

中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金

(1)存在有关基金分红条件的前提下,本基金每收益分配基准日最多6次,每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日次日起可供分配利润的0%(含基金合同生效不满3个月可不进行收益分配);

(2)本基金收益分配方式分为两种:现金分红和红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人未选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不得低于面值;

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机构另有规定的,从其规定;

(6)本基金本合同未进行利润分配;

8.除报告期内管理人对本基金持有大量或金融资产净值波动情况的说明

本基金在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的情况。

§ 5 托管人报告

5.1报告期内本基金管理人遵守法律法规的情况说明

托管人声明,在本报告期内,基金管理人一前瑞银银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同,完全尽职尽责履行了应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵守法律法规、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人按投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在重要方面均严格按照基金合同约定履行义务。

5.3报告期内本基金托管人遵守法律法规、基金合同及其他法律法规的情况说明

本报告期内,本基金托管人严格遵守法律法规、基金合同及其他法律法规,按照法律法规、基金合同及托管协议的约定履行了应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务数据摘要(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金
单位:人民币元

资产	期初	本期	上期
	2018年06月30日	2017年12月31日	2017年06月30日
货币:			
现金	6471	16,272,078	67,476,168.88
结算备付金	-	220,923.52	206,194.10
应收利息	-	62,303.84	48,425.10
应收股利	-	-	-
买入返售金融资产	6472	95,837,346.56	131,168,536.78
其他应收款	-	95,837,346.56	131,168,536.78
基金投资	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-
可供出售金融资产	-	-	-
持有至到期投资	-	-	-
长期股权投资	-	-	-
投资性房地产	-	-	-
固定资产	-	-	-
无形资产	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
资产总计	6473	312,137,668.61	330,859,335.54
负债:			
短期借款	-	-	-
应付票据	-	-	-
应付账款	-	-	-
预收款项	-	-	-
应付职工薪酬	-	-	-
应交税费	-	-	-
其他应付款	-	-	-
持有待售负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
所有者权益:			
实收资本	6473	126,825,042.8	102,814,114.75
未分配利润	6470	-15,266,102.01	5,682,204.74
所有者权益合计	6473	111,558,922.79	108,496,324.49
负债和所有者权益总计	6473	312,137,668.61	330,859,335.54

注:1.所述基金负债指标不包括有价证券类基金的各项费用,计入费用后实际资产净值要小于所列数字;

2.本期已实现收益是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公允价值变动收益;

3.本基金合同于2016年6月8日生效,截止2016年6月30日成立已满一年。

3.2基金净值表现

3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准
过去一个月	-6.87%	14.0%	-4.40%
过去三个月	-12.53%	12.1%	-5.28%
过去六个月	-14.24%	14.1%	-6.37%
过去一年	-17.17%	18.6%	-8.07%
自基金合同生效以来	-7.05%	58.4%	-2.57%

注:1.本基金基金合同于2016年6月8日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效已满一年。

2.按基金合同约定,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资产配置规定。

4 基金管理人、基金托管人

4.1基金管理人及基金托管人

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司,成立于2016年3月27日,总部注册地系位于中国香港的基金公司,注册资本为3亿元人民币,注册地址为北京市朝阳区望京街10号,加拿大非银行,北京有金融研究院(2017年1月2日更名)为“中加基金集团有限公司”,以下简称“中加集团”,持股比例分别为62%、30.9%。

报告期内,本公司共管理二十一基金,分别为中加货币市场基金、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加中债信用增强债券型证券投资基金、中加增信纯债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AAA金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AA+金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AA金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AA-金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级A金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级A-金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB+金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB-金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB+企业债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB企业债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB-企业债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB+短期融资券债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB短期融资券债券型证券投资基金。

4.2基金管理人、基金托管人

基金管理人:中加基金管理有限公司,注册地址:北京市朝阳区望京街10号,注册资本:3亿元人民币,法定代表人:王超,总经理:王超,成立日期:2016年3月27日,基金管理人、基金托管人

基金托管人:瑞银银行股份有限公司,注册地址:瑞士,注册资本:瑞士法郎1000亿,法定代表人:王超,总经理:王超,成立日期:1987年11月1日,基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

本基金在初始确认时收取申购费或赎回费的目的,把金融资产和基金负债分为不同类别,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和基金负债,应收款、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融资产。本基金视不同金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金视不同金融资产分类为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有待售的股权投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.44.4金融资产和金融负债的确认和计量

