中加心享灵活配置混合型证券投资基金

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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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	中加心享混合	
基金主代码	002027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月02日	
报告期末基金份额总额	2,249,386,248.29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。在充分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	30%*沪深300指数收益率+70%*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,其预期收益及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,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种	
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	中加心享A	中加心享C
下属分级基金的交易代码	002027	002533
报告期末下属分级基金的份额总额	2,248,589,518.67份	796,729.62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)	
	中加心享A	中加心享C
1.本期已实现收益	15,010,599.73	4,518.77
2.本期利润	17,813,798.20	6,702.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079	0.0112
4.期末基金资产净值	2,389,968,200.46	968,169.87
5.期末基金份额净值	1.0629	1.2152

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

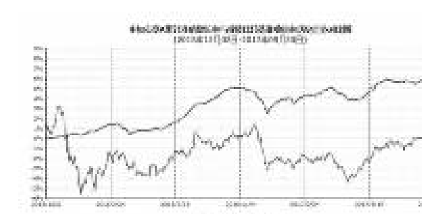
中加心享A净值表现

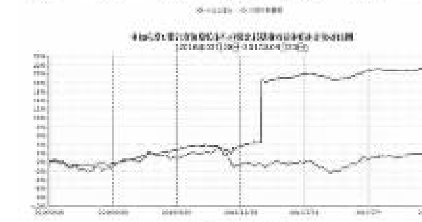
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.75%	0.05%	1.09%	0.17%	-0.34%	-0.12%

中加心享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	0.78%	0.05%	1.09%	0.17%	-0.31%	-0.12%

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





3.3 其他指标

无。

§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		
张旭	本基金基金经理	2015-12-02	-	9	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,任年金和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)。
闫沛贤	投资研究部副总监兼固定收益部总监、本基金基金经理	2015-12-28	-	9	英国帝国理工大学金融学硕士、伯明翰大学计算机硕士学位。2008年至2013年曾任职于平安银行资金交易部、北京银行资金交易部,担任债券交易员。2013年加入中加基金管理有限公司,现任投资研究部副总监兼固定收益部总监、中加货币市场基金基金经理(2013年10月21日至今)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2014年3月24日至今)、中加纯债债券型证券投资基金基金经理(2014年12月17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28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)。

1、任职日期说明:张旭的任职日期以本基金基金合同生效为准,闫沛贤的任职日期以增聘公告为准。

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年三季度债市整体震荡。中债总财富(总值)指数三季度小幅上行0.27%。十年期国债到期收益率总体上行5bp,至3.62%附近。十年期国开债到期收益率总体上行1bp,至4.20%附近。剩余期限在6个月至5年的高等级(AAA)信用债收益率上行10-20bp不等。剩余期限在6个月至3年的中高等级(AA+)和中等级(AA)信用债到期收益率上行10-20bp。剩余期限在5年的中高等级(AA+)和中等级(AA)信用债到期收益率下行1-10bp。信用利差方面,剩余期限在6个月至3年的短融中票上升10-20bp不等;剩余期限在5年的高等级短融中票小幅上升;剩余期限在5年的中高等级和中等级短融中票下降10-20bp。同业存单收益率持续上行。

影响三季度债市走势的因素主要有资金面和国内经济基本面。资金面(以银行间质押式7天回购利率衡量)在7月上中旬,由于之前央行在6月融出的跨季资金,呈现宽松状态。从7月17日开始,由于央行之前逆回购融出陆续到期以及缴税因素,资金面骤然收紧。信用债收益率也结束6月以来的下行,重新打开上行空间。进入8月份央行明显加大了公开市场净回笼的力度,叠加特别国债续作,资金面整个8月基本上都处于紧平衡状态。此外,由于9月份同业存单大量到期,作为应对,部分银行在8月提前发行同存,造成银行间市场整体可动用头寸减少。6000亿特别国债续作完成后,国有大行重新融出,9月上旬,资金面较之前缓和,信用债收益率有所下行。至9月下旬,临近季末,由于MPA考核,银行停止融出跨季资金,非银融资成本一度达到10%的高位。

