

# 中加心享灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

2016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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016年08月25日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2016年8月15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2016年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 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.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 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贵金属投资明细.....	49
7.9 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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 基金改聘会计师事务所情况.....	52

---

10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	52
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8	其他重大事件.....	53
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12	备查文件目录.....	54
12.1	备查文件目录.....	54
12.2	存放地点.....	55
12.3	查阅方式.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中加心享灵活配置混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	2,217,424,719.84	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	中加心享混合A	中加心享混合C
下属两级基金的交易代码	002027	002533
报告期末下属两级基金的份 额总额	2,217,380,559.40	44,160.44

### 2.2 基金产品说明

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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中加基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘向途	张建春
	联系电话	400-00-95526	010-63639180
	电子邮箱	service@bobbs.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-00-95526	95595
传真		010-66226080	010-63639132
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317号	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市西城区南纬路35号	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100050	100033
法定代表人		闫冰竹	唐双宁

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bobbs.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）	
3.1.1 期间数据和指标	中加心享混合A	中加心享混合C
本期已实现收益	37,695,095.93	306.21
本期利润	26,342,268.84	-66.09
加权平均基金份额本期利润	0.0098	-0.0018
本期基金加权平均净值利润率	0.97%	-0.18%
本期基金份额净值增长率	1.01%	-0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	25,485,042.92	-120.52
期末可供分配基金份额利润	0.0115	-0.0027
期末基金资产净值	2,242,865,602.32	44,039.92
期末基金份额净值	1.0115	0.9973
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.15%	-0.27%

注：1) 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。

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) 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4) 本基金合同于2015年12月2日生效，截止至2016年6月30日不满一年。

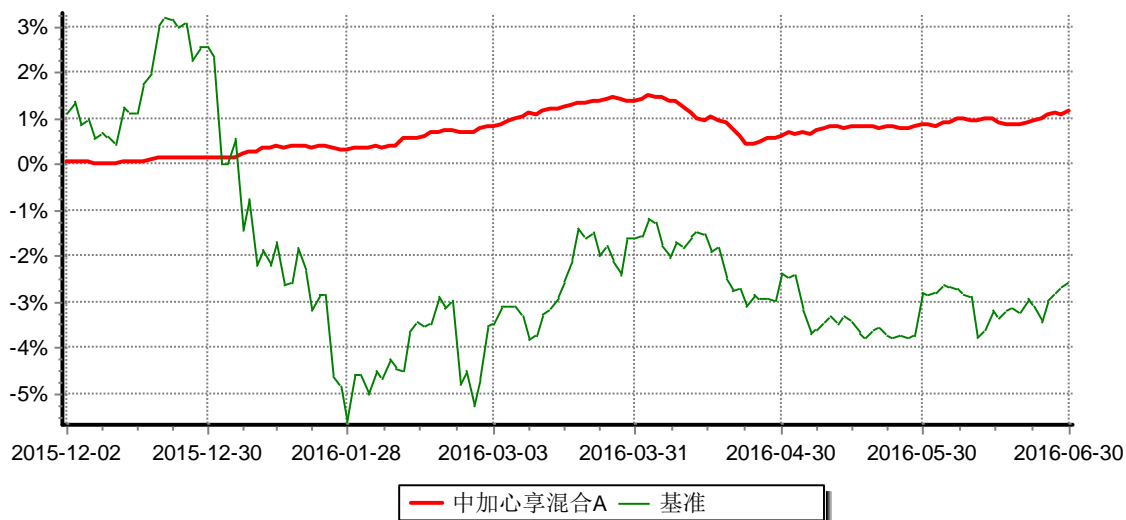
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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 (中加心享混合A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.31%	0.04%	0.18%	0.31%	0.13%	-0.27%
过去三个月	-0.22%	0.06%	-1.03%	0.32%	0.81%	-0.26%
过去六个月	1.01%	0.05%	-4.79%	0.56%	5.80%	-0.51%
自基金合同生效日起	1.15%	0.05%	-3.66%	0.55%	4.81%	-0.50%

阶段 (中加心享混合C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
至今(2015年12月02日-2016年06月30日)						
过去一个月	0.30%	0.04%	0.18%	0.31%	0.12%	-0.27%
过去三个月	-0.25%	0.06%	-1.03%	0.32%	0.78%	-0.26%
自基金合同生效日起至今(2016年03月30日-2016年06月30日)	-0.27%	0.06%	-0.18%	0.33%	-0.09%	-0.27%

