中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年06月30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:2019年07月19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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加瑞鑫纯债债券
基金主代码	006827
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月17日
报告期末基金份额总额	2,238,927,459.61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。
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,确定资产在信用债与利率债之间的配置比例。
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	兴业银行股份有限公司

§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(2019年04月01日 – 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	7,554,199.20
2.本期利润	11,615,299.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0114
4.期末基金资产净值	2,262,620,576.29
5.期末基金份额净值	1.0106

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。

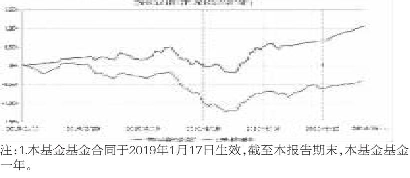
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	0.55%	0.06%	–0.24%	0.06%	0.79%	0.00%

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2019年1月17日生效,截至本报告期末,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,本基金的基金合同生效未满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		
杨宇俊	本基金基金经理	2019–1–17	–	11	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。曾任北京银行总行资金交易部分析师,负责债券市场和货币市场的研究与投资工作。2013年加入中加基金,任专户投资经理,具备基金从业资格。现任中加瑞盈债券型证券投资基金(2016年3月23日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(2016年6月17日至今)、中加丰尚纯债债券型证券投资基金(2016年8月19日至今)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金(2016年12月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金(2016年11月2日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金(2016年11月11日至今)、中加丰享纯债债券型证券投资基金(2016年11月11日至今)、中加丰裕纯债债券型证券投资基金(2016年11月28日至今)、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年6月8日至今)、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金(2019年1月17日至今)、中加颐智纯债债券型证券投资基金(2019年4月29日至今)的基金经理。

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。

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

2019年2季度,债券市场波动性明显加大。4月份,各项数据均超市场预期,PMI重新回到荣枯线上方、GDP、工业增加值、消费数据、金融数据均表现良好,中央政治局会议定调经济以及货币政策委员会一季度例会也调整了货币政策的一些措词和基调,使得市场出现快速的调整。10年期国债收益率从3.15%的平台一路上行到3.40%左右。进入5月份后,受到中美贸易战冲突升级、各项数据回落的影响,债市收益率也开启了下行行情。

展望下半年,债市可能延续上半年的波动行情。经济层面在出口下降、投资下滑、消费趋弱的背景下,央行仍将引导实体经济降低融资成本,货币政策有望延续上半年政策,流动性仍将保持合理充裕,有利于债市。财政政策方面,基建仍将发力,托底经济下滑压力,这可能成为债市波动之源。此外,市场整体信用风险偏好低,流动性分层与信用分层现象仍将存在,有利于利率债与高等级信用债行情。

报告期内,通过对经济基本面、资金面、政策面、市场情绪等的密切跟踪和预判,积极调整组合杠杆和久期水平,及时进行券种切换,严格甄别个券的估值,做好波段操作,提高了组合的收益水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加瑞鑫纯债债券基金份额净值为1.0106元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.55%,同期业绩比较基准收益率为–0.24%。

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	2,703,298,100.00	98.28
	其中:债券	2,703,298,100.00	98.28
	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	753,828.58	0.03
8	其他资产	46,570,329.02	1.69
9	合计	2,750,622,257.60	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

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	2,509,178,100.00	110.90
	其中:政策性金融债	2,509,178,100.00	110.90
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	194,120,000.00	8.58
9	其他	–	–
10	合计	2,703,298,100.00	119.48

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	160206	16国开06	2,700,000	269,514,000.00	11.91
2	130422	13农发22	2,000,000	205,020,000.00	9.06
3	190403	19农发03	1,300,000	129,857,000.00	5.74
4	190301	19进出01	1,300,000	129,792,000.00	5.74
5	150316	15进出16	1,100,000	110,660,000.00	4.89

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 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 本报告期内,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	2,234.86
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	46,568,094.16
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	46,570,329.02

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

报告期期初基金份额总额	200,001,482.99
报告期期间基金总申购份额	2,088,924,976.62
减:报告期期间基金总赎回份额	49,999,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	2,238,927,459.61

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	20190524–20190630	0.00	497,362,976.23	0.00	497,362,976.23	22.21%
	2	20190401–20190523	59,999,000.00	298,417,387.84	0.00	358,416,387.84	16.01%
	3	20190401–20190422	49,999,000.00	0.00	49,999,000.00	0.00	0.00%
	4	20190401–20190630	89,999,000.00	994,726,947.18	0.00	1,084,725,947.18	48.45%
产品特有风险							
本基金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瑞鑫纯债债券型证券投资基金设立的文件
2、《中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》
3、《中加瑞鑫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