7月公布的6月和二季度的经济数据全面好于预期。二季度GDP同比增长6.9%,工业增加值同比7.6%,出口同比10.9%,进口同比17%,固定资产投资累计同比8.6%,PPI同比5.5%。6月份经济数据突出的背后有半年末冲业绩的因素。由于经济数据好于预期,10年期国债收益率从7月中旬的3.56%上行至8月上旬的3.65%。随后,在8、9月公布的经济数据中,由于7、8月份高温天气、环保限产、财政支出放缓和地方政府融资受限等因素,工业增加值同比、固定资产投资累计同比等经济数据出现下滑。M2同比增速,因为金融去杠杆导致银行同业资产下降,自5月份9.6%一路下降至8月份8.9%。此外,由于供给侧收缩和二季度经济数据好于预期从而引发经济新周期开启猜测,以螺纹钢为代表的黑色系周期商品价格在7、8月出现明显上涨。而采用宏观对冲策略的商品投资者使用国债期货对冲,造成国债期货价格下跌,带动国债收益率上行。

展望四季度,债市的风险主要来自国内工业品价格上涨,监管、税收、去杠杆政策进展和海外美国缩表、加息带来的潜在冲击。而有利的方面来自国内经济增速自二季度高点趋缓。根据我们对于9月份PPI的推算,9月份PPI同比仍然有望保持在6%以上。冬季取暖必然增加对于煤的需求。再往后看,商品的价格取决于供给侧收缩的力度和节奏,以及美元的走势。资金面预计10月份仍然不乐观。10月份将有8495亿逆回购和MLF到期,并且,10月份还是传统的缴税月份。再往后看,资金面松紧程度取决于央行公开市场操作和定向降准政策实施的效果。政策方面,针对货币基金的流动性新规和18年以后将要实施的增值税新政对债市的潜在影响偏空。而由于地方政府融资受限、财政支出增长幅度下降以及房地产成交下行大概率造成固定资产投资在年内剩余期内走弱。综合上述,我们对于今后一段时间的债市仍然保持谨慎。将采取短久期和适度杠杆的操作策略。

投资运作上,因为本产品属于债券和权益类混合型,我们将在保持一定流动性的前提下,以短久期的信用债和稳健类个股作为底仓,再在其上通过权益类一级市场申购加厚产品收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,中加心享A基金份额净值增长率为0.75%,同期业绩比较基准收益率为1.09%;中加心享C基金基金份额净值增长率为0.78%,同期业绩比较基准收益率为1.09%。

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	99,291,516.81	3.69
	其中:股票	99,291,516.81	3.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,380,506,000.00	88.48
	其中:债券	2,380,506,000.00	88.48
	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	117,164,615.75	4.35
	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	12,869,640.70	0.48
8	其他资产	80,704,652.31	3.00
9	合计	2,690,536,425.57	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,884,287.00	0.20
C	制造业	63,278,183.79	2.65
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	6,744,655.50	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,893,186.00	0.25
J	金融业	18,491,204.52	0.77
K	房地产业	-	-
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	99,291,516.81	4.15

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

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	600309	万华化学	181,560	7,652,754.00	0.32
2	601288	农业银行	2,000,000	7,640,000.00	0.32
3	600428	中远海特	1,006,665	6,744,655.50	0.28
4	000800	一汽轿车	476,389	6,555,112.64	0.27
5	002241	歌尔股份	301,400	6,100,336.00	0.26
6	601857	中国石油	611,300	4,884,287.00	0.20
7	601009	南京银行	573,972	4,540,118.52	0.19
8	002544	杰赛科技	193,000	4,473,740.00	0.19
9	002643	万润股份	334,765	4,281,644.35	0.18
10	601628	中国人寿	146,900	4,075,006.00	0.17

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	521,382,000.00	21.81
	其中:政策性金融债	521,382,000.00	21.81
4	企业债券	133,030,000.00	5.56
5	企业短期融资券	561,710,000.00	23.49
6	中期票据	1,164,384,000.00	48.70
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,380,506,000.00	99.56