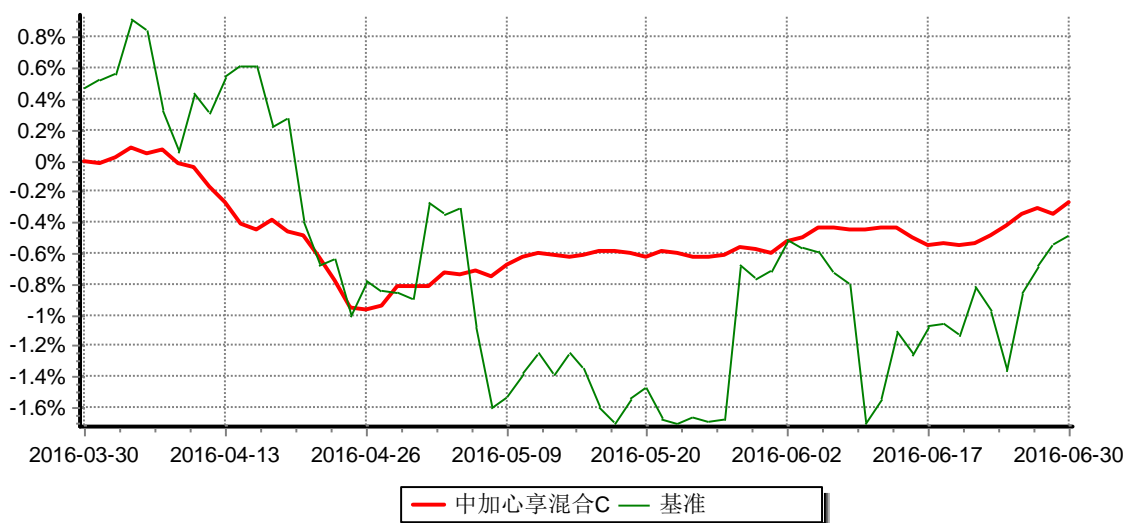
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.本基金基金合同于2015年12月2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。





注：中加心享混合C净值增长率表现期间为2016年3月29日(基金合同修改生效日)至2016年6月30日。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系试点中首家获批的公司，注册资本为3亿元人民币，注册地为北京，股东分别为北京银行股份有限公司、加拿大丰业银行、北京有色金属研究总院，持股比例分别为62%、33%、5%。

报告期内，本公司共管理七只基金，分别为中加货币市场基金(基金代码：A类000331，C类000332)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金(基金代码：A类：000552，C类：000553)、中加纯债分级债券型证券投资基金(基金代码：A类000914，B类000915)、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001537)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：A类002027，C类002533)、中加心安保本混合型证券投资基金(基金代码：002440)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(基金代码：A类002881，C类002882)。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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年12月02日	—	8	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

					<p>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、中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中加心安保本混合型证券投资基金基金经理。</p>
闫沛贤	<p>本基金基金经理、投资研究部副总监兼固定收益部总监</p>	<p>2015年12月28日</p>	—	8	<p>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）、中加纯债分级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）。</p>

注：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，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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖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。本报告期，本基金的基金管理人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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经历了2014、2015年两年的牛市后，2016年上半年，债市从趋势行情走向波折，1月债市在需求大于供给的作用下延续上涨，10年国开一度触及3%，但随后信贷高增和央行货币不再大幅宽松的影响下，收益率缓慢上行；4月后，由于营改增、信用违约频发，市场出现调整，特别是基金遭遇赎回，造成利率债和信用债齐跌。5月营改增补丁出台，城投提前偿还取消、铁物资风波得到后续处理，债市恐慌情绪才有所缓解，利率债收益率也较此前小幅下行。6月初，10年国开债利率仍在3.3-3.4%左右震荡，10年国债

利率也回到3%以上，6月中下旬，市场对于基本面的预期进一步走弱，同时英国公投退欧的结果超出市场预期，全球避险情绪快速升温，避险资产大幅走强，这种情绪也蔓延到了国内，利率债收益率于6月下旬大幅走低，其中中长端品种利率降幅更大，收益率曲线呈现平坦化下行。由于信用事件的频发，高等级信用债走势跟随利率债，市场防踩雷的谨慎态度令低评级品种信用利差呈现高位震荡走势。

