中加心悦灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加心悦混合	
基金主代码	005371	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年03月08日	
报告期末基金份额总额	130,001,688.89份	
投资目标	在深入研究的基础上,运用灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理,发现并精选能够分享中国经济发展方式调整中的上市公司构建投资组合。在严格控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略,通过前瞻性地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,完成股票组合的构建,并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上,力争实现长期稳健的绝对收益。	
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债总全价指数收益率	
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高预期和预期风险水平的投资品种,其预期收益和预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中加心悦混合A	中加心悦混合C
下属分级基金的交易代码	005371	005372
报告期末下属分级基金的份额总额	130,000,468.83份	1,220.06份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日)	
	中加心悦混合A	中加心悦混合C
1.本期已实现收益	905,632.54	8.63
2.本期利润	1,248,853.34	11.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0097
4.期末基金资产净值	132,614,552.04	1,244.11
5.期末基金份额净值	1.0201	1.0197

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

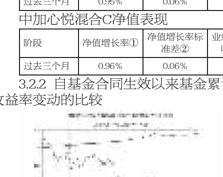
中加心悦混合A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.95%	0.06%	-0.80%	0.67%	1.75%	-0.61%

中加心悦混合C净值表现

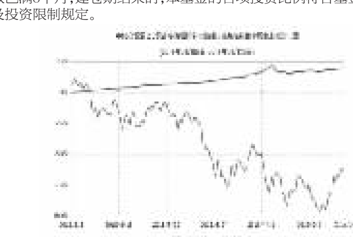
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.96%	0.06%	-0.80%	0.67%	1.76%	-0.61%

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2018年3月8日生效,截至本报告期末,本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6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。



注:1.本基金基金合同于2018年3月8日生效,截至本报告期末,本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6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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
廉晓婵	本基金基金经理	2018-03-08	-	11	廉晓婵女士,南开大学经济学硕士,具有多年证券从业经验,曾担任Copal Partners(英国)投资银行分析师,汤森路透全球资本市场部固定收益产品经理,安邦资产管理有限责任公司固定收益研究员。2013年加入中加基金,任固定收益投资经理。现任中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2017年7月20日至今)、中加颐享纯债债券型基金基金经理(2017年7月27日至今)、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年9月15日至今)、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2017年11月17日至今)、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年3月8日至今)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年7月25日至今)。
张旭	本基金基金经理	2018-03-08	-	10	硕士,曾就职于东软集团、隆圣投资管理有限公司,2012年3月至2015年3月就职于银华基金管理有限公司,任年金与特定客户资产管理计划投资经理,2015年3月加入中加基金管理有限公司,任权益投资部负责人,中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年8月13日至今)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年12月2日至今)、中加瑞盈债券型证券投资基金基金经理(2016年3月23日至今)、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年3月8日至今)、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年4月4日至今)、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年9月5日至今)。
杨旸	本基金基金经理	2018-08-10	-	7	杨旸女士,金融学硕士,具有CFA资格,7年证券从业经验,2011年2月至2015年6月,任职于工商银行股份有限公司,担任固收投资经理;2015年7月至2016年7月,任职于招商银行股份有限公司,担任固收投资经理;2016年8月至2017年7月,任职于西南证券股份有限公司,担任固收投资副总监。于2017年10月加入中加基金管理有限公司,任固定收益部投资经理。现任中加颐信纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年6月14日至今)、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐享纯债债券型基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年9月14日至今)。

