

## 中加心安保本混合型证券投资基金2016年年度报告

2016年12月31日

基金管理人：中加基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017年3月31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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年【03】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。

本报告期自2016年3月23日起至2016年12月31日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§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合规守信情况的说明	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	12
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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	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合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	14
§7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	20
§8	投资组合报告	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2.1	报告期末按行业分类的境内股票投资组合	42
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	44
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.6	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	46
8.7	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	46
8.8	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	46
8.9	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	46
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.12	投资组合报告附注	47

§9	基金份额持有人信息.....	48
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
9.3	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.....	48
§10	开放式基金份额变动.....	48
§11	重大事件揭示.....	49
11.1	基金份额持有人大会决议.....	49
11.2	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.....	49
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
11.4	基金投资策略的改变.....	49
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8	其他重大事件.....	50
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§13	备查文件目录.....	53
13.1	备查文件目录.....	53
13.2	存放地点.....	53
13.3	查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中加心安保本混合型证券投资基金
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3月23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
报告期末基金份额总额	554,901,854.92
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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在基金组合中的投资比例，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。

### 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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	刘向途	田青
	联系电话	400-00-95526	010-67595096
	电子邮箱	service@bobbs.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-00-95526	010-67595096
传真		010-66226080	010-66275853
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317号	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区南纬路35号综合办公楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100050	100033
法定代表人		闫冰竹	王洪章

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bobbs.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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号综合办公楼
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2016年3月23日-2016年12月31日
本期已实现收益	14,456,711.03
本期利润	7,913,945.03
加权平均基金份额本期利润	0.0137
本期加权平均净值利润率	1.35%
本期基金份额净值增长率	1.33%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末
期末可供分配利润	7,363,509.98
期末可供分配基金份额利润	0.0133
期末基金资产净值	562,265,364.90
期末基金份额净值	1.0133
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末
基金份额累计净值增长率	1.33%

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、本期已实现收益是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

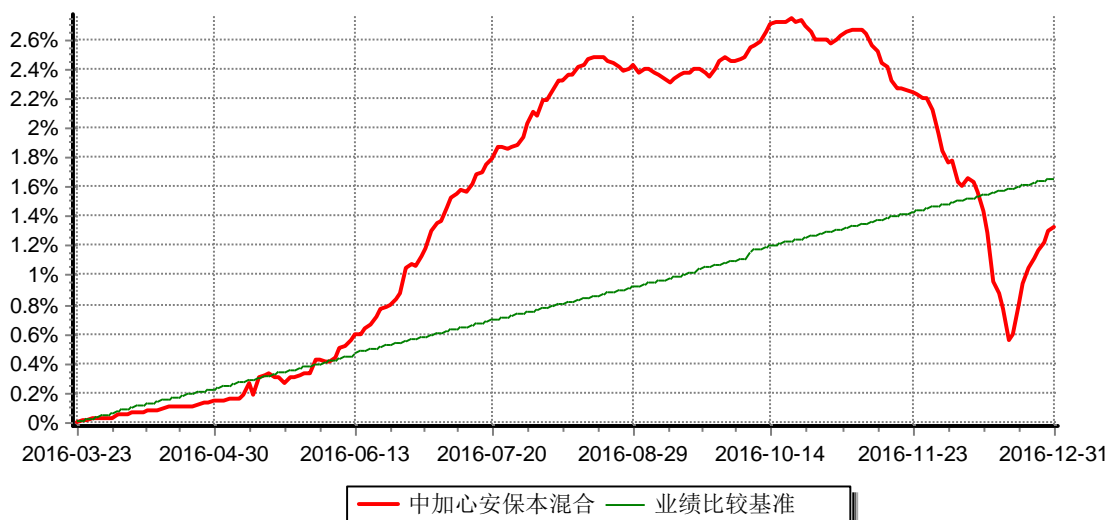
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	-1.11%	0.08%	0.53%	0.01%	-1.64%	0.07%
过去六个月	0.20%	0.07%	1.06%	0.01%	-0.86%	0.06%
自基金合同生效日起至 至今（2016年03月23 日-2016年12月31日）	1.33%	0.06%	1.65%	0.01%	-0.32%	0.05%