上半年资金面虽出现一定的波动，但整体较为平稳。春节前后，央行均通过公开市场及SLO\SLF等工具向市场投放巨量资金，以缓解紧张的资金面，7天回购加权利率始终稳定在2.5%以下。三月初降准0.5%，释放资金7000亿左右，但全月公开市场大规模净回笼1.025万亿元，三月较高的信贷投放带来准备金的上缴也较高，以及外汇占款的继续流出，整体资金供给维持偏紧状态。在资金供应有限的情况下，三月下旬面临季末压力和MPA初次考核更是加剧了结构性的非银机构的资金紧张状况，回购利率在季末陡升。进入6月份，MPA考核导致阶段性的资金面承压。此外，转债打新、新债缴款等因素也带来了新增的资金需求，增加了流动性层面的压力。央行全月通过逆回购、MLF、国库现金定存等实现净投放5350亿，并且主要集中在资金需求较高的后两周。对比3月末资金利率的大幅上行，本次资金价格并未出现大幅飙升，市场反映出虽然承受压力，但基本可控的局面。

报告期内，组合结合市场的波动特点，并通过对资金面进行阶段性判断，适时调整杠杆水平和久期，并通过自上而下及自下而上相结合的方法，在整体市场趋势判断的基础上，严格甄别个券的估值和信用风险，博取杠杆和价差收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，中加心享A基金份额资产净值为1.0115元，本报告期基金份额净值增长率为1.01%；中加心享C基金份额资产净值为0.9973元，本报告期基金份额净值增长率为-0.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从公布的6月份经济金融数据来看，6月经济数据总体与预期有差异，工业和消费好于预期，固定资产投资差于预期，且结构上，仍靠政府基建托底经济，但制造业、民间投资、房地产开发投资仍在恶化。从信贷结构来看，也仍以居民房贷为主，实体的融资需求仍较弱。趋势上，经济的内生动力不强，高杠杆和债务压力倒逼利率保持低位，信用风险仍处于上升期，决定无风险利率下行的趋势并未逆转。

整体来看，尽管央行呵护下，流动性无忧，但需求疲弱以及稳增长诉求下，货币政策放松的压力仍在。当前短端利率受制于公开市场操作利率2.25%的制约难以下行，上半年货币政策维持稳健没有进行主动引导宽松，但后期随着通胀压力的进一步下行，以公开市场操作利率衡量的政策利率水平有进一步下行的空间。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司总经理任估值小组负责人，成员由投资研究部门负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成，主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司督察长任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员，主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理不参与决定本基金估值的程序。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国光大银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运

作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人--中加基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人--中加基金管理有限公司编制的"中加心享灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告"进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中加心享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,129.33	2,752,181,871.28
结算备付金			—
存出保证金		44,375.83	—
交易性金融资产	6.4.7.2	3,057,444,635.00	26,903,967.81
其中：股票投资		20,283,635.00	26,903,967.81
基金投资		—	—
债券投资		3,037,161,000.00	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—

应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	55,507,182.51	559,291.00
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		3,113,004,322.67	2,779,645,130.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年06月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		867,242,179.12	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		49,941.72	—
应付管理人报酬		1,111,943.33	2,204,825.07
应付托管费		370,647.79	440,965.01
应付销售服务费		3.46	—
应付交易费用	6.4.7.6	150,749.56	86,181.87
应交税费		—	—
应付利息		892,713.65	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.7	276,501.80	800.00
负债合计		870,094,680.43	2,732,771.95
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.8	2,217,424,719.84	2,772,993,297.72
未分配利润	6.4.7.9	25,484,922.40	3,919,060.42
所有者权益合计		2,242,909,642.24	2,776,912,358.14
负债和所有者权益总计		3,113,004,322.67	2,779,645,130.09

注：报告截止2016年6月30日，中加心享A基金份额净值1.0115元,基金份额2,253,387,520.24份;中加心享C基金份额净值0.9973元，基金份额44,412.22份。

## 6.2 利润表

会计主体：中加心享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间2015 年01月01日-2015年06 月30日
一、收入		48,002,589.40	—
1.利息收入		59,644,087.48	—
其中：存款利息收入	6.4.7 .10	2,269,578.45	—
债券利息收入		55,480,497.46	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		1,894,011.57	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益		-316,750.45	—
其中：股票投资收益	6.4.7 .11	491,340.29	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .12	-851,049.24	—
资产支持证券投资收益	6.4.7 .12.3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7 .13	—	—
衍生工具收益	6.4.7 .14	—	—
股利收益	6.4.7 .15	42,958.50	—



