中加纯债分级债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

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04月21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。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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20145年1月1□日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加纯债分级
基金主代码	000914
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月17日
报告期末基金份额总额	573,190,955.07份
投资目标	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,力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。分级运作终止转换为不分级的开放式债券型基金后,将更加注重组合的流动性,将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和应用债券类属配置、动态调整组合久期和应用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。主要投资策略包括:期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中的投资策略及资产支持证券等品种投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合资产的增值。
业绩比较基准	中证金债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,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。 本基金经过基金份额分级后,纯债A具有低风险、收益相对稳定的特征;纯债B具有较高预期风险、较高预期收益的特征。
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
下属分级基金的基金简称	中加纯债分级A / 中加纯债分级B
下属分级基金的交易代码	000914 / 000915
报告期末下属分级基金的份额总额	401,235,526.54份 / 171,955,428.53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

基金简称	报告期(2015年01月01日-2015年03月31日)
1.本期已实现收益	6,287,915.90
2.本期利润	5,765,776.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101
4.期末基金资产净值	580,401,814.36
5.期末基金份额净值	1.0126

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。

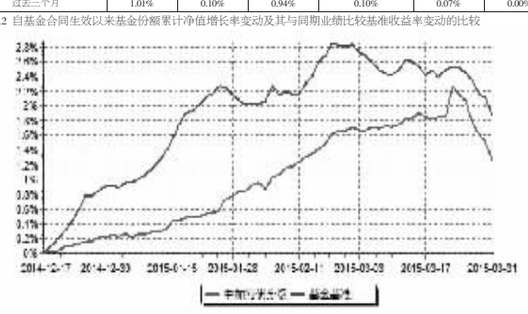
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.01%	0.10%	0.94%	0.10%	0.07%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2014年12月17日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,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		
闫沛贤	本基金基金经理	2014年12月17日		6	闫沛贤,帝国理工大学金融学硕士。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,现任投资总监助理、固定收益部主管、中加货币基金基金经理(2013年10月至今)、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)、中加纯债分级基金基金经理(2014年12月17日至今)。

注: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,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年1季度,债市收益率走出了V型走势,市场波动性显著增强。1月份,经济增速不断放缓,通缩风险有所上升,市场期待进一步的宽松货币政策出台,债券市场收益率有所下行;进入二、三月份,一方面,央行降准降息,宽松政策的预期接连兑现,部分机构采取止盈策略;另一方面,地产行业刺激政策进一步出台,稳增长措施发力,市场对宏观经济基本面判断的分歧加大。此外,对于新增地方政府债务的供给问题引来市场的担忧,再加上股市分流资金,导致债市大幅回调,收益率经历了市场的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,中加纯债分级净值增长率1.01%,业绩比较基准收益率0.94%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	801,849,071.50	97.53
	其中:债券	801,849,071.50	97.53
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,314,317.53	0.28
7	其他各项资产	17,955,414.10	2.18
8	合计	822,118,803.13	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(指数投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资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。

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,556,000.00	6.64
	其中:政策性金融债	38,556,000.00	6.64
4	企业债券	480,821,071.50	82.84
5	企业短期融资券	131,107,000.00	22.59
6	中期票据	151,365,000.00	26.08
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	801,849,071.50	138.15

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名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1280134	12句容福地债	500,000	53,950,000.00	9.30
2	101469015	14津航空 MTN002	500,000	51,225,000.00	8.83
3	101554002	15万达 MTN001	500,000	50,465,000.00	8.69
4	041460055	14渝供销 CP001	500,000	50,455,000.00	8.69
5	1580002	15潭万楼债	500,000	50,165,000.00	8.64

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名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交易情况说明

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

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名债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 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,955,414.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,955,414.10

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

5.11.5.1 期末指数投资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。

5.11.5.2 期末积极投资前五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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中加纯债分级A	中加纯债分级B
本报告期期初基金份额总额	401,235,526.54	171,955,428.53
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	401,235,526.54	171,955,428.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注: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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金设立的文件

《中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》

《中加纯债一年定期开放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

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市丰台区南四环西路188号17区15号12层

基金托管人地址:广东省广州市天河区珠江新城华夏路1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
二〇一五年四月二十一日

信达澳银中小盘股票型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银中小盘股票
场内简称	-
基金主代码	610004
交易代码	610004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月1日
报告期末基金份额总额	201,663,373.98份
投资目标	通过投资具有高成长性的中小盘股票,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行"自下而上"和"自上而下"相结合的投资方法。一方面,本基金通过"自下而上"的深入分析,选择素质高、竞争力突出的优秀公司,依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力,力争获得超越行业平均水平的良好回报;另一方面,本基金依靠"自上而下"的策略分析和运作,通过优化大类资产配置来有效控制系统风险,并力争把握行业轮动等方面的投资机会。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,长期预期风险与收益高于混合基金、债券基金、货币市场基金,属于预期风险收益水平较高的证券投资基金产品。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	36,053,854.76
2.本期利润	41,991,967.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.1676
4.期末基金资产净值	264,782,646.96
5.期末基金份额净值	1.313

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

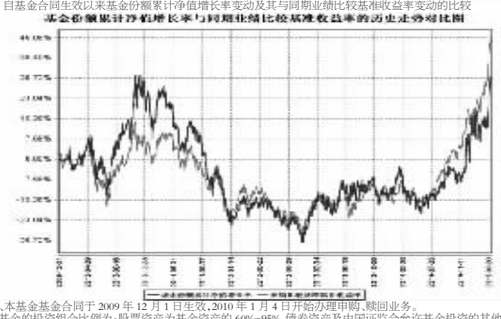
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	16.50%	2.10%	24.95%	1.15%	-8.45%	0.95%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2009年12月1日生效,2010年1月4日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:股票资产为基金资产的60%-95%,债券资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,权证占基金资产净值的0%-3%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,投资于中小盘股票的资产比例不低于股票资产的80%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3、本基金基金管理人根据《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,经与基金托管人中国建设银行协商一致,并报中国证监会备案后,自2012年5月1日起,本基金的业绩比较基准由"(天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×60%)×80%+中国债券总指数收益率×20%"变更为"中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%"。