注：本基金基金合同生效日为2016年03月23日。

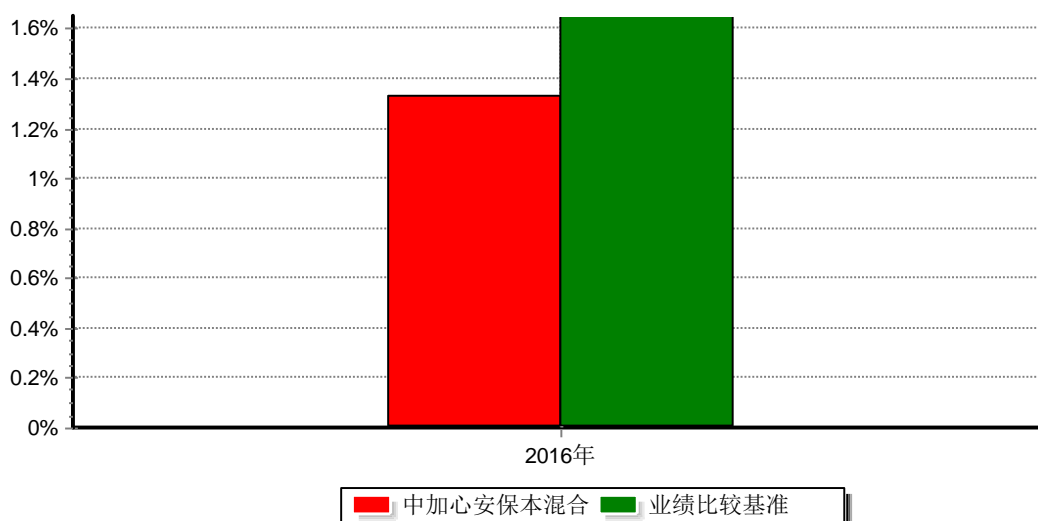
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收

### 益率变动的比较



注：1. 本基金基金合同于2016年3月23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，已完成建仓，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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同2016年3月23日生效，截至本报告期末未满一年，本基金于本报告期间未进行利润分配。



## § 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基金公司，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，本公司共管理十三只基金，分别是中加货币市场基金（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），中加纯债债券型证券投资基金（基金代码：A类000914）、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）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金（基金代码：003155）、中加丰盈纯债债券型证券投资基金（基金代码：003428）、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（基金代码：A类003660，C类003661）、中加丰享纯债债券型证券投资基金（基金代码：003445）、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（基金代码：003673）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金（基金代码：003417）。

#### 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（助理）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年3月23日	—	8	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

					<p>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)。</p>
张旭	本基金基金经理	2016年3月23日	—	8	<p>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)、中加心安灵活配置混合型</p>

					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)。
--	--	--	--	--	---

注：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，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》、《中加心安保本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 公平交易制度和控制方法

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。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

##### 4.3.2 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。本报告期内，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。

##### 4.3.3 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

报告期内，基金密切跟踪经济走势、市场预期、资金面波动及相关政策变化，及时调整组合久期和券种切换，严格甄别个券的估值和信用风险，择机交易提升组合净值，并基于资金面的变化，适时调整杠杆水平，以提高组合收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，中加心安保本混合净值增长率1.33%，业绩比较基准收益率1.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，经济基本面很可能呈现前稳后降的走势。上半年来看，在企业补库存、房地产、基建投资的惯性带动下经济有望趋稳，但进入下半年，随着房地产调控政策的作用开始显现，房地产投资增速下降使得经济面临着较大的下行压力。货币政策方面，在人民币贬值压力不减以及引导金融去杠杆的意图下，央行货币政策料将维持稳健中性。具体到债券市场，我们认为上半年各项监管政策的落地可能对债市的影响更大一些；下半年随着调控效果的显现、金融机构杠杆的下降以及经济基本面的走弱、通胀的下滑，债市可能迎来转机。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、监察稽核部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司监察稽核部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

#### 4.7 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验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 4.9 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元的情形。

### § 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，中国建设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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

中国建设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

中国建设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“中加心安保本混合型证券投资基金2016年年度报告”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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第【1701261】号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中加心安保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的第1页至第30页的中加心安保本混合型证券投资基金（以下简称“中加心安保本混合”）财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表，自2016年3月23日（基金合同生效日）至2016