3.公允价值变动收益	6.4.7 .16	-11,353,199.39	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7 .17	28,451.76	—
<b>减：二、费用</b>		21,660,386.65	—
1. 管理人报酬		10,749,225.80	—
2. 托管费		2,688,459.59	—
3. 销售服务费		9.35	—
4. 交易费用	6.4.7 .18	60,066.37	—
5. 利息支出		7,814,223.74	—
其中：卖出回购金融资产支出		7,814,223.74	—
6. 其他费用	6.4.7 .19	348,401.80	—
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		26,342,202.75	—
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		26,342,202.75	—

注：本基金基金合同于2015年12月2日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中加心享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,772,993,297.72	3,919,060.42	2,776,912,358.14
二、本期经营活动产生的基金	—	26,342,202.75	26,342,202.75

净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-555,568,577.88	-4,776,340.77	-560,344,918.65
其中：1.基金申购款	297,736.91	2,987.74	300,724.65
2.基金赎回款	-555,866,314.79	-4,779,328.51	-560,645,643.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	2,217,424,719.84	25,484,922.40	2,242,909,642.24
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	—	—	—
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	—	—
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	—	—	—

注：本基金基金合同于2015年12月2日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

夏英

陈昕

陈昕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中加心享灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）经证监许可[2015]1598号《关于核准中加心享灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由中加基金管理有限公司（以下简称“中加基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金，托管人为中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）。

本基金通过中加基金直销中心、北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”等）代销网点公开发售，募集期为2015年11月23日至2015年12月08日。本基金于2015年12月2日成立，成立之日基金实收份额为2772993297.72份（含利息转份额人民币48368.47元），发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月1日至2016年6月30日期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金期间财务状况、经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核

算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确

认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金

在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

## 1、股票投资

### 1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

### 2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

### C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票股票的初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

## 2、债券投资

1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生

重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3、其他

1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(6)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以



下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），本基金对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所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）采用第三方估值机构提供的价格进行估值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更事项。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更事项。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2016年06月30日
活期存款	8,129.33
定期存款	—
其中:存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	8,129.33

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末2016年06月30日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	21,957,285.74	20,283,635.00	-1,673,650.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	3,046,009,639.48	3,037,161,000.00	-8,848,639.48
	合计	3,046,009,639.48	3,037,161,000.00	-8,848,639.48

资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	3,067,966,925.22	3,057,444,635.00	-10,522,290.22

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2016年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
权益衍生工具	—	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	—	—	

注：本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金报告期末买入返售金融资产期末余额为零。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2016年06月30日
应收活期存款利息	511.44
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	20.00
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	55,506,651.07
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—

其他	—
合计	55,507,182.51

#### 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
交易所市场应付交易费用	107,282.86
银行间市场应付交易费用	43,466.70
合计	150,749.56

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	259,031.72
其他应付	17,470.08
合计	276,501.80

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中加心享混合A)	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,772,993,297.72	2,772,993,297.72
本期申购	251,567.23	251,567.23
本期赎回	-555,864,305.55	-555,864,305.55
期末数	2,217,380,559.40	2,217,380,559.40
项目 (中加心享混合C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	—	—

本期申购	46,169.68	46,169.68
本期赎回	-2,009.24	-2,009.24
期末数	44,160.44	44,160.44

注：份额减少以“-”号填列。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目 (中加心享混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,088,151.25	830,909.17	3,919,060.42
本期利润	37,695,095.93	-11,352,827.09	26,342,268.84
本期基金份额交易产生的变动数	-7,053,501.15	2,277,214.81	-4,776,286.34
其中：基金申购款	1,942.36	1,112.07	3,054.43
基金赎回款	-7,055,443.51	2,276,102.74	-4,779,340.77
本期已分配利润	—	—	—
本期末	33,729,746.03	-8,244,703.11	25,485,042.92

单位：人民币元

项目 (中加心享混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	306.21	-372.30	-66.09
本期基金份额交易产生的变动数	45.13	-99.56	-54.43
其中：基金申购款	55.71	-122.40	-66.69
基金赎回款	-10.58	22.84	12.26
本期已分配利润	—	—	—
本期末	351.34	-471.86	-120.52

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
活期存款利息收入	37,547.99
定期存款利息收入	1,984,261.11
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	247,440.02
其他	329.33
合计	2,269,578.45