1、任职日期说明:廉晓婵、张旭的任职日期以本基金基金合同生效公告为准,杨旸女士的任职日期以本基金增聘基金经理的公告为准。

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、本基金无基金经理助理。

5、廉晓婵女士因个人原因(休产假)休假将超过30日,本公司根据法规和公司制度批准廉晓婵女士于2018年8月13日起休假,详情请见本基金相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期内,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 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制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时,公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果,表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年第三季度,债市呈现震荡,7月份债券收益率整体呈现下行,尤其短久期高评级信用债和三年以内利率债收益率出现明显下行, 主要原因为7月初降准后,资金面出现明显的宽松,经济基本面下滑的趋势确立,宽货币向宽信用传导受阻,贸易战的超预期演进带来避险情绪的推升等多重利好齐发力,推动债券收益率出现显著下行,尤其短期限债券收益率下行幅度更大,曲线呈现牛陡。7月末,因资金非常充裕,银行间回购利率曾一度低于央行投放的逆回购利率,货币政策的传导面临失效,市场传言央行重启正回购,银行间回购利率也确实由低点向上,扭转了市场利率与政策利率倒挂的尴尬局面;7月末的政治局会议,提出了"六个稳",市场预期稳增长的措施会出台,是否重走房地产基建刺激老路的担忧再起;资管新规过度期的政策有所放松,利好非标融资的回升;外围土耳其、阿根廷等国汇率出现大幅贬值,市场对人民币汇率有所担忧,对中美的政策利率和债券市场利率的舒服区间有所忌惮;导致收益率走出一波快速上行;此后,通胀预期的抬头,地方债的天量供给都对债市构成压制,收益率延续弱势,至今未回到8月初的最低点。当前,市场面临类滞胀格局,经济数据还尚未有起色,宽信用面临约束;但猪价上涨,菜价、油价、房租等价格上涨,抬升了通胀预期;后期主要关注美、欧、日的货币收紧进程、人民币汇率的变动方式;油价的走势变动;基建发力的时间点和程度等因素。

报告期内,基金主要以利率债和同业存单为主要新增投资标的,有效控制了信用风险,并取得了一定的票息收入。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加心悦混合A基金份额净值为1.0201元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.95%,同期业绩比较基准收益率为-0.80%;截至报告期末中加心悦混合C基金份额净值为1.0197元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.96%,同期业绩比较基准收益率为-0.80%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本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元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	157,844,000.00	98.59
	其中:债券	157,844,000.00	98.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	831,457.49	0.52
8	其他资产	1,422,722.54	0.89
9	合计	160,098,180.03	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,767,000.00	22.45
	其中:政策性金融债	29,767,000.00	22.45
4	企业债券	10,125,000.00	7.63
5	企业短期融资券	20,185,000.00	15.22
6	中期票据	30,309,000.00	22.85
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	67,458,000.00	50.87
9	其他	-	-
10	合计	157,844,000.00	119.02

5.5 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

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	111886134	18广州农村商业银行CD076	500,000	48,200,000.00	36.35
2	160206	16国开06	200,000	19,654,000.00	14.82
3	111821243	18渤海银行CD243	200,000	19,258,000.00	14.52
4	101761006	17首钢MTN002	100,000	10,264,000.00	7.74
5	101451033	14烟台港MTN001	100,000	10,162,000.00	7.66

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票,不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,969.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,419,753.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,422,722.54

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	中加心悦混合A	中加心悦混合C
报告期期初基金份额总额	130,000,488.71	1,220.06
报告期期间基金总申购份额	0.00	0.00
减:报告期期间基金总赎回份额	19.88	0.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	130,000,468.83	1,220.06

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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	20180701-20180930	28,998,000.00	0.00	0.00	28,998,000.00	23.08%
	2	20180701-20180930	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	76.92%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,该投资者所持有的基金份额的占比较大,该投资者在赎回其所持有的基金份额时,存在基金份额净值波动的风险;另外,该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时,基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准中加心悦灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《中加心悦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中加心悦灵活配置混合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

9.2 存放地点

基金管理人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管办公人地址:杭州市延安路368号

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话:400-00-95526(免长途费)

基金管理人网址:www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

2018年10月23日

中加紫金灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加紫金混合	
基金主代码	005373	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年04月04日	
报告期末基金份额总额	124,712,131.08份	
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,通过对行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入研究,选择出质地优秀、成长性良好的公司进行投资,寻求基金资产的长期稳健增值,力争获得超越业绩比较基准的回报。	
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略,通过前瞻性地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,完成股票组合的构建,并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上,力争实现长期稳健的收益。	
业绩比较基准	中证800指数收益率×40%+恒生指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种,其预期收益和预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中加紫金混合A	中加紫金混合C
下属分级基金的交易代码	005373	005374
报告期末下属分级基金的份额总额	90,033,221.63份	34,678,909.45份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日)	
	中加紫金混合A	中加紫金混合C
1.本期已实现收益	-9,038,973.53	-3,543,556.81
2.本期利润	-3,877,149.96	-1,473,676.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0413	-0.0417
4.期末基金资产净值	77,605,859.04	29,840,389.16
5.期末基金份额净值	0.8620	0.8605

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

中加紫金混合A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.49%	1.09%	-2.12%	0.77%	-2.37%	0.32%