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	170210	17国开10	4,200,000	411,558,000.00	17.21
2	011761035	17东方园林SCP001	1,000,000	100,650,000.00	4.21
3	101573020	15马钢MTN001	1,000,000	100,330,000.00	4.20
4	011764062	17晋能SCP007	1,000,000	100,080,000.00	4.19
5	101654074	16京煤MTN001	1,000,000	95,840,000.00	4.01

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

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

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

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 本基金本报告期内投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,894.84
2	应收证券清算款	32,267,989.85
3	应收股利	-
4	应收利息	48,379,667.62
5	应收申购款	20,100.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	80,704,652.31

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

	中加心享A	中加心享C
报告期期初基金份额总额	2,250,612,719.65	573,576.57
报告期期间基金总申购份额	3,685.12	750,032.15
减:报告期期间基金总赎回份额	2,026,886.10	526,879.10
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	2,248,589,518.67	796,729.62

§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	976,880,667.76	0.00	0.00	976,880,667.76	43.43
	2	20170701-20170930	598,641,900.00	0.00	50,000.00	598,591,900.00	26.61
	3	20170701-20170930	664,018,540.00	0.00	41,000.00	663,977,540.00	29.52
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享灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中加心享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

二〇一七年十月二十六日

中加心安保本混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

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、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的法律责任。

基金托管人中国建设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、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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	中加心安保本混合
基金主代码	002440
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年03月23日
报告期末基金份额总额	467,992,795.24份
投资目标	本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上,通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)原理,动态调整稳健资产与风险资产的投资比例,以确保本基金在保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。具体而言,本基金的投资策略包括资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	二年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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	529,003.84
2.本期利润	4,133,567.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087
4.期末基金资产净值	481,098,582.64
5.期末基金份额净值	1.0280

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。

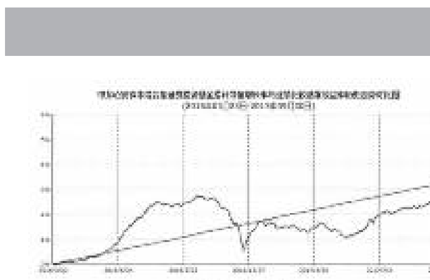
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.85%	0.03%	0.52%	0.00%	0.33%	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.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	2016-03-23	-	9	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)。
张旭	本基金基金经理	2016-03-23	-	9	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,任年金和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)。

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,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

本报告期内,中加心安保本基金资产净值为481,098,582.64元,本报告期内基金份额净值增长率为0.85%,同期业绩比较基准收益率为0.52%。

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	22,619,909.24	3.75
	其中:股票	22,619,909.24	3.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	552,481,100.00	91.69
	其中:债券	552,481,100.00	91.69
	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	3,464,818.18	0.58
8	其他资产	23,973,171.53	3.98
9	合计	602,538,998.95	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,325,057.24	2.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,746,871.00	0.36
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,061,590.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,421,796.00	0.30
J	金融业	5,688,200.00	1.18
K	房地产业	-	-
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	376,395.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	22,619,909.24	4.70

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

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	601288	农业银行	1,315,700	5,025,974.00	1.04
2	600089	特变电工	374,725	3,694,788.50	0.77
3	002643	万润股份	186,126	2,380,551.54	0.49
4	600428	中远海特	307,700	2,061,590.00	0.43
5	601800	中国交建	114,100	1,746,871.00	0.36
6	000800	一汽轿车	117,500	1,616,800.00	0.34
7	002555	三七互娱	43,800	976,740.00	0.20
8	000976	华铁股份	84,900	789,570.00	0.16
9	000030	富奥股份	53,500	470,800.00	0.10
10	603111	康尼机电	31,300	464,492.00	0.10

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例可能有尾差。

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	35,950,400.00	7.47
	其中:政策性金融债	25,962,400.00	5.40
4	企业债券	94,230,700.00	19.59
5	企业短期融资券	290,798,000.00	60.44
6	中期票据	131,502,000.00	27.33
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	552,481,100.00	114.84