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
卖出股票成交总额	13,632,325.19
减：卖出股票成本总额	13,140,984.90
买卖股票差价收入	491,340.29

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-851,049.24
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—

合计	-851,049.24
----	-------------

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,321,047,515.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,295,523,141.73
减：应收利息总额	26,375,423.10
买卖债券差价收入	-851,049.24

**6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益** 本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

**6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本报告期内本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
股票投资产生的股利收益	42,958.50
基金投资产生的股利收益	—
合计	42,958.50

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
------	-------------------------------

1.交易性金融资产	-11,353,199.39
——股票投资	-2,504,559.91
——债券投资	-8,848,639.48
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-11,353,199.39

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
基金赎回费收入	28,451.76
合计	28,451.76

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
交易所市场交易费用	36,743.37
银行间市场交易费用	23,323.00
合计	60,066.37

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	198,904.16
公证费	12,000.00



律师费	53,000.00
汇划手续费	16,670.08
上清所账户维护费	9,150.76
中债登账户维护费	8,950.76
合计	348,401.80

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015 年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	10,749,225.80	—
其中：支付销售机构的客户维护费	13,860.20	—

注：支付基金管理人中加基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一基金资产净值×0.6%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日-2016年06月30日	2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,688,459.59	—

注：支付基金托管人中国光大银行的托管人报酬按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一基金资产净值×0.2%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加心享混合A	中加心享混合C	合计
中加基金管理有限公司	—	0.83	0.83
北京银行股份有限公司	—	8.77	8.77
中国光大银行股份有限公司	—	—	—
合计	—	9.6	9.6
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加心享混合A	中加心享混合C	合计
当期发生的基金应支			

付的销售服务费			
---------	--	--	--

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费。C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日纯债C类基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法下:

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金的管理人于本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月 30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月 30日	
	中加心享混合 A	中加心享混 合C	中加心享混合 A	中加心享混 合C
	期初持有的基金份额	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减:期间赎回/卖出总 份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	—
占基金总份额比例	—	—	—	—

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。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称		本期末 2016年06月30日		上年度末 2015年12月31日	
		持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
中加 心享 混合 A	北京银行股份 有限公司	500,009,900.00	22.55%		—

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30 日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行 活期存款	8,129.33	37,547.99	—	—

注：本基金的银行存款由基金托管行中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与各关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等而流通受限的股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011599795	15包钢集SCP006	2016-07-04	100.30	700,000	70,210,000.00
011599795	15包钢集SCP006	2016-07-04	100.30	100,000	10,030,000.00
011599873	15鲁晨鸣SCP006	2016-07-05	100.49	1,000,000	100,490,000.00
011599988	15均瑶SCP001	2016-07-01	100.57	80,000	8,045,600.00
011699060	16奇瑞SCP001	2016-07-05	100.07	245,000	24,517,150.00
011699060	16奇瑞SCP001	2016-07-04	100.07	1,620,000	162,113,400.00
011699183	16晋能SCP002	2016-07-01	100.18	23,000	2,304,140.00
101480004	14鞍山城建MTN003	2016-07-05	104.48	215,000	22,463,200.00
101551110	15武钢	2016-07-01	100.49	2,200,000	221,078,000.00

	MTN00 2				
101578005	15京首 钢 MTN00 1	2016-07-01	100.88	1,000,000	100,880,000.00
101656014	16鞍钢 MTN00 1	2016-07-01	98.97	43,000	4,255,710.00
101662019	16比亚 迪 MTN00 2	2016-07-05	101.19	400,000	40,476,000.00
150416	15农发 16	2016-07-04	100.00	500,000	50,000,000.00
150419	15农发 19	2016-07-04	100.02	400,000	40,008,000.00
150419	15农发 19	2016-07-01	100.02	500,000	50,010,000.00
合计			—	9,026,000	906,881,200.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统

组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行股份有限公司和信用风险较低的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金投资于信用类产品以及投资于资产支持证券的信用级别评级应为BBB以上（含BBB），在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年06月30日
A-1	320,602,000.00
A-1以下	—
未评级	1,382,781,000.00
合计	1,703,383,000.00

注：根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间定期报告债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。每一个信用等级均不进行微调。

**6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年06月30日
AAA	1,030,052,000.00
AAA以下	153,706,000.00
未评级	150,020,000.00
合计	1,333,778,000.00