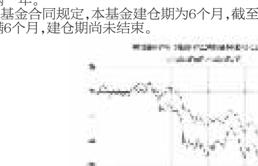
中加紫金混合C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.58%	1.09%	-2.12%	0.77%	-2.46%	0.32%

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

1.本基金基金合同于2018年4月4日生效,截止本报告期末,本基金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6个月,截至本报告期末,本基金基金合同生效未满6个月,建仓期尚未结束。



1.本基金基金合同于2018年4月4日生效,截止本报告期末,本基金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6个月,截至本报告期末,本基金基金合同生效未满6个月,建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
许飞虎	本基金基金经理	2018-05-08	-	7	中国人民大学统计学硕士,先后就职于华西证券、合众人寿资产管理公司,担任量化投资研究员、量化投资经理。2017年12月加入中加基金,任职资产配置与基金投资部副总监,主管量化投资团队、量化产品研发和投资。2018年5月8日起任中加紫金灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张旭	本基金基金经理	2018-04-04	-	10	硕士研究生,曾就职于东软集团、隆圣投资管理有限公司,2012年3月至2015年3月就职于银华基金管理有限公司,任年金与特定客户资产管理计划投资经理,2015年3月加入中加基金管理有限公司,任投资研究部权益投资负责人,中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年8月13日至今)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年12月2日至今)、中加瑞盈债券型证券投资基金基金经理(2016年3月23日至今)、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年3月8日至今)、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年4月4日至今)、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年9月5日至今)。

1、任职日期说明:张旭的任职日期以本基金基金合同生效公告为准,许飞虎的任职日期以本基金基金经理增聘公告为准。

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、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期内,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 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制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时,公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果,表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内,中加紫金严格按照量化投资模型信号进行操作,并根据风格和多空择时来调整投资组合。进入第三季度,风格模型持续提示当前市场风格为大小盘均衡,多空模型也并未提示市场存在极端风险。9月初,依据上市公司半年报数据,结合因子模型,分别筛选出红利优选稳健和新兴行业成长两个量化策略最新投资组合,按照等权重均衡配比对基金持仓进行了调整。香港市场方面,考虑到南下资金不断流出、北上资金大幅流入,港股配置仓位较轻,以择机波段操作为主。

年初以来,A股市场基本处于单边下行趋势之中,整体信心十分脆弱。进入三季度,弱势寻底依然是主旋律,上证综指一度下探至2644点,与2016年2638点仅一线之隔,而9月下旬短暂反弹后再度陷入震荡。从历史数据看,指数V型反转走出底部的情形极为罕见,反复磨底、以时间换空间更为常见。就当前时点来说,市场对于宏观经济的担忧仍在,加之贸易战、美联储加息等外围因素长期扰动,较难出现全面反弹,结构性分化、频繁轮动依然是未来A股主要特征。

展望未来,从影响市场的各个因素看,资管新规细则出台,严监管靴子正式落地,各条款温和执行超出市场预期,政府提出宽信用、稳杠杆,说明当前点位已经到达政策底部区间;估值方面,各主要指数已达到或接近历史最低点,尤其是中小盘估值泡沫得到充分压缩;而市场的底部,则还需要进一步确认,尽管连出现反弹,但是量能始终未出现有效放大,弱势震荡僵局仍将持续。但是,随着宏观政策刺激、资金面宽松预期,估值日趋合理等有利因素不断积累,以及富时罗素指数正式纳入A股、MSCI增加纳入权重等利好下外部资金持续流入,A股走出底部的动力将不断增强,左侧配置价值不断凸显。

中加紫金将继续以业绩向好优质标的为基础股票池, 回避业绩变脸危险品种,使用量化多因子模型,全面考量股息率、估值、盈利质量等多方面因子,从防守型的高股息、低估值大盘稳健型标的,以及符合国家战略导向和产业升级方向的新兴产业、成长空间大、盈利较为确定的中小盘成长标的,两个大的方向做均衡配置,以适应市场风格飘忽不定,轮动迅速的特征,获取更加稳健的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加紫金混合A基金份额净值为0.8620元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-4.49%,同期业绩比较基准收益率为-2.12%;截至报告期末中加紫金混合C基金份额净值为0.8605元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-4.58%,同期业绩比较基准收益率为-2.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本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元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	92,029,095.40	85.29
	其中:股票	92,029,095.40	85.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,808,805.47	8.16
8	其他资产	7,061,909.43	6.54
9	合计	107,899,810.30	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	184,038.40	0.17
B	采矿业	5,831,266.00	5.43
C	制造业	50,126,443.55	46.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,019,936.00	1.88
E	建筑业	2,831,470.50	2.64
F	批发和零售业	2,735,645.00	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	4,687,849.80	4.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,896,115.00	3.63
J	金融业	9,432,874.00	8.78
K	房地产业	8,618,426.60	8.02
L	租赁和商务服务业	469,542.10	0.44
M	科学研究和技术服务业	232,028.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	709,176.00	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	248,160.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	92,022,970.95	85.65