	<p>年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p>
<p>管理层对财务报表的责任段</p>	<p>编制和公允列报财务报表是中加心安保本混合管理人中加基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1) 按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
<p>注册会计师的责任段</p>	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价中加基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为，中加心安保本混合财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实</p>

	务操作的规定编制，公允反映了中加心安保本混合2016年12月31日的财务状况以及自2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间的经营成果及基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	李砾、管祎铭
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2017-03-24

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中加心安保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	263,447.31
结算备付金		14,942,958.50
存出保证金		462.25
交易性金融资产	7.4.7.2	772,436,940.00
其中：股票投资		808,340.00
基金投资		—
债券投资		771,628,600.00
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,800,000.00
应收证券清算款		453,664.90
应收利息	7.4.7.5	14,849,162.99
应收股利		—



应收申购款		495.05
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		804,747,131.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		241,199,310.50
应付证券清算款		—
应付赎回款		204,079.62
应付管理人报酬		576,284.64
应付托管费		96,047.44
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	15,170.00
应交税费		—
应付利息		73,750.25
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	317,123.65
负债合计		242,481,766.10
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	554,901,854.92
未分配利润	7.4.7.10	7,363,509.98
所有者权益合计		562,265,364.90
负债和所有者权益总计		804,747,131.00

注：1. 本报告报告期为2016年01月01日至2016年12月31日，本基金基金合同于2016年3月23日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

2. 报告截止日2016年12月31日，基金份额净值为1.0133元，基金份额总额554,901,854.92份。

## 7.2 利润表

会计主体：中加心安保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月23日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
一、收入		18,344,103.78
1. 利息收入		23,729,457.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,013,303.46
债券利息收入		21,280,023.42
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		436,130.97
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		918,799.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,525.25
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	914,293.80
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—
股利收益	7.4.7.16	1,980.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,542,766.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	238,612.88

<b>减：二、费用</b>		10,430,158.75
1. 管理人报酬		5,431,986.84
2. 托管费		905,331.13
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.19	9,860.63
5. 利息支出		3,661,874.08
其中：卖出回购金融资产支出		3,661,874.08
6. 其他费用	7.4.7.20	421,106.07
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		7,913,945.03
减：所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		7,913,945.03

注：本基金基金合同于2016年3月23日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中加心安保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月23日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年3月23日至2016年12月31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)	584,931,094.44	—	584,931,094.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	7,913,945.03	7,913,945.03
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)	-30,029,239.52	-550,435.05	-30,579,674.57
其中：1. 基金申购款	3,269,529.94	63,664.09	3,333,194.03
2. 基金赎回款	-33,298,769.46	-614,099.14	-33,912,868.60
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)	554,901,854.92	7,363,509.98	562,265,364.90

注：本基金基金合同于2016年3月23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7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中加心安保本混合型证券投资基金已经中国证券监督管理委员会2016年1月29日证监许可[2016]211号《关于准予中加心安保本混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，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《中加心安保本混合型证券投资基金合同》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，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过中加基金及北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）的代销网点公开发售，募集期为2016年2月29日至2016年3月18日。本基金于2016年3月23日成立，成立之日基金实收份额为584,931,094.44份（含利息转份额人民币110,913.53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。

该基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券及可分离转债、次级债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类品种，以及股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

### 7.4.2 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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中加心安保本混合型证券投资基金基金合同》编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括债券投资。

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 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) 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；

##### (2) 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。

##### (3) 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；

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

估值应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、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》、中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中基协发[2014]24号《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》及其他法律、法规、行业协会自律规则的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

基本原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，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，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化且证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，应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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并应通过定期校验，确保估值技术的有效性。

(3) 有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，资产管理人应根据具体情况与托管人进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益 /（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得 /（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。



#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

##### 1、保本周期内本基金收益分配：

(1) 仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。在保本周期内，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，可由相应销售机构（基金管理人或其他销售机构）代为支付。

##### 2、转型为非保本的债券型基金后的收益分配

基金收益分配方式分为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按除权日的单位净值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的收益分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
活期存款	263,447.31
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—

其他存款	—
合计	263,447.31

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		852,887.25	808,340.00	-44,547.25
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	164,967,641.09	163,118,000.00	-1,849,641.09
	银行间市场	613,159,177.66	608,510,600.00	-4,648,577.66
	合计	778,126,818.75	771,628,600.00	-6,498,218.75
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		778,979,706.00	772,436,940.00	-6,542,766.00

