中加丰裕纯债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 09 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:2017 年 10 月 26 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基金合同的规定,于 2017 年 10 月 23 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,投资者在做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 2017 年 07 月 01 日起至 2017 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	中加丰裕纯债债券
基金主代码	003673
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 11 月 28 日
报告期末基金份额总额	1,491,866,165.81 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，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险 / 收益的产品。
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(2017 年 07 月 01 日 - 2017 年 09 月 30 日)
1.本期已实现收益	17,040,576.93
2.本期利润	17,099,315.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115
4.期末基金资产净值	1,547,090,587.61
5.期末基金份额净值	1.0370

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。

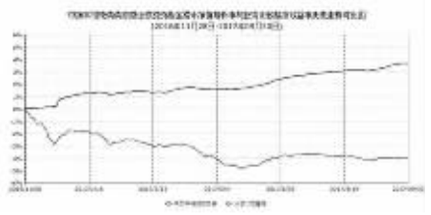
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.11%	0.02%	- 0.15%	0.03%	1.26%	- 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 2016 年 11 月 28 日生效。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。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		
杨宇俊	本基金基金经理	2016- 11- 28	-	9	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。曾任北京银行公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。现任中加心安保本混合型证券投资基金基金经理（ 2016 年 3 月 23 日至今）、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理（ 2016 年 6 月 17 日至今）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金基金经理（ 2016 年 8 月 19 日至今）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理（2016 年 12 月 19 日至今）、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(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基金经理（ 2016 年 11 月 11 日至今）、中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理（ 2016 年 11 月 11 日至今）、中加丰裕纯债债券型证券投资基金基金经理(2016 年 11 月 28 日至今）。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,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,同时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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合间不存在同日反向交易。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,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

2017 年三季度经济基本面对债市整体影响弱化,债市主要受到资金面与情绪面的驱动,整体走出窄幅震荡行情。具体来看,7 月债市在市场情绪面好转、资金面宽松的影响下,收益率延续 6 月行情,继续小幅下行;但进入 8 月、9 月,受到大宗商品价格暴涨、股市好转以及资金状况不佳的影响,债券收益率又重回上行轨道。

展望四季度,预计经济增长回落幅度有限。虽然 9 月 30 日央行的定向降准,但此次定向降准属于替代性政策,明年才会实施,而且实际释放资金规模有限,表明央行的货币政策基调未变,流动性注入模式仍是"削峰填谷"。这对债市投资来说,四季度仍属于博弈交易型机会的阶段。预计整体债市收益率仍将维持震荡区间,长端利率的下降仍需要等待。后续操作我们仍将以票息收入为主,适时进行波段操作,提高产品收益。

本报告期内,基于对债市资金面、市场情绪面等进行判断,组合维持较低的杠杆水平与久期水平,在严格把控信用风险的前提下,提升了组合的票息收入水平,并较好的规避了收益率上行带来的风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,中加丰裕纯债债券资产净值为 1,547,090,587.61 元,本报告期内基金份额净值增长率为 1.11%,同期业绩比较基准收益率为 -0.15%。

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	1,334,456,300.00	86.21
	其中:债券	1,334,456,300.00	86.21
	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	185,400,466.10	11.98
	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	3,577,675.93	0.23
8	其他资产	24,542,339.43	1.59
9	合计	1,547,976,781.46	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	184,688,000.00	11.94
	其中:政策性金融债	84,848,000.00	5.48
4	企业债券	248,364,200.00	16.05
5	企业短期融资券	587,359,200.00	37.97
6	中期票据	314,044,900.00	20.30
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,334,456,300.00	86.26

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	1380293	13泰州债	1,500,000	144,090,000.00	9.31
2	101654033	16 意洲坝 MTN001	1,200,000	116,508,000.00	7.53
3	011760022	17 陕有色 SCP001	1,000,000	100,440,000.00	6.49
4	041660068	16 西安高新 CP002	1,000,000	100,420,000.00	6.49
5	041751021	17 南山集 CP001	1,000,000	100,160,000.00	6.47

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,542,339.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,542,339.43

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	1,491,865,962.14
报告期间基金总申购份额	1,203.67
减:报告期期间基金总赎回份额	1,000.00
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	1,491,866,165.81

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	20170701 - 20170930	1,491,771,136.99	0.00	0.00	1,491,771,136.99	99.99
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。							

无

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

中国证监会批准中加丰裕纯债债券型证券投资基金设立的文件

《中加丰裕纯债债券型证券投资基金基金合同》

《中加丰裕纯债债券型证券投资基金托管协议》

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
二〇一七年十月二十六日

中加丰盈纯债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 09 月 30 日
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:杭州银行股份有限公司
报告送出日期:2017 年 10 月 26 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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 10 月 23 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 2017 年 07 月 01 日起至 2017 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	中加丰盈纯债债券
基金主代码	003428
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 11 月 02 日
报告期末基金份额总额	270,109,067.97 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，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	杭州银行股份有限公司

§ 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(2017 年 07 月 01 日 - 2017 年 09 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,453,036.56
2.本期利润	3,002,384.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111
4.期末基金资产净值	276,450,237.80
5.期末基金份额净值	1.0235