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	港股通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比(%)
金融	6,124.45	0.01
合计	6,124.45	0.01

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	90,500	2,199,150.00	2.05
2	601398	工商银行	284,000	1,638,680.00	1.53
3	601288	农业银行	417,500	1,624,075.00	1.51
4	000338	潍柴动力	185,400	1,585,170.00	1.48
5	601939	建设银行	216,400	1,566,736.00	1.46
6	600028	中国石化	219,500	1,562,840.00	1.45
7	600585	海螺水泥	40,300	1,482,637.00	1.38
8	601318	中国平安	21,600	1,479,600.00	1.38
9	600019	宝钢股份	186,300	1,462,455.00	1.36
10	000709	河钢股份	447,600	1,459,176.00	1.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金本报告期内投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	56,980.70
2	应收证券清算款	7,007,527.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-2,598.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,061,909.43

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	中加紫金混合A	中加紫金混合C
报告期期初基金份额总额	99,176,890.74	35,646,031.13
报告期期间基金总申购份额	303,865.42	318,095.88
减:报告期期间基金总赎回份额	9,447,534.53	1,285,217.56
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	90,033,221.63	34,678,909.45

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,该投资者所持有的基金份额的占比较大,该投资者在赎回其所持有的基金份额时,存在基金份额净值波动的风险;另外,该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时,基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准中加紫金灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《中加紫金灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中加紫金灵活配置混合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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话:400-00-95526(免长途费)

基金管理人网址:www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

2018年10月23日

中加颐信纯债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加颐信纯债债券	
基金主代码	006068	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年06月14日	
报告期末基金份额总额	769,878,687.57份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,长期内力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	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,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在非信用类固定收益类证券(国债、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例。	
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,其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中加颐信纯债债券A	中加颐信纯债债券C
下属分级基金的交易代码	006068	006069
报告期末下属分级基金的份额总额	769,877,187.57份	1,500.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日)	
	中加颐信纯债债券A	中加颐信纯债债券C
1.本期已实现收益	9,992,923.83	19.51
2.本期利润	11,698,412.72	22.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0152	0.0152
4.期末基金资产净值	775,731,260.09	1,511.45
5.期末基金份额净值	1.0076	1.0076

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

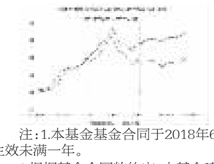
中加颐信纯债债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.52%	0.06%	0.57%	0.07%	0.95%	-0.01%

中加颐信纯债债券C净值表现

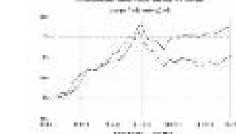
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.52%	0.06%	0.57%	0.07%	0.95%	-0.01%

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2018年6月14日生效,截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2.根据基金合同的约定,本基金建仓期为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。



注:1.本基金基金合同于2018年6月14日生效,截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2.根据基金合同的约定,本基金建仓期为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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
杨旸	本基金基金经理	2018-06-14	-	7	杨旸女士,金融学硕士,具有CFA资格,7年证券从业经验,2011年2月至2015年6月,任职于工商银行股份有限公司,担任固收投资经理;2015年7月至2016年7月,任职于招商银行股份有限公司,担任固收投资经理;2016年8月至2017年7月,任职于西南证券股份有限公司,担任固收投资副总监。于2017年10月加入中加基金管理有限公司,任固定收益部投资经理。现任中加颐信纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年6月14日至今)、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐享纯债债券型基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年8月10日至今)、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年9月14日至今)。