§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		
巩伟	本基金基金经理	2013年12月26日	-	7年	北京大学工程学硕士。2008年08月加入信达澳银基金,历任投资研究部研究员、信达澳银领先增长股票基金基金经理助理(2012年1月31日至今)、信达澳银中小盘股票基金基金经理(2013年12月26日起至今)。

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、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》的相关规定等。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年一季度,经济面依然乏善可陈,市场结束了去年四季度那种金融地产板块单边上涨的行情,重回以创业板为主的小票时代,各种题材与重组股异彩纷呈。一季度沪深300指数上涨15.87%,创业板指数上涨58.67%。

在一季度初,我们延续了去年四季度的配置,地产股偏多,后面陆续增加了生物医疗以及互联网板块的配置,逐步实现组合的均衡化。

展望未来,尽管宏观数据依然不好看,但经济的一些先行指标已经出现回暖迹象,我们认为二季度市场将会出现分化,但震荡上行的趋势不会改变。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.313元,份额累计净值为1.313元,报告期内份额净值增长率为16.50%,同期业绩比较基准收益率为24.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	249,930,706.87	81.23
	其中:股票	249,930,706.87	81.23
2	固定收益投资	26,405,958.80	8.58
	其中:债券	26,405,958.80	8.58
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,418,291.49	5.01
7	其他资产	15,935,627.45	5.18
8	合计	307,690,584.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	128,929,253.87	48.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,219,078.56	3.10
E	建筑业	37,345,696.63	14.10
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	20,799,243.60	7.86
J	金融业	16,525,118.52	6.24
K	房地产业	29,674,683.79	11.21
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	8,437,631.90	3.19
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	249,930,706.87	94.39

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	300210	森远股份	771,892	16,225,169.84	6.13
2	002612	朗姿股份	364,686	14,882,835.66	5.62
3	601886	江河创建	1,269,716	14,500,156.72	5.48
4	000056	深国商	719,739	14,214,845.25	5.37
5	002230	科大讯飞	244,145	12,695,540.00	4.79
6	002236	大华股份	324,106	11,846,074.30	4.47
7	002681	奋达科技	227,172	11,778,868.20	4.45
8	300217	东方电热	745,500	10,340,085.00	3.91
9	000540	中天城投	267,003	9,553,367.34	3.61
10	300171	东富龙	231,492	9,537,470.40	3.60

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	26,405,958.80	9.97
	其中:政策性金融债	26,405,958.80	9.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	26,405,958.80	9.97

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	018001	国开1301	257,770	26,405,958.80	9.97

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注: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

注:本基金未参与投资国债期货。

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报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	620,673.13
2	应收证券清算款	14,692,963.18
3	应收股利	-
4	应收利息	365,171.30
5	应收申购款	256,819.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,935,627.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002612	朗姿股份	14,882,835.66	5.62	重大事项停牌

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,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	277,498,295.28
报告期期间基金总申购份额	18,836,746.88
减:报告期期间基金总赎回份额	94,671,668.18
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	201,663,373.98

§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

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注: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

本基金管理人于2015年3月27日发布公告,自2015年3月26日起对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银中小盘股票型证券投资基金托管协议》;

4、法律意见书;

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、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2015年04月22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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月15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2015年01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加纯债一年
基金主代码	000552
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年03月24日
报告期末基金份额总额	798,241,806.51份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的主要投资策略包括:期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中的投资策略及资产支持证券等品种投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合资产的增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.3%
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水平高于货币市场基金,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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	中加纯债一年A / 中加纯债一年C
下属两级基金的交易代码	000552 / 000553
报告期末下属分级基金的份额总额	628,025,913.76份 / 170,215,892.75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(2015年01月01日-2015年03月31日)	
	中加纯债一年A	中加纯债一年C
1.本期已实现收益	3,959,929.06	1,661,421.46
2.本期利润	7,776,774.06	3,672,593.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0332	0.0353
4.期末基金资产净值	662,359,863.18	178,770,399.05
5.期末基金份额净值	1.055	1.050

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

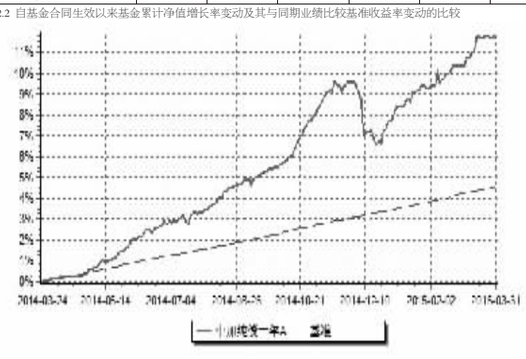
中加纯债一年A

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	3.61%	0.17%	1.00%	0.01%	2.61%	0.16%

中加纯债一年C

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	3.44%	0.17%	1.00%	0.01%	2.44%	0.16%

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



§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		
闫沛贤	本基金基金经理	2014年03月24日		6	闫沛贤,帝国理工大学金融学硕士。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,现任投资研究部总监助理、固定收益部主管、中加货币基金基金经理(2013年10月至今)、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)、中加纯债分级基金基金经理(2014年12月17日至今)。

4.2 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《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