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:上海市江宁路168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
2019年07月19日

中加裕盈纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年06月30日
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月19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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年04月18日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加裕盈纯债债券
基金主代码	007121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月18日
报告期末基金份额总额	200,001,846.12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。
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	交通银行股份有限公司

§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(2019年04月18日 – 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	1,006,458.84
2.本期利润	990,028.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050
4.期末基金资产净值	200,991,874.96
5.期末基金份额净值	1.0050

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。

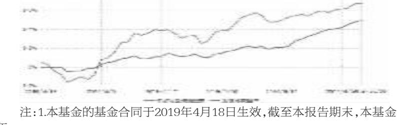
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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
自基金合同生效起至今	0.50%	0.02%	0.68%	0.05%	–0.18%	–0.03%

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.本基金的基金合同于2019年4月18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		
杨旸	本基金基金经理	2019–4–18	–	8	杨旸女士,金融学硕士,具有CFA资格,8年证券从业经验,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。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(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(2018年8月10日至今)、中加颐享纯债债券型证券投资基金(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(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(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(2018年8月10日至今)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金(2018年8月10日至今)、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金(2018年9月14日至今)、中加颐智纯债债券型证券投资基金(2018年11月29日至今)、中加瑞利纯债债券型证券投资基金(2018年12月26日至今)、中加裕盈纯债债券型证券投资基金(2019年4月18日至今)、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年7月12日至今)的基金经理。

1、任职日期说明:杨旸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。

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

2019年二季度,债券收益率先扬后抑,一季度的天量信贷和上冲的经济数据为债市泼了一盆冷水降温。但事后分析,增值税下调前的行业提前备货,以及地方债的发行前置是造成基本面预期差的重要原因。4月份开始,经济数据显露疲态。5月经济数据继续低迷。这波收益率的下行,究其根本原因是经济再次陷入低迷,但其低迷程度,不足以促成收益率如此之高的下行幅度和速度,经济基本面之外,还有几个助力的因素:第一,美联储的态度发生转变,超预期传递降息预期,其他国家货币政策也纷纷保持宽松,我国货币政策宽松的空间就此打开,中美利差维持高位,发达国家的流动性外溢对我国的债券收益率可能产生影响;第二,市场原本以为告一段落的贸易谈判陷入僵局,对风险偏好形成一定打击;第三,包商银行被托管。同业市场发生了一场小的信任危机,AA+及以下评级的存单发行困难,流动性分层现象极其突出,部分非银机构融资出现困难,结构化发行浮出水面,不得不通过货币市场大幅放水加各种窗口指导来平复流动性困难。上述几点原因,虽然有不可预测和超预期的成分,但确实都促成了5月以来的收益率快速下行。

展望后市,收益率低位有望维持一段时间,随着经济悲观预期的扩散,后续应渐渐重视可能出现的构成利空的因素,例如逆周期调节政策的加码,金融数据的再次上冲,贸易战超预期缓和带来风险偏好的提升等。

本报告期内,基金尚处于建仓期,主要以利率债为主要投资标的,以有效规避信用风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加裕盈纯债债券基金份额净值为1.0050元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.50%,同期业绩比较基准收益率为0.68%。

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	191,672,000.00	95.31
	其中:债券	191,672,000.00	95.31
	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	6,960,130.44	3.46
	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	980,248.02	0.49
8	其他资产	1,493,435.23	0.74
9	合计	201,105,813.69	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

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	191,672,000.00	95.36
	其中:政策性金融债	191,672,000.00	95.36
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	–	–
9	其他	–	–
10	合计	191,672,000.00	95.36

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	170205	17国开05	1,900,000	191,672,000.00	95.36

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 本报告期内,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	19,524.84
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,473,910.39
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	1,493,435.23

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

基金合同生效日的基金份额总额	200,001,846.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	–
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	200,001,846.12

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	20190418–20190630	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	25.00%
	2	20190418–20190630	69,999,000.00	0.00	0.00	69,999,000.00	35.00%
	3	20190418–20190630	79,999,000.00	0.00	0.00	79,999,000.00	40.00%
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裕盈纯债债券型证券投资基金设立的文件
2、《中加裕盈纯债债券型证券投资基金基金合同》
3、《中加裕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

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:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188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
2019年07月19日