1、任职日期说明:杨旸的任职日期以本基金的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、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期内,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 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制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时,公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果,表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年第三季度,债市呈现震荡,7月份债券收益率整体呈现下行,尤其短久期高评级信用债和三年以内利率债收益率出现明显下行, 主要原因为7月初降准后,资金面出现明显的宽松,经济基本面下滑的趋势确立,宽货币向宽信用传导受阻,贸易战的超预期演进带来避险情绪的推升等多重利好齐发力,推动债券收益率出现显著下行,尤其短期限债券收益率下行幅度更大,曲线呈现牛陡。7月末,因资金非常充裕,银行间回购利率曾一度低于央行投放的逆回购利率,货币政策的传导面临失效,市场传言央行重启正回购,银行间回购利率也确实由低点向上,扭转了市场利率与政策利率倒挂的尴尬局面;7月末的政治局会议,提出了"六个稳",市场预期稳增长的措施会出台,是否重走房地产基建刺激老路的担忧再起;资管新规(即《中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发【2018】106号))过度期的政策有所放松,利好非标融资的回升;外围土耳其、阿根廷等国汇率出现大幅贬值,市场对人民币汇率有所担忧,对中美的政策利率和债券市场利率的舒服区间有所忌惮;导致收益率走出一波快速上行;此后,通胀预期的抬头,地方债的天量供给都对债市构成压制,收益率延续弱势,至今未回到8月初的最低点。当前,市场面临类滞胀格局,经济数据还尚未有起色,宽信用面临约束;但猪价上涨,菜价、油价、房租等价格上涨,抬升了通胀预期;后期主要关注美、欧、日的货币收紧进程、人民币汇率的变动方式;油价的走势变动;基建发力的时间点和程度等因素。

本报告期内,基金主要以利率债和存单为主要投资标的,以有效规避信用风险,同时,以短久期债券为主要投资标的,操作较为稳健,也充分享受到了曲线牛陡带来的资本利得。在7月上半月,进行了长久期利率债的波段操作,赚取了一部分资本利得收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加颐信纯债债券A基金份额净值为1.0076元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.52%,同期业绩比较基准收益率为0.57%;截至报告期末中加颐信纯债债券C基金份额净值为1.0076元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.52%,同期业绩比较基准收益率为0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本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元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	938,793,000.00	98.70
	其中:债券	938,793,000.00	98.70
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	133,654.03	0.01
8	其他资产	12,263,810.54	1.29
9	合计	951,190,464.57	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	734,490,000.00	94.68
	其中:政策性金融债	734,490,000.00	94.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	144,759,000.00	18.66
9	其他	59,544,000.00	7.68
10	合计	938,793,000.00	121.02

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 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

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	180407	18农发07	3,000,000	301,320,000.00	38.84
2	180208	18国开08	1,800,000	181,854,000.00	23.44
3	180207	18国开07	1,700,000	170,408,000.00	21.97
4	170209	17国开09	500,000	50,545,000.00	6.52
5	111819357	18恒丰银行CD357	500,000	48,145,000.00	6.21

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期编制日前一年内,恒丰银行收到银监罚决字【2017】30号行政处罚决定书,对其罚没合计人民币16692.21363万元。华融湘江银行收到永银监罚字【2017】35号行政处罚决定书,对其永州分行处以人民币20万元罚款。厦门国际银行收到京银监罚决字【2017】15号、16号行政处罚决定书,对厦门国际银行北京分行处以50万元罚款,本基金投资与"恒丰银行""华融湘江银行""厦门国际银行"相关证券的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。我们后续将密切关注企业的经营状况、以及其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性。

本报告期内,本基金投资的其他七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金未投资股票,不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,471.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,246,339.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,263,810.54

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	中加颐信纯债债券A	中加颐信纯债债券C
报告期期初基金份额总额	769,877,207.45	1,500.00
报告期期间基金总申购份额	0.00	0.00
减:报告期期间基金总赎回份额	19.88	0.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	769,877,187.57	1,500.00

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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	20180701-20180930	199,968,009.30	0.00	0.00	199,968,009.30	25.97%
	2	20180701-20180930	299,909,027.29	0.00	0.00	299,909,027.29	38.96%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,该投资者所持有的基金份额的占比较大,该投资者在赎回其所持有的基金份额时,存在基金份额净值波动的风险;另外,该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时,基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准中加颐信纯债债券型证券投资基金设立的文件

2、《中加颐信纯债债券型证券投资基金基金合同》

3、《中加颐信纯债债券型证券投资基金基金合同》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人办公地址:杭州市延安路368号

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话:400-00-95526(免长途费)

基金管理人网址:www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

2018年10月23日