

# 中加科盈混合型证券投资基金

2020年第4季度报告

2020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:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2021年01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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年01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2020年10月01日起至2020年12月31日止。

## §2 基金产品概况

|             |                                                                                                                                 |         |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| 基金简称        | 中加科盈混合                                                                                                                          |         |
| 基金主代码       | 008033                                                                                                                          |         |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                                                                                                                          |         |
| 基金合同生效日     | 2019年11月29日                                                                                                                     |         |
| 报告期末基金份额总额  | 482,413,759.03份                                                                                                                 |         |
| 投资目标        | 在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。                                                                                     |         |
| 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，力争实现长期稳健增值。 |         |
| 业绩比较基准      | 沪深300指数收益率×30%+中债总全价（总值）指数收益率×70%                                                                                               |         |
| 风险收益特征      | 本基金属于混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。                                                                                       |         |
| 基金管理人       | 中加基金管理有限公司                                                                                                                      |         |
| 基金托管人       | 中国民生银行股份有限公司                                                                                                                    |         |
| 下属分级基金的基金简称 | 中加科盈混合A                                                                                                                         | 中加科盈混合C |

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 008033          | 008034         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 416,190,881.49份 | 66,222,877.54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(2020年10月01日 - 2020年12月31日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 中加科盈混合A                        | 中加科盈混合C       |
| 1.本期已实现收益      | 8,635,142.44                   | 1,981,255.42  |
| 2.本期利润         | 17,825,939.07                  | 2,401,086.70  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0394                         | 0.0278        |
| 4.期末基金资产净值     | 482,783,004.21                 | 76,157,249.30 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1600                         | 1.1500        |

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 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

中加科盈混合A净值表现

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.37%  | 0.23%     | 4.71%      | 0.30%         | -1.34% | -0.07% |
| 过去六个月 | 9.86%  | 0.47%     | 6.49%      | 0.38%         | 3.37%  | 0.09%  |

|            |        |       |        |       |       |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去一年       | 14.93% | 0.42% | 7.99%  | 0.40% | 6.94% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.00% | 0.41% | 10.47% | 0.39% | 5.53% | 0.02% |

## 中加科盈混合C净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 3.07%  | 0.22%     | 4.71%      | 0.30%         | -1.64% | -0.08% |
| 过去六个月      | 9.38%  | 0.47%     | 6.49%      | 0.38%         | 2.89%  | 0.09%  |
| 过去一年       | 14.00% | 0.42%     | 7.99%      | 0.40%         | 6.01%  | 0.02%  |
| 自基金合同生效起至今 | 15.00% | 0.41%     | 10.47%     | 0.39%         | 4.53%  | 0.02%  |

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





注：1、本基金基金合同于 2019 年 11 月 29 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

2、根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                               | 任本基金的<br>基金经理期<br>限 |          | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>限 | 说明                                                                                                                                                                                 |
|-----|----------------------------------|---------------------|----------|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                  | 任职<br>日期            | 离任<br>日期 |                            |                                                                                                                                                                                    |
| 闫沛贤 | 投资研究部副总监<br>兼固定收益部总监、<br>本基金基金经理 | 2019<br>-11-<br>29  | -        | 12                         | 闫沛贤先生，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，曾任中加丰泽纯债债券型证券投资基金（2016年12月19日至2018年6月22日）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金（2018年12月13日至2019年12月3 |

|     |         |            |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----|---------|------------|---|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         |            |   |    | 0日)、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金(2018年11月27日至2020年11月23日)的基金经理,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(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(2014年3月24日至今)、中加纯债债券型证券投资基金(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(2015年12月28日至今)、中加颐合纯债债券型证券投资基金(2018年9月13日至今)、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金(2018年11月8日至今)、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金(2019年5月29日至今)、中加科盈混合型证券投资基金(2019年11月29日至今)的基金经理。 |
| 冯汉杰 | 本基金基金经理 | 2019-11-29 | - | 11 | 冯汉杰先生,清华大学数学硕士。2009年7月至2016年6月历任泰康资产管理有限公司研究员、投资经理。2016年8月至2018年6月任中欧基金管理有限公司投资经理。2018年7月加入中加基金管理有限公司。现任中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金(2018年12月5日至今)、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金(2019年10月23日至今)、中加科盈混合型证券投资基金(2019年11月29日至今)、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基                                                                                                      |