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,800,000.00	—
合计	1,800,000.00	—

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	994.98
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	7,396.73
应收债券利息	14,840,735.29
应收买入返售证券利息	35.75
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	0.22
合计	14,849,162.99

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	603.36
银行间市场应付交易费用	14,566.64
合计	15,170.00

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	3,123.65
审计费用	75,000.00
信息披露费	230,000.00
账户维护费	9,000.00
合计	317,123.65

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	584,931,094.44	584,931,094.44
本期申购	3,269,529.94	3,269,529.94
本期赎回（以“-”号填列）	-33,298,769.46	-33,298,769.46
本期末	554,901,854.92	554,901,854.92

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	14,456,711.03	-6,542,766.00	7,913,945.03
本期基金份额交易产生的变动数	-570,228.60	19,793.55	-550,435.05
其中：基金申购款	35,940.04	27,724.05	63,664.09
基金赎回款	-606,168.64	-7,930.50	-614,099.14
本期已分配利润	—	—	—
本期末	13,886,482.43	-6,522,972.45	7,363,509.98

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年3月23日至2016年12月31日
活期存款利息收入	64,215.21
定期存款利息收入	1,834,907.22
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	109,895.45
其他	4,285.58
合计	2,013,303.46

注：其他为申购款利息收入和交易所保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	761,128.00
减：卖出股票成本总额	758,602.75
买卖股票差价收入	2,525.25

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31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	914,293.80
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	914,293.80

##### 7.4.7.13.2 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3月23日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	185,066,532.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	180,075,668.77
减：应收利息总额	4,076,570.26
买卖债券差价收入	914,293.80

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年12月31日止会计期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年12月31日止会计期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年12月31日止会计期间无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月23日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,980.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,980.00

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,542,766.00
——股票投资	-44,547.25
——债券投资	-6,498,218.75
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-6,542,766.00

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
基金赎回费收入	238,612.88
合计	238,612.88

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	3,456.88
银行间市场交易费用	6,403.75
合计	9,860.63

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元



项目	本期
	2016年3月23日至2016年12月31日
审计费用	75,000.00
信息披露费	305,000.00
托管户账户维护费	360.00
汇划手续费	16,246.07
上清所账户维护费	12,500.00
中债登账户维护费	12,000.00
合计	421,106.07

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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（“北京银行”）	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,431,986.84
其中：支付销售机构的客户维护费	1,190,324.77

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	905,331.13

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本报告期内，本基金未向关联方支付销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

#### 7.4.10.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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3月23日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 活期存款	263,447.31	64,215.21

注：本年度期末余额仅为活期存款，利息收入为活期存款利息收入。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与各关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本报告期末进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额192,999,310.50元，是以如下债券作为质押：

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
011699636	16桂交投 SCP002	2017-01-03	100.42	330,000	33,138,600.00
011699771	16张江 SCP001	2017-01-03	100.27	300,000	30,081,000.00
011699793	16中原 高速 SCP001	2017-01-03	100.26	300,000	30,078,000.00
1180050	11吉城建 建债	2017-01-03	104.04	30,000	3,121,200.00
1180122	11吉利 债	2017-01-03	103.55	498,000	51,567,900.00
1522006	15交银 租赁债	2017-01-03	99.75	500,000	49,875,000.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币48,200,000.00元，将于2016年1月3日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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建设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。

##### 7.4.13.2.1 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12月31日
A-1	60,184,000.00
A-1以下	—
未评级	210,267,000.00
合计	270,451,000.00

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。

##### 7.4.13.2.2 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12月31日
AAA	326,070,000.00
AAA以下	145,146,600.00
未评级	29,961,000.00
合计	501,177,600.00

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+。

#### 7.4.13.3 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。

本基金为混合型证券投资基金，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。期末除7.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