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。在初始确认时,金融资产和金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益;

(2)收取固定或可确定金额金融资产和金融负债以摊余成本计量;

(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以公允价值计量采用实际利率法按摊余成本进行后续计量;

满足下列条件之一时,本基金终止确认金融资产:

(1)收取金融资产现金流量的合同权利终止;

(2)金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权几乎所有的风险和报酬转移给对方;

(3)金融资产已转移,但本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权几乎所有的风险和报酬,且没有对金融资产进行控制,并保留金融资产所有权且仍承担金融资产所有权几乎所有的风险和报酬,但保留了对金融资产的控制,并保留金融资产所有权且仍承担金融资产所有权几乎所有的风险和报酬。

5.3报告期内本基金托管人遵守法律法规、基金合同及其他法律法规的情况说明

本报告期内,本基金托管人严格遵守法律法规、基金合同及其他法律法规,按照法律法规、基金合同及托管协议的约定履行了应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务数据摘要(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金
单位:人民币元

资产	期初	本期	上期
	2018年06月30日	2017年12月31日	2017年06月30日
货币:			
现金	6471	16,272,078	67,476,168.88
结算备付金	-	220,923.52	206,194.10
应收利息	-	62,303.84	48,425.10
应收股利	-	-	-
买入返售金融资产	6472	95,837,346.56	131,168,536.78
其他应收款	-	95,837,346.56	131,168,536.78
基金投资	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-
可供出售金融资产	-	-	-
持有至到期投资	-	-	-
长期股权投资	-	-	-
投资性房地产	-	-	-
固定资产	-	-	-
无形资产	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
资产总计	6473	312,137,668.61	330,859,335.54
负债:			
短期借款	-	-	-
应付票据	-	-	-
应付账款	-	-	-
预收款项	-	-	-
应付职工薪酬	-	-	-
应交税费	-	-	-
其他应付款	-	-	-
持有待售负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
所有者权益:			
实收资本	6473	126,825,042.8	102,814,114.75
未分配利润	6470	-15,266,102.01	5,682,204.74
所有者权益合计	6473	111,558,922.79	108,496,324.49
负债和所有者权益总计	6473	312,137,668.61	330,859,335.54

注:1.所述基金负债指标不包括有价证券类基金的各项费用,计入费用后实际资产净值要小于所列数字;

2.本期已实现收益是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公允价值变动收益;

3.本基金合同于2016年6月8日生效,截止2016年6月30日成立已满一年。

3.2基金净值表现

3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准
过去一个月	-6.87%	14.0%	-4.40%
过去三个月	-12.53%	12.1%	-5.28%
过去六个月	-14.24%	14.1%	-6.37%
过去一年	-17.17%	18.6%	-8.07%
自基金合同生效以来	-7.05%	58.4%	-2.57%

注:1.本基金基金合同于2016年6月8日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效已满一年。

2.按基金合同约定,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资产配置规定。

4 基金管理人、基金托管人

4.1基金管理人及基金托管人

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司,成立于2016年3月27日,总部注册地系位于中国香港的基金公司,注册资本为3亿元人民币,注册地址为北京市朝阳区望京街10号,加拿大非银行,北京有金融研究院(2017年1月2日更名)为“中加基金集团有限公司”,以下简称“中加集团”,持股比例分别为62%、30.9%。

报告期内,本公司共管理二十一基金,分别为中加货币市场基金、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加中债信用增强债券型证券投资基金、中加增信纯债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AAA金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AA+金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AA金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级AA-金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级A金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级A-金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB+金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB-金融债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB+企业债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB企业债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB-企业债债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB+短期融资券债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB短期融资券债券型证券投资基金、中加中债1-3年期信用等级BBB-短期融资券债券型证券投资基金。

4.2基金管理人、基金托管人

基金管理人:中加基金管理有限公司,注册地址:北京市朝阳区望京街10号,注册资本:3亿元人民币,法定代表人:王超,总经理:王超,成立日期:2016年3月27日,基金管理人、基金托管人

基金托管人:瑞银银行股份有限公司,注册地址:瑞士,注册资本:瑞士法郎1000亿,法定代表人:王超,总经理:王超,成立日期:1987年11月1日,基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

基金管理人、基金托管人

2018年半年度报告摘要

金额单位:人民币元

项目	本期	上期
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
基金份额持有人	20,000,000.00	50,000,000.00
基金份额持有人户数	157,786	157,786
基金份额持有人户数(户)	157,786	