注：根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间定期报告债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，银行间债券市场长期债券信用等级划分为三等九级，符号表示为：AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC、C。除AAA级、CCC级以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级，但不包括AAA+。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金是混合型证券投资基金，属于证券市场中的较高风险品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。

于2016年06月30日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。



于2016年06月30日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值所有者权益（）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,129.33	—	—	—	8,129.33
存出保证金	44,375.83	—	—	—	44,375.83
交易性金融资产	1,853,403,000.00	1,131,518,000.00	52,240,000.00	20,283,635.00	3,057,444,635.00
应收利息	—	—	—	55,507,182.51	55,507,182.51
资产总计	1,853,455,505.16	1,131,518,000.00	52,240,000.00	75,790,817.51	3,113,004,322.67
负债					
卖出回购金融资产款	867,242,179.12	—	—	—	867,242,179.12
应付赎回款	—	—	—	49,941.72	49,941.72
应付管理人报酬	—	—	—	1,111,943.33	1,111,943.33
应付托管费	—	—	—	370,647.79	370,647.79

应付销售服务费	—	—	—	3.46	3.46
应付交易费用	—	—	—	150,749.56	150,749.56
应付利息	—	—	—	892,713.65	892,713.65
其他负债	—	—	—	276,501.80	276,501.80
负债总计	867,242,179.12	—	—	2,852,501.31	870,094,680.43
利率敏感度缺口	986,213,326.04	1,131,518,000.00	52,240,000.00	72,938,316.20	2,242,909,642.24
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,752,181,871.28	—	—	—	2,752,181,871.28
交易性金融资产	—	—	—	26,903,967.81	26,903,967.81
应收利息	—	—	—	559,291.00	559,291.00
资产总计	2,752,181,871.28	—	—	27,463,258.81	2,779,645,130.09
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	2,204,825.07	2,204,825.07
应付托管费	—	—	—	440,965.01	440,965.01
应付交易费用	—	—	—	86,181.87	86,181.87
其他负债	—	—	—	800.00	800.00
负债总计	—	—	—	2,732,771.95	2,732,771.95
利率敏感度缺口	2,752,181,871.28	—	—	24,730,486.86	2,776,912,358.14

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的
----	-----------	----------------

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率下降25个基点	9,577,031.3600	—
	市场利率上升25个基点	-9,577,031.3600	—

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	20,283,635.00	0.90	26,903,967.81	0.97
交易性金融资产-债券投资	3,037,161,000.00	135.41	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	3,057,444,635.0 0	136.32	26,903,967.81	0.97
----	----------------------	--------	---------------	------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为20,283,635.00元，第二层次的余额为3,037,161.00元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 报告期内无第三层次公允价值余额和本期变动金额。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

## 7.1 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	20,283,635.00	0.65
	其中：股票	20,283,635.00	0.65
2	固定收益投资	3,037,161,000.00	97.56
	其中：债券	3,037,161,000.00	97.56
	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	8,129.33	—
7	其他资产	55,551,558.34	1.78
8	合计	3,113,004,322.67	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	2,169,000.00	0.10
C	制造业	8,642,715.20	0.39
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	—	—

J	金融业	7,982,519.80	0.36
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	1,489,400.00	0.07
S	综合	—	—
	合计	20,283,635.00	0.90

### 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	91,995	2,947,519.80	0.13
2	601328	交通银行	500,000	2,815,000.00	0.13
3	000538	云南白药	39,384	2,532,391.20	0.11
4	601398	工商银行	500,000	2,220,000.00	0.10
5	601857	中国石油	300,000	2,169,000.00	0.10
6	000925	众合科技	100,000	1,930,000.00	0.09
7	000625	长安汽车	110,000	1,503,700.00	0.07
8	300027	华谊兄弟	110,000	1,489,400.00	0.07
9	002241	歌尔股份	51,800	1,485,624.00	0.07
10	000488	晨鸣纸业	150,000	1,191,000.00	0.05

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

	码			(%)
1	601318	中国平安	2,944,734.00	0.11
2	000925	众合科技	1,938,550.00	0.07
3	002241	歌尔股份	1,500,028.00	0.05
4	000625	长安汽车	1,479,400.00	0.05
5	000488	晨鸣纸业	1,162,500.00	0.04

