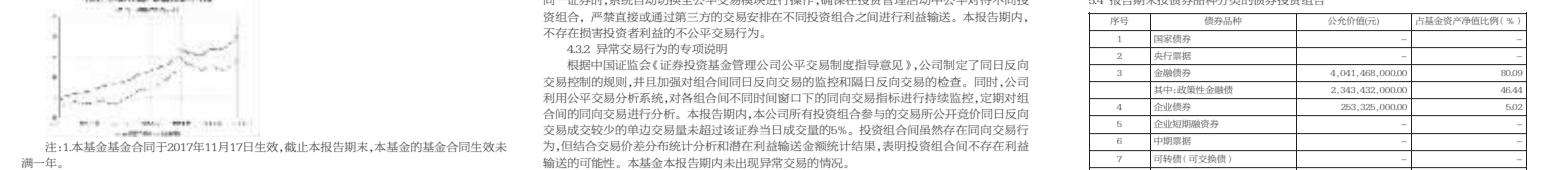


中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告



注：1.本基金管理合同于2017年11月17日生效，截止本报告期末，本基金的基金合同生效未满一年。

2.按基金合同规定，本基金建仓期为1个月，截至本报告期末，本基金的基金合同生效已满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。

投资策略 在控制风险的前提下实现资产的流动性，力爭实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金在追求资产流动性的同时，不进行股票投资。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。

本报告期（2018年4月1日起至2018年6月30日止）

§ 2 基金产品概况

基金简称 中加颐慧定期开放债券

基金代码 000330

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2017年11月17日

报告期末基金资产总额 5,000,999,000.00元

投资目标 在控制风险的前提下实现资产的流动性，力爭实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 在控制风险的前提下实现资产的流动性，力爭实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金在追求资产流动性的同时，不进行股票投资。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。

本报告期（2018年4月1日起至2018年6月30日止）

§ 3 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)

中加颐慧定期开放债券 46,817,123,000 0.00

本期利润 72,294,061,010 0.00

利润分配 平均基金份额本期利润 0.0144 -

4.本期末基金资产净值 5,046,347,548.00 0.00

5.本期末基金份额净值 1.0072 10000

6.本期末可供分配基金份额利润 10,072 10000

注：1. 上述基金主要财务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不计费用的收益率。

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. 截至本报告期末，本基金C类份额为0。

4. 基金净值的表现

5.2.1 本基金报告期内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

中加颐慧定期开放债券A净值表现

新发 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.40% 0.07% 1.01% 0.10% 0.44% -0.03%

新发 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.00% 1.01% 0.10% -1.01% -0.10%

5.2.2 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.2.3 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.3 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)

中加颐慧定期开放债券 216,367.00

1.本期已实现收益 796,260.04 309,194.13

2.本期利润 60,000 0.0000

3.加权平均基金份额本期利润 100,889,882.72 36,389,122.46

4.期末基金份额净值 1.01 1.012

5.期末可供分配基金份额利润 0.0026 0.0026

注：1. 上述基金主要财务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不计费用的收益率。

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. 截至本报告期末，本基金C类份额为0。

4. 基金净值的表现

5.2.1 本基金报告期内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A

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.79% 0.016% 2.10% 0.10% -1.27% -0.04%

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.71% 0.016% 2.06% 0.10% -1.40% -0.05%

5.2.2 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.2.3 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.3 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)

中加纯债A 216,367.00

1.本期已实现收益 664,326.04 216,367.00

2.本期利润 796,260.04 309,194.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0000 0.0000

4.期末基金份额净值 1.00 1.012

5.期末可供分配基金份额利润 0.0026 0.0026

注：1. 上述基金主要财务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不计费用的收益率。

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. 截至本报告期末，本基金C类份额为0。

4. 基金净值的表现

5.2.1 本基金报告期内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A

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.63% 0.07% -0.60% 0.08% 0.07% 0.00%

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% -0.60% -0.50% 0.08% 0.00% 0.00%

5.2.2 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.2.3 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.3 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)

中加纯债A 216,367.00

1.本期已实现收益 -2,608,979.07 -1,071.01

2.本期利润 -6,336,376.21 -2,159.03

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0014 -0.0094

4.期末基金份额净值 100,139,598.26 26,507,008

5.期末可供分配基金份额利润 0.0026 0.0026

注：1. 上述基金主要财务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不计费用的收益率。

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. 截至本报告期末，本基金C类份额为0。

4. 基金净值的表现

5.2.1 本基金报告期内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A

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.63% 0.07% -0.60% 0.08% 0.07% 0.00%

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% -0.60% -0.50% 0.08% 0.00% 0.00%

5.2.2 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.2.3 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.3 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)

中加纯债A 216,367.00

1.本期已实现收益 -2,608,979.07 -1,071.01

2.本期利润 -6,336,376.21 -2,159.03

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0014 -0.0094

4.期末基金份额净值 100,139,598.26 26,507,008

5.期末可供分配基金份额利润 0.0026 0.0026

注：1. 上述基金主要财务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不计费用的收益率。

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. 截至本报告期末，本基金C类份额为0。

4. 基金净值的表现

5.2.1 本基金报告期内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A

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.63% 0.07% -0.60% 0.08% 0.07% 0.00%

阶段 净值增长(%) 净值增长长期标准差 业绩比较基准收益 变差系数(%) 业绩比较基准收益 资产配置基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% -0.60% -0.50% 0.08% 0.00% 0.00%

5.2.2 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.2.3 本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：截至本报告期末，本基金C类份额为0。

5.3 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)

中加纯债A 216,367.00

1.本期已实现收益 -2,608,979.07 -1,071.01

2.本期利润 -6,336,376.21 -2,159.03

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0014 -0.0094

4.期末基金份额净值 100,139,598.26 26,507,008</