于2016年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有241,199,310.50元将在一个月內到期且计息（该利息金额不重大）外，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金主要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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016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	263,447.31	—	—	—	263,447.31
结算备付金	14,942,958.50	—	—	—	14,942,958.50
存出保证金	462.25	—	—	—	462.25
交易性金融资产	330,841,000.00	440,787,600.00	—	808,340.00	772,436,940.00
买入返售金融资产	1,800,000.00	—	—	—	1,800,000.00
应收证券清算款	—	—	—	453,664.90	453,664.90
应收利息	—	—	—	14,849,162.99	14,849,162.99
应收申购款	—	—	—	495.05	495.05
资产总计	347,847,868.06	440,787,600.00	—	16,111,662.94	804,747,131.00
负债					
卖出回购金融资产款	241,199,310.50	—	—	—	241,199,310.50
应付赎回款	—	—	—	204,079.62	204,079.62
应付管理人报酬	—	—	—	576,284.64	576,284.64
应付托管费	—	—	—	96,047.44	96,047.44
应付交易费用	—	—	—	15,170.00	15,170.00
应付利息	—	—	—	73,750.25	73,750.25
应付赎回费	—	—	—	3,123.65	3,123.65
预提费用	—	—	—	314,000.00	314,000.00
负债总计	241,199,310.50	—	—	1,282,455.60	242,481,766.10

利率敏感度缺口	106,648,557.56	440,787,600.00	—	14,829,207.34	562,265,364.90
---------	----------------	----------------	---	---------------	----------------

注：本基金于2016年3月23日成立，无去年同期数据。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日
	市场利率下降 25 个基点	1,890,380.84
	市场利率上升 25 个基点	-1,890,380.84

注：本基金于2016年3月23日成立，无去年同期数据。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	808,340.00	0.14
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	771,628,600.00	137.24



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	772,436,940.0 0	137.38

注：无

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

#### 7.4.14 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12月31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的余额为808,340.00元，第二层次的余额为771,628,600.00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) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31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相差很小。

(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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	808,340.00	0.10
	其中：股票	808,340.00	0.10
2	固定收益投资	771,628,600.00	95.88
	其中：债券	771,628,600.00	95.88
	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	1,800,000.00	0.22
	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	15,206,405.81	1.89
7	其他各项资产	15,303,785.19	1.90
8	合计	804,747,131.00	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。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	500,381.00	0.09
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	54,640.00	0.01
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	—	—
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	207,900.00	0.04
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	45,419.00	0.01
S	综合	—	—
	合计	808,340.00	0.14

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。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300012	华测检测	18,000	207,900.00	0.04

2	000895	双汇发展	7,700	161,161.00	0.03
3	000876	新希望	17,300	139,265.00	0.02
4	600826	兰生股份	2,000	54,640.00	0.01
5	000158	常山股份	4,200	52,500.00	0.01
6	600894	广日股份	3,500	47,845.00	0.01
7	000636	风华高科	4,000	39,040.00	0.01
8	300027	华谊兄弟	3,000	33,000.00	0.01
9	600143	金发科技	4,000	31,120.00	0.01
10	300282	汇冠股份	1,000	29,450.00	0.01
11	000793	华闻传媒	1,100	12,419.00	—

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300012	华测检测	234,030.00	0.04
2	002191	劲嘉股份	204,232.00	0.04
3	000895	双汇发展	180,389.00	0.03
4	300027	华谊兄弟	154,890.00	0.03
5	000876	新希望	143,749.00	0.03
6	600826	兰生股份	118,867.00	0.02
7	000636	风华高科	99,700.00	0.02
8	601398	工商银行	89,000.00	0.02
9	002705	新宝股份	67,550.00	0.01
10	000158	常山股份	55,732.00	0.01
11	600894	广日股份	52,670.00	0.01
12	600547	山东黄金	41,490.00	0.01
13	000952	广济药业	39,644.00	0.01
14	300282	汇冠股份	31,825.00	0.01
15	600143	金发科技	29,520.00	0.01

16	600115	东方航空	27,840.00	0.01
17	600585	海螺水泥	27,712.00	—
18	000793	华闻传媒	12,650.00	—

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002191	劲嘉股份	208,774.00	0.04
2	300027	华谊兄弟	112,320.00	0.02
3	601398	工商银行	90,800.00	0.02
4	002705	新宝股份	71,360.00	0.01
5	000636	风华高科	62,760.00	0.01
6	600826	兰生股份	55,080.00	0.01
7	000952	广济药业	43,362.00	0.01
8	600547	山东黄金	38,740.00	0.01
9	600585	海螺水泥	27,472.00	—
10	300012	华测检测	25,740.00	—
11	600115	东方航空	24,720.00	—

