

中加纯债分级债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:广州农村商业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21日

§ 1 提示性

基金管理人的董事及监事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。

报告期期内基金持有人数或基金资产净值情况说明

报告期期内基金持有人数或基金资产净值未低于预警值。

§ 5 投资组合报告

报告期期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	-	-
2	货币市场基金	-	-
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	824,440,584.10	96.95
5	其中:债券	824,440,584.10	96.95
6	货币资产	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	企业债	-	-
9	其他资产	18,850,761.22	100.00
	合计	843,290,345.32	

注:由于四舍五入的原因基金资产总比例之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期内未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组合

本基金本期未持有债券。

5.3 报告期内未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

本基金本期未持有股票。

5.4 报告期内未按品种分类的债券投资组合

本基金本期未持有债券。

5.5 报告期内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组合

本基金本期未持有贵金属。

5.6 报告期内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组合

本基金本期未持有权证。

5.7 报告期内未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

本基金本期未持有股指期货投资。

5.8 报告期内未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况说明

本基金本期未运用国债期货进行投资。

5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资情况说明

本基金本期未运用股票期权进行投资。

5.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资情况说明

本基金本期未运用股指期权进行投资。

5.11 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资情况说明

本基金本期未运用国债期权进行投资。

5.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有股票信用衍生品。

5.13 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有债券信用衍生品。

5.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资情况说明

本基金本期未持有资产支持证券。

5.15 报告期内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情况说明

本基金本期未持有贵金属。

5.16 报告期内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情况说明

本基金本期未持有权证。

5.17 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

本基金本期未运用股指期货进行投资。

5.18 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况说明

本基金本期未运用国债期货进行投资。

5.19 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资情况说明

本基金本期未运用股票期权进行投资。

5.20 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资情况说明

本基金本期未运用股指期权进行投资。

5.21 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资情况说明

本基金本期未运用国债期权进行投资。

5.22 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有股票信用衍生品。

5.23 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有债券信用衍生品。

5.24 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资情况说明

本基金本期未持有资产支持证券。

5.25 报告期内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情况说明

本基金本期未持有贵金属。

5.26 报告期内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情况说明

本基金本期未持有权证。

5.27 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

本基金本期未运用股指期货进行投资。

5.28 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况说明

本基金本期未运用国债期货进行投资。

5.29 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资情况说明

本基金本期未运用股票期权进行投资。

5.30 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资情况说明

本基金本期未运用股指期权进行投资。

5.31 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资情况说明

本基金本期未运用国债期权进行投资。

5.32 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有股票信用衍生品。

5.33 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有债券信用衍生品。

5.34 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资情况说明

本基金本期未持有资产支持证券。

5.35 报告期内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情况说明

本基金本期未持有贵金属。

5.36 报告期内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情况说明

本基金本期未持有权证。

5.37 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

本基金本期未运用股指期货进行投资。

5.38 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况说明

本基金本期未运用国债期货进行投资。

5.39 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资情况说明

本基金本期未运用股票期权进行投资。

5.40 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资情况说明

本基金本期未运用股指期权进行投资。

5.41 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资情况说明

本基金本期未运用国债期权进行投资。

5.42 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有股票信用衍生品。

5.43 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有债券信用衍生品。

5.44 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资情况说明

本基金本期未持有资产支持证券。

5.45 报告期内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情况说明

本基金本期未持有贵金属。

5.46 报告期内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情况说明

本基金本期未持有权证。

5.47 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

本基金本期未运用股指期货进行投资。

5.48 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况说明

本基金本期未运用国债期货进行投资。

5.49 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资情况说明

本基金本期未运用股票期权进行投资。

5.50 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资情况说明

本基金本期未运用股指期权进行投资。

5.51 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资情况说明

本基金本期未运用国债期权进行投资。

5.52 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有股票信用衍生品。

5.53 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有债券信用衍生品。

5.54 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资情况说明

本基金本期未持有资产支持证券。

5.55 报告期内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情况说明

本基金本期未持有贵金属。

5.56 报告期内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情况说明

本基金本期未持有权证。

5.57 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

本基金本期未运用股指期货进行投资。

5.58 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况说明

本基金本期未运用国债期货进行投资。

5.59 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资情况说明

本基金本期未运用股票期权进行投资。

5.60 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资情况说明

本基金本期未运用股指期权进行投资。

5.61 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资情况说明

本基金本期未运用国债期权进行投资。

5.62 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有股票信用衍生品。

5.63 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券信用衍生品投资情况说明

本基金本期未持有债券信用衍生品。

5.64 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资情况说明