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	2,727,000.00	0.10
2	300027	华谊兄弟	2,283,107.90	0.08
3	601857	中国石油	2,155,232.00	0.08
4	601398	工商银行	2,035,000.00	0.07
5	000538	云南白药	1,714,850.00	0.06
6	300494	盛天网络	590,492.38	0.02
7	603778	乾景园林	492,489.60	0.02
8	603299	井神股份	425,096.91	0.02
9	300491	通合科技	341,911.20	0.01
10	002777	久远银海	341,120.00	0.01
11	300490	华自科技	311,601.20	0.01
12	002778	高科石化	214,424.00	0.01

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,025,212.00
卖出股票收入（成交）总额	13,632,325.19

#### 7.5 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	150,020,000.00	6.69
	其中：政策性金融债	150,020,000.00	6.69
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	1,703,383,000.00	75.95
6	可转债	—	—
7	中期票据	1,183,758,000.00	52.78
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,037,161,000.00	135.41

#### 7.6 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

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	101551110	15武钢 MTN002	2,200,000	221,078,000.00	9.86
2	011699060	16奇瑞 SCP001	2,000,000	200,140,000.00	8.92
3	101660004	16陕有色 MTN001	2,000,000	191,940,000.00	8.56
4	011599795	15包钢集 SCP006	1,700,000	170,510,000.00	7.60
5	101656014	16鞍钢 MTN001	1,700,000	168,249,000.00	7.50

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。



## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	44,375.83
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	55,507,182.51
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	55,551,558.34

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
中加心 享混合 A	266	8,336,017.1 4	2,200,043,7 00.00	99.22%	17,336,859. 40	0.78%
中加心 享混合 C	9	4,906.72	—	—	44,160.44	100.00 %
合计	275	8,063,362.6 2	2,200,043,7 00.00	99.22%	17,381,019. 84	0.78%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	中加心享混合A	386,186.02	0.02%
	中加心享混合C	100.00	0.23%
	合计	386,286.02	0.02%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中加心享混合A	0
	中加心享混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中加心享混合A	0
	中加心享混合C	0
	合计	0

注：本公司高级管理人员、基金投资研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加心享混合A	中加心享混合C
基金合同生效日(2015年12月02日)基金份额总额	2,772,993,297.72	100.00
本报告期期初基金份额总额	2,772,993,297.72	-
本报告期基金总申购份额	251,567.23	46,069.68
减：本报告期基金总赎回份额	555,864,305.55	2,009.24
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,217,380,559.40	44,160.44

注：总申购份额中包含红利再投份额。

### §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金管理人根据法律法规和基金合同约定，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，在履行适当程序后，于2016年3月28日召开了中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，在托管人代表、律师、公证员的监督见证下，经出席大会的基金份额持有人及代理人投票表决，通过了调整基金管理费和赎回费的议案，该议案已于当日生效，并已向中国证监会备案。修订后的基金合同、托管协议、招募说明书已在指定媒介公布。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内人事变动情况：自2016年5月17日起，因工作变动原因，霍向辉先生不再担任中加基金管理有限公司督察长，由刘向途先生自该日起担任公司督察长一职。

本报告期内，基金托管人托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 基金改聘会计师事务所情况

自本基金成立日（2015年12月02日）起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交	占股	成交	占债	成交	占债	成交	占权	佣金	占当	

		金额	票 成交 总额 比例	金额	券 成交 总额 比例	金额	券回 购 成交 总额 比例	金额	证 成交 总额 比例		期佣 金 总量 的比 例	
中信 建投	2	22,6 57,5 37.1 9	100. 00%	—	—	—	—	—	—	21,1 00.9 9	100. 00%	

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

(1) 投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

(2) 公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

(3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后,由监察稽核部门负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3.投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	中加基金管理有限公司关于以现场方式召开中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》、公司官网	2016-02-25
2	中加心享灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司官网	2016-02-26
3	中加基金管理有限公司关于以现场方式召开中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》、公司官	2016-03-01

	人大会议的第一次提示性公告	网	
4	中加基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-03-25
5	中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》、公司官网	2016-03-29
6	中加基金管理有限公司关于中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》、公司官网	2016-03-29
7	中加心享灵活配置混合型证券投资基金关于调整申购费率、增加C类份额并修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》、公司官网	2016-03-29
8	中加心享灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司官网	2016-03-29
9	中加基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-04-15
10	中加心享灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》、公司官网	2016-04-21
11	中加基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	公司官网	2016-05-30

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §12 备查文件目录

#### 12.1 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募集的文件
  - 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、《中加心享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

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

## 12.3 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](http://www.bobbns.com)

中加基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十五日