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	1.10%	0.04%	- 0.15%	0.03%	1.25%	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 2016 年 11 月 2 日生效。至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同约定,本基金建仓期为 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		
杨宇俊	本基金基金经理	2016- 11- 2	-	9	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。曾任北京银行公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。现任中加心安保本混合型证券投资基金基金经理（ 2016 年 3 月 23 日至今）、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理（ 2016 年 6 月 17 日至今）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金基金经理（ 2016 年 8 月 19 日至今）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理（2016 年 12 月 19 日至今）、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(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基金经理（ 2016 年 11 月 11 日至今）、中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理（ 2016 年 11 月 11 日至今）、中加丰裕纯债债券型证券投资基金基金经理(2016 年 11 月 28 日至今）。

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,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,同时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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合间不存在同日反向交易。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,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

2017 年三季度经济基本面对债市整体影响弱化,债市主要受到资金面与情绪面的驱动,整体走出窄幅震荡行情。具体来看,7 月债市在市场情绪面好转、资金面宽松的影响下,收益率延续 6 月行情,继续小幅下行;但进入 8 月、9 月,受到大宗商品价格暴涨、股市好转以及资金状况不佳的影响,债券收益率又重回上行轨道。

展望四季度,预计经济增长回落幅度有限。虽然 9 月 30 日央行定向降准,但此次定向降准属于替代性政策,明年才会实施,而且实际释放资金规模有限。表明央行的货币政策基调未变,流动性注入模式仍是"削峰填谷"。这对债市投资来说,四季度仍属于博弈交易型机会的阶段。预计整体债市收益率仍将维持震荡区间,长端利率的下降仍需要等待。后续操作我们仍将以票息收入为主,适时进行波段操作,提高产品收益。

本报告期内,基于对债市资金面、市场情绪面等进行判断,组合维持较低的杠杆水平与久期水平,在严格把控信用风险的前提下,提升了组合的票息收入水平,并较好的规避了收益率上行带来的风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金份额净值增长率为 0.91%,同期业绩比较基准收益率为 -0.15%;中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金份额净值增长率为 0.86%,同期业绩比较基准收益率为 -0.15%。

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	318,151,100.00	98.10
	其中:债券	318,016,100.00	98.06
	资产支持证券	135,000.00	0.04
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	867,556.16	0.27
8	其他资产	5,287,214.90	1.63
9	合计	324,305,871.06	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

本基金报告期末未持有股票。

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 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	139,384,900.00	50.42
	其中:政策性金融债	65,067,400.00	23.54
4	企业债券	44,355,000.00	16.04
5	企业短期融资券	40,160,000.00	14.53
6	中期票据	49,685,000.00	17.97
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	44,431,200.00	16.07
9	其他	-	-
10	合计	318,016,100.00	115.04

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	290,000	28,744,800.00	10.40
2	101569037	15 桑德 MTN001	250,000	25,035,000.00	9.06
3	143283	17江海 G1	250,000	25,025,000.00	9.05
4	1520036	15徽商银行 01	250,000	24,917,500.00	9.01
5	1520048	15包商银行小微 01	250,000	24,890,000.00	9.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	代码	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689198	16建鑫 1 优先	270,000	135,000.00	0.05

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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收到公开谴责、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	4,129.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,283,085.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,287,214.90

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存在流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的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	270,118,111.87
报告期期间基金总申购份额	915.74
减:报告期期间基金总赎回份额	9,959.64
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	270,109,067.97

§ 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	20170701 - 20170930	100,001,000.00	0.00	0.00	100,001,000.00	37.02
	2	20170701 - 20170930	120,001,400.00	0.00	0.00	120,001,400.00	44.43
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丰盈纯债债券型证券投资基金设立的文件

2、《中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金合同》

3、《中加丰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:杭州市庆春路 46 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
二〇一七年十月二十六日

中加丰润纯债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 09 月 30 日
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2017 年 10 月 26 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 10 月 23 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 2017 年 07 月 01 日起至 2017 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	中加丰润纯债债券
基金主代码	002881
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 06 月 17 日
报告期末基金份额总额	229,936,017.85 份
投资目标	力争在控制投资风险的前提下，力争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，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	中加丰润纯债 A	中加丰润纯债 C
下属分级基金的交易代码	002881	002882
报告期末下属分级基金的份额总额	17,201.68 份	229,918,816.17 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(2017 年 07 月 01 日 - 2017 年 09 月 30 日)	
	中加丰润纯债 A	中加丰润纯债 C
1.本期已实现收益	407.11	3,003,575.27
2.本期利润	278.21	2,015,311.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0163	0.0088
4.期末基金资产净值	31,174.12	236,723,343.55
5.期末基金份额净值	1.8123	1.0296

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

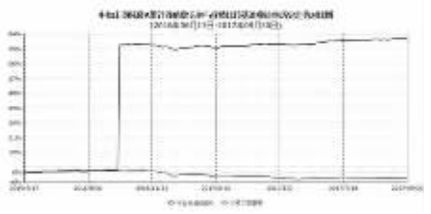
中加丰润纯债 A 净值表现

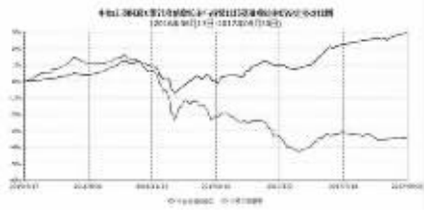
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①- ③	②- ④
过去三个月	0.91%	0.03%	- 0.15%	0.03%	1.06%	0.00%

中加丰润纯债 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	0.86%	0.03%	- 0.15%	0.03%	1.01%	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





1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 17 日生效。至本报告期末,本基金合同生效已满一年。

2、根据基金合同的约定,本基金建仓期 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