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例可能有尾差。

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	124532	14甘公01	400,000	41,956,000.00	8.72
2	1282421	12湘高速MTN2	400,000	40,512,000.00	8.42
3	011751030	17供销SCP001	400,000	40,152,000.00	8.35
4	011758062	17大同煤矿SCP004	400,000	40,148,000.00	8.35
5	041760011	17京技投CP001	400,000	40,124,000.00	8.34

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 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 本基金本报告期内投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,671.41
2	应收证券清算款	12,085,535.21
3	应收股利	-
4	应收利息	11,879,964.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,973,171.53

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603111	康尼机电	464,492.00	0.10	-

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	486,695,187.38
报告期期间基金总申购份额	24,930.52
减:报告期期间基金总赎回份额	18,727,322.66
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	467,992,795.24

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	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	21.37
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安保本混合型证券投资基金设立的文件

2、《中加心安保本混合型证券投资基金基金合同》

3、《中加心安保本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:北京市西城区金融大街25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

中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金

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	中加改革红利
基金主代码	001537
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月13日
报告期末基金份额总额	185,049,874.19份
投资目标	在深入研究的基础上,运用"价值+主题"的投资方法,发现并精选能够分享中国改革红利的上市公司构建投资组合。在充分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,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。在深入研究的基础上,运用"价值+主题"的投资方法,发现并精选能够分享中国改革红利的上市公司构建投资组合。在充分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	60%*沪深300指数收益率+40%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§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	3,644,663.14
2.本期利润	4,502,304.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0244
4.期末基金资产净值	201,056,439.52
5.期末基金份额净值	1.0865

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	2.27%	0.46%	3.04%	0.35%	-0.77%	0.11%

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:按基金合同规定,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		
张旭	本基金基金经理	2015-08-13	-	9	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,任年金和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)。

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。

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年第三季度,宏观经济前低后高,整体平稳;流动性继续维持紧平衡状态,未来需着重观察十九大之后的政策红利释放情况。

在此宏观背景下,本季度A股市场呈震荡上行趋势,全季度上证指数累计涨幅4.9%,板块上在前期蓝筹白马走势强劲基础上热点继续扩散。本产品本着稳健投资原则,在本季度大部分时间保持中性略偏高,对估值较低业绩增长稳定的防御类股票继续持有,并在此基础上对进攻性品种进行了一定加仓,希望在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,中加改革红利混合净值增长率2.27%,同期业绩比较基准收益率3.04%。

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	103,747,619.42	50.04
	其中:股票	103,747,619.42	50.04
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	103,453,135.66	49.90
8	其他资产	140,146.58	0.07
9	合计	207,340,901.66	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,549,024.60	27.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,627,741.17	5.29
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,569,167.30	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,293,690.76	5.12
J	金融业	11,834,285.54	5.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,384,050.00	2.68
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	5,489,660.05	2.73
S	综合	-	-
	合计	103,747,619.42	51.60

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	600089	特变电工	778,238	7,673,426.68	3.82
2	601800	中国交建	387,357	5,930,435.67	2.95
3	002544	杰赛科技	251,242	5,823,789.56	2.90
4	600428	中远海特	831,219	5,569,167.30	2.77
5	601009	南京银行	663,494	5,248,237.54	2.61
6	002643	万润股份	395,500	5,058,445.00	2.52
7	000800	一汽轿车	343,000	4,719,680.00	2.35
8	000895	双汇发展	183,800	4,576,620.00	2.28
9	002555	三七互娱	200,444	4,469,901.20	2.22
10	000100	TCL集团	1,233,400	4,390,904.00	2.18

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

本报告期末,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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 本基金本报告期内投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	50,078.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,231.37
5	应收申购款	69,836.59
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	140,146.58

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	178,911,614.32
报告期期间基金总申购份额	11,623,272.11
减:报告期期间基金总赎回份额	5,485,012.24
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	185,049,874.19

注:总申购份额含红利再投、转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	50,000,000.00
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	50,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	27.02

§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	50,000,000.00	0.00	0.00	50,000,000.00	27.02
	2	20170701-20170930	50,000,000.00	0.00	0.00	50,000,000.00	27.02
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改革红利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2、《中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、《中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

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

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅,或登录基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人-中加基金管理有限公司客户服务中心电话:400-00-95526。

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