|  |  |  |  |  |                                                                                    |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 金（2020年5月22日至今）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2020年5月8日至今）和中加核心智造混合型证券投资基金（2020年7月22日至今）的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------|

- 1、任职日期说明：基金经理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

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期内，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，并且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，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。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。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，债券市场长端整体震荡，短端震荡中上涨，收益率曲线先平后陡。其中10年和1年期国债收益率分别下行了1BP和18BP，分别至3.14%和2.47%。具体看，一方面，9月和10月金融和经济数据持续超预期，基本面延续修复；并且拜登当选，美国大选的不确定性落地，风险偏好抬升。另一方面，欧美二次疫情愈演愈烈，封锁措施进一步升级；但美国经济刺激法案却迟迟未达成。多空因素交织下债市保持震荡。然而华晨、永煤接连的信用违约事件，引发市场对企业“逃废债”的担忧，恐慌情绪迅速发酵，具备类似特征的企业债券估值大幅提升，融资难度加大。同时，基金、资管产品等净值下跌导致赎回，进一步引发债券被抛售。加上机构入库标准提升，对部分区域或行业采取一刀切强制卖出，也加剧收益率走高，形成流动性危机负反馈。10年国债收益率快速上行至年内新高3.35%。之后，随着国务院金融委定调债市，要求严肃处罚各类“逃废债”后，市场恐慌情绪明显缓解。加上11月底央行意外投放2000亿MLF后，呵护态度明确，货币市场利率回落。此外中央经济工作会议不急转弯的定调加速了做多情绪释放，短端1年期国债收益率大幅下行50BP，长端10年期国债收益率也回到季初水平。

四季度内，A股市场上涨明显，沪深300和创业板指均上涨了15%左右。市场整体上涨还是来自于三季度以来的整体大环境表现，即经济温和复苏而流动性环境维持温和中性。结构方面，四季度内发生了明显的转变，前两个月市场的结构表现延续了第三季度的行情特点，前期剧烈的分化行情进一步得到收敛。而在12月，以白酒和新能源板块为代表的热门赛道再次大涨，推动公募基金整体在12月也大幅上涨。

展望未来，预计债市仍将处于震荡格局。随着国务院金融委定调债市，要求严肃处罚各类“逃废债”行为，叠加央行持续净投放资金呵护，市场恐慌情绪明显缓解。后续，投资者将重新聚焦基本面主线。目前国内经济延续渐进修复的趋势，虽然房地产投资高速增长阶段临近结束，大概率进入温和走弱的下行通道，而且作为逆周期调控重要抓手的基建投资在经济持续复苏中发力的必要性也大为减弱，但顺周期的消费和制造业投资将成为经济主要推升力量，加上出口也保持强劲，基本面整体向好趋势不变。通胀上，预计上半年在低基数、高成本和顺周期因素作用下较快攀升，年中达到高点。之后随着全球产能逐渐恢复，国内信用扩张放缓及地产基建投资逐步弱化的影响下，通胀表现转弱。预计全年通胀中枢温和，不会对政策构成掣肘，对债市影响有限。货币政策上，从今年5月份开始，央行态度回归中性，中央经济工作会议总体保持了中性基调，强调灵活精准、合理适度，预计货币政策将保持不缺不滥、不松不紧的状态，彻底转向仍为时过早，对债市有支撑。另外，欧美二次疫情仍在蔓延，经济恢复常态仍需时日，其货币政策仍处在宽松周期，中美利差近220BP，处于历史高位，随着国内资本市场的进一步开放，大量外资进场将推动利差收敛。在这种环境下，债市将呈现出一种上有顶，下有底的区间震荡行情。