永赢双利债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年06月30日
基金管理人:永赢基金管理有限公司
基金托管人:华泰证券股份有限公司
报告送出日期:2019年07月19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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月17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2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	永赢双利债券	
基金主代码	002521	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年05月25日	
报告期末基金份额总额	216,225,346.99份	
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略,通过自上而下的方法进行固定收益和权益类品种的动态配置,在控制基金资产净值波动的基础上,追求适度的超额收益。 (一)大类资产配置策略 本基金资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,通过对宏观经济环境、国家经济政策、债券市场整体收益率曲线变化、资金供求关系和股票市场等因素的分析,研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段,积极、主动地确定权益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整,以追求适度的超额收益。 (二)债券选择策略 本基金债券投资将主要采取信用策略,同时辅以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大程度上取得超额收益。 1、信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益,所以在个券的选择中特别重视信用风险的评估和防范。本基金采用经认可的评级机构的评级结果进行债券筛选,同时对债券发行人以及债务信用风险的评估进行债券投资范围的调整及投资策略的运用。本基金根据国民经济运行周期阶段,分析债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用等级,确定债券的信用风险利差。 2、久期策略 本基金将通过自上而下的组合久期管理策略,以实现对组合利率风险的有效控制。本基金将根据对宏观经济周期所处阶段及其它相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,以减小债券价格下降带来的风险。 3、收益率曲线配置策略 本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线,通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。 在考察收益率曲线的基础上,本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等,以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。一般而言,当预期收益率曲线变陡时,本基金将采用集中策略;当预期收益率曲线变平时,将采用哑铃策略;在预期收益率曲线不变或平行移动时,则采用梯形策略。 本基金还将通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素,确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占投资比例。 4、息差策略 本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。 5、骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析,在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下,随着其剩余期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑,从而获得较高的资本收益;即使收益率曲线上升或进一步陡峭,这一策略也能提供更多的安全边际。 6、信用债券精选策略 本基金将根据信用债券市场的收益率水平,在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上,建立不同品种的收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型,并通过这些模型进行估值,重点选择具备以下特征的信用债券:较高到期收益率、较高当期收入、价值被低估、预期信用质量将改善、期权和债权突出、属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。 7、中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面,根据宏观经济运行状况的分析和预判,灵活调整组合的久期。信用风险控制方面,对个券信用资质进行详尽的分析,对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量,尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面,要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。 8、资产支持证券投资策略 资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 (三)股票投资策略 本基金股票投资部分主要采取"自下而上"的投资策略,回避对市场短期趋势的预测,结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断,对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析,追求股票投资组合的长期稳健增值。 (四)权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。 (五)国债期货投资策略 国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	中国债券综合全价指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	永赢双利债券A	永赢双利债券C
下属分级基金的交易代码	002521	002522
报告期末下属分级基金的份额总额	214,270,659.59份	1,954,687.40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(2019年04月01日 – 2019年06月30日)	
	永赢双利债券A	永赢双利债券C
1.本期已实现收益	5,033,106.69	68,383.97
2.本期利润	1,423,198.00	–336.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0071	–0.0001
4.期末基金资产净值	235,055,070.07	2,159,306.99
5.期末基金份额净值	1.0970	1.1047

注:1、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。

2、所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。

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

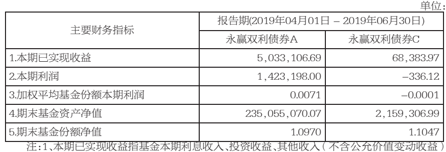
永赢双利债券A净值表现

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	0.65%	0.24%	–0.24%	0.06%	0.89%	0.18%

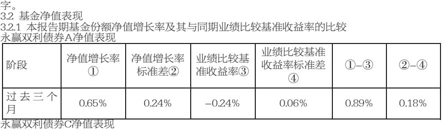
永赢双利债券C净值表现

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	0.56%	0.24%	–0.24%	0.06%	0.80%	0.18%

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:本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同规定。