#### 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	1,611,490.00
卖出股票的收入（成交）总额	761,128.00

#### 8.5 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	29,961,000.00	5.33
2	央行票据	—	—
3	金融债券	49,875,000.00	8.87
	其中：政策性金融债	—	—

4	企业债券	207,300,600.00	36.87
5	企业短期融资券	270,451,000.00	48.10
6	中期票据	214,041,000.00	38.07
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	771,628,600.00	137.24

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。

### 8.6 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	1180122	11吉利债	500,000	51,775,000.00	9.21
2	101354002	13桂机场 MTN001	500,000	51,095,000.00	9.09
3	1522006	15交银租赁债	500,000	49,875,000.00	8.87
4	124532	14甘公01	400,000	43,656,000.00	7.76
5	101560008	15川铁投 MTN002	400,000	41,152,000.00	7.32

### 8.7 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。

### 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

8.12.1 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。

#### 8.12.2

8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	462.25
2	应收证券清算款	453,664.90
3	应收股利	—
4	应收利息	14,849,162.99
5	应收申购款	495.05
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	15,303,785.19

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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流通受限的股票。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,220	131,493.33	105,471,901.14	19.01%	449,429,953.78	80.99%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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基金	76,455.62	0.01%

### 9.3 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	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	—
本基金基金经理持有本开放式基金	—

注：本基金高级管理人员、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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年3月23日)基金份额总额	584,931,094.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,269,529.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	33,298,769.46
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	554,901,854.92



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，本基金基金托管人托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为75,000元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	1,748,707.00	73.70%	1,278.79	74.24%	
民族证券	1	623,911.00	26.30%	443.81	25.76%	

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
方正证券	42,180,747.95	30.75%	1,646,036,000.00	8.70%	—	—
民族证券	94,982,641.09	69.25%	17,264,700,000.00	91.30%	—	—

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加心安保本混合型证券投资基金发售公告	公司官网、四大报	2016-02-24
2	中加心安保本混合型证券投资基金基金合同	公司官网	2016-02-24
2	中加心安保本混合型证券投资基金基金合同内容摘要	公司官网、四大报	2016-02-24
4	中加心安保本混合型证券投资基	公司官网	2016-02-24

	金招募说明书		
5	中加心安保本混合型证券投资基金招募说明书摘要	公司官网、四大报	2016-02-24
6	保证合同	公司官网	2016-02-24
7	中加心安保本混合型证券投资基金托管协议	公司官网	2016-02-24
8	中加基金管理有限公司关于中加心安保本混合型证券投资基金新增代销机构的公告	公司官网	2016-02-26
9	中加基金管理有限公司关于增加建设银行作为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-03-02
10	中加心安保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网	2016-03-24
11	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
12	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
13	中加基金管理有限公司关于北京增财基金销售有限公司终止代理销售旗下部分开放式基金的公告	公司官网	2016-05-19
14	中加基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	公司官网	2016-05-25
15	中加心安保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	公司官网	2016-06-16
16	中加基金管理有限公司关于旗下基金2016年6月30日基金资产净值的公告	公司官网、四大报	2016-07-05
17	中加心安保本混合型证券投资基	公司官网、四大报	2016-07-20

	金2016年第2季度报告		
18	关于增加申万宏源西部证券为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-07-27
19	关于增加申万宏源证券为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-07-27
20	中加基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-08-03
21	中加基金管理有限公司关于增加北京微动利投资管理有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-08-03
22	中加基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-08-03
23	中加心安保本混合型证券投资基金2016年半年度报告	公司官网	2016-08-25
24	中加心安保本混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要	公司官网、四大报	2016-08-25
25	中加基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-08-30
26	中加基金管理有限公司关于北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-09-13
27	中加基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-09-14
28	中加心安保本混合型证券投资基金2016年第3季度报告	公司官网、四大报	2016-10-26
29	中加心安保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)	公司官网	2016-11-04
30	中加心安保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	公司官网、四大报	2016-11-04

31	中加基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-11-04
32	中加基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-11-04
33	中加基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-11-08
34	中加基金管理有限公司关于增加平安证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	公司官网	2016-12-20
35	中加基金管理有限公司关于参加平安证券股份有限公司费率优惠的公告	公司官网	2016-12-20

注：上述表格“四大报”是指《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

《中加心安保本混合型证券投资基金基金合同》

《中加心安保本混合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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

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

中加基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日