1 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

5.2 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

5.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%。

5.4 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。

5.6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

审计报告标题	中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告审计报告
被审计单位名称	中加基金管理有限公司
审计期间	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计意见类型	标准无保留意见
审计意见说明	我们认为,财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和现金流量。
审计报告日期	2018 年 03 月 28 日

6.2 审计报告的基本内容

我们审计了后附的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表、现金流量表、所有者权益变动表和财务报表附注。我们的审计是根据中国注册会计师审计准则进行的。我们审计的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和现金流量。

6.3 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

6.4 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

6.5 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%。

6.6 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。

6.7 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

6.8 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

6.9 基金业绩比较基准

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

6.10 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。

6.11 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

6.12 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

6.13 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%。

6.14 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。

6.15 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

6.16 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

7.1 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

7.2 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

7.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%。

7.4 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。

7.5 基金管理人及其基金经理

姓名	职务	任职(助理)期限	从业年限	说明
魏天	基金经理	2015-08-13 - 9	9	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆泰投资管理咨询有限公司,2012 年 3 月至 2015 年 3 月担任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2015 年 8 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理,2016 年 5 月 23 日至 9 月 23 日任中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中加改革红利”)基金经理(2018 年 3 月 8 日至 9 月 28 日)。

7.6 基金业绩

年份	每 10 份基金份额净值	每 10 份基金份额累计净值	年度利润分配	备注
2017 年	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60
合计	0.600	11,110,144.45	166,436.15	11,276,580.60

7.7 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%。

7.8 基金业绩比较基准变动的说明

本基金业绩比较基准于 2015 年 8 月 13 日生效,截至本报告期末,本基金业绩比较基准已发生变更一次。