注:本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
李永兴	副总经理/基金经理	2017–12–1	–	13	李永兴先生,北京大学金融学硕士,13年证券相关从业经验,曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理;九泰基金管理有限公司投资总监;永赢基金管理有限公司总经理助理。现任永赢基金管理有限公司副总经理。
乔嘉麒	固定收益投资部副总监/基金经理	2018–2–5	–	10	乔嘉麒先生,复旦大学经济学学士、硕士,10年证券相关从业经验,曾任宁波银行金融市场部固定收益交易员,从事债券及固定收益衍生品自营交易、自营投资管理、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部副总监。
陆海燕	基金经理	2018–10–15	–	8	陆海燕女士,东南大学金融学硕士,8年证券相关从业经验,曾任泰信基金管理有限公司研究员,光大保德信基金管理有限公司研究员、高级研究员、消费组组长、基金经理,现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。
万纯	基金经理	2019–5–31	–	5	万纯先生,北京大学硕士,5年证券相关从业经验,曾任中国结算技术部基金业务组经理助理;平安基金管理有限公司基金经理助理,现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先、比例分配"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析,每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内,公平交易制度执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,国内市场债券收益率先上后下,季末水平与季初变化不大。4月份,市场对宏观经济回暖的预期逐步增强,同时对货币政策的预期也有所变化,债券收益率出现明显上升,进入5月后,贸易摩擦紧张加剧,同时随着政策刺激力度边际减弱和基数上升,经济数据出现走弱,债券收益率因而回落,此后,受到银行信用风险事件影响,银行间资金面出现严重分层,央行加大了资金投放力度,无风险利率继续下行,但不同资质债券间的利率出现分化。二季度,本基金以配置信用债为主,同时逢收益率高位增加了长债的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢双利债券A基金份额净值为1.0970元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.65%,同期业绩比较基准收益率为–0.24%;截至报告期末永赢双利债券C基金份额净值为1.1047元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.56%,同期业绩比较基准收益率为–0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§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	44,182,212.76	16.84
	其中:股票	44,182,212.76	16.84
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	201,817,000.00	76.94
	其中:债券	201,817,000.00	76.94
	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	12,415,320.21	4.73
8	其他资产	3,883,171.14	1.48
9	合计	262,297,704.11	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

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	13,965,632.40	5.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,740,697.36	5.37
J	金融业	14,830,735.00	6.25
K	房地产业	2,645,148.00	1.12
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	44,182,212.76	18.63

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

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	300059	东方财富	259,240	3,512,702.00	1.48
2	601012	隆基股份	150,300	3,473,433.00	1.46
3	600837	海通证券	234,800	3,331,812.00	1.40
4	000001	平安银行	232,000	3,196,960.00	1.35
5	600030	中信证券	117,100	2,788,151.00	1.18
6	600048	保利地产	207,300	2,645,148.00	1.12
7	600438	通威股份	163,600	2,300,216.00	0.97
8	300454	深信服	26,100	2,284,794.00	0.96
9	601628	中国人寿	76,500	2,166,480.00	0.91
10	601166	兴业银行	109,300	1,999,097.00	0.84

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	60,026,000.00	25.30
	其中:政策性金融债	60,026,000.00	25.30
4	企业债券	90,622,000.00	38.20
5	企业短期融资券	30,259,000.00	12.76
6	中期票据	20,910,000.00	8.81
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	201,817,000.00	85.08

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	180304	18进出04	200,000	20,468,000.00	8.63
2	190301	19进出01	200,000	19,968,000.00	8.42
3	190205	19国开05	200,000	19,590,000.00	8.26
4	101464012	14常熟发投MTN001	100,000	10,640,000.00	4.49
5	112672	18深建01	100,000	10,302,000.00	4.34

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持有股指期货。

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持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内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报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	109,636.51
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,404,724.40
5	应收申购款	368,810.23
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	3,883,171.14

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	永赢双利债券A	永赢双利债券C
报告期期初基金份额总额	192,877,013.93	1,554,143.57
报告期期间基金总申购份额	26,351,867.62	4,808,286.48
减:报告期期间基金总赎回份额	4,958,221.96	4,407,742.65
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	214,270,659.59	1,954,687.40

§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

单位:份

	永赢双利债券A	永赢双利债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	3,524,497.71	–
报告期期间买入/申购总份额	–	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,524,497.71	–
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.63	–

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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	20190401 – 20190602	3,524,497.71	0.00	0.00	3,524,497.71	1.63%
	2	20190603 – 20190620	18,695,896.05	0.00	0.00	18,695,896.05	8.65%
	3	20190621 – 20190630	60,877,849.17	0.00	0.00	60,877,849.17	28.15%
	4	20190401 – 20190630	93,247,855.28	0.00	0.00	93,247,855.28	43.13%
产品特有风险							
本基金在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基金总份额的20%的情况,存在可能因投资者的大额申购或赎回造成基金份额波动的风险。							

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.中国证监会核准永赢双利债券型证券投资基金募集的文件;
2.《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》;
3.《永赢双利债券型证券投资基金托管协议》;
4.《永赢双利债券型证券投资基金招募说明书》及其更新(如有);
5.基金管理人业务资格批件、营业执照;
6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

地点为管理人地址:上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,也可在本基金管理人的网站进行查阅,查询网址:www.maxwealthfund.com.

如有疑问,可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话:021–51690111

永赢基金管理有限公司
2019年07月19日