A股市场，预计下一阶段，经济基本面修复、流动性环境维持温和的大格局可能仍将持续。在这一条件下，实际上不太支持市场整体或者热门赛道板块出现大幅上涨。近期的局部市场表现，已经出现了明显的泡沫迹象，虽然很难判断泡沫的时间和高度，但是最近的表现还是十分令人担心的。基金的权益配置基本不包含热门赛道，因此在泡沫期内显然不会有太好的表现，但是预计将有较好的抗风险能力。

报告期内，债券方面，我们选择以票息为王的策略，密切跟踪经济基本面、政策面和资金面的变化动态把握交易节奏，保持组合久期在2年左右。而且在央行持续呵护资金面的背景下，适当提高了杠杆水平。债券配置上，在严格甄别信用风险的前提下，结合行业特点，深挖资质佳、久期适当、收益率相对较高的个券获取票息收益，持仓以中高等级城投债为主。同时，以这些信用债作为底仓，在11月下旬债市上涨行情中，我们抓住机会参与了利率债波段交易，并在年前选择获利了结，赚取了价差收益。并在永煤事件爆发，债市回调阶段，通过国债期货灵活对冲风险，有效降低了回撤。转债方面，我们选择板块轮动和个券的中长期逻辑来应对短期的不确定性。在控制波动风险的前提下，自上而下精选优质板块和个券，获取alpha收益。

权益部分，持仓维持低波动策略配置，配置仍然集中在公用事业、金融地产、周期蓝筹等板块上。在本季度前两个月内，这些板块表现较好，而在最后一个月表现不佳，整体四季度来看表现还算一般。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加科盈混合A基金份额净值为1.1600元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.37%，同期业绩比较基准收益率为4.71%；截至报告期末中加科盈混合C基金份额净值为1.1500元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.07%，同期业绩比较基准收益率为4.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)          | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 130,755,966.81 | 22.54            |
|    | 其中：股票  | 130,755,966.81 | 22.54            |
| 2  | 基金投资   | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资 | 370,866,000.00 | 63.93            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 370,866,000.00 | 63.93  |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 60,907,941.99  | 10.50  |
| 8 | 其他资产              | 17,596,068.20  | 3.03   |
| 9 | 合计                | 580,125,977.00 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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              | 6,668,765.00  | 1.19         |
| C  | 制造业              | 61,866,449.84 | 11.07        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,125,452.00  | 0.56         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 3,110,643.00  | 0.56         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 10,757,245.00 | 1.92         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 2,259,930.00  | 0.40         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,035,913.63  | 0.19         |
| J  | 金融业              | 24,236,021.00 | 4.34         |
| K  | 房地产业             | 14,035,983.00 | 2.51         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,591,693.00  | 0.64         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,649.20     | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 52,222.14     | 0.01         |
| 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        | 130,755,966.81 | 23.39 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600887 | 伊利股份 | 164,000 | 7,276,680.00 | 1.30         |
| 2  | 601633 | 长城汽车 | 191,300 | 7,233,053.00 | 1.29         |
| 3  | 002925 | 盈趣科技 | 96,900  | 6,233,577.00 | 1.12         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 70,100  | 6,097,298.00 | 1.09         |
| 5  | 601006 | 大秦铁路 | 925,900 | 5,981,314.00 | 1.07         |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 300,000 | 5,802,000.00 | 1.04         |
| 7  | 002142 | 宁波银行 | 143,700 | 5,078,358.00 | 0.91         |
| 8  | 002444 | 巨星科技 | 160,300 | 4,986,933.00 | 0.89         |
| 9  | 601088 | 中国神华 | 274,100 | 4,936,541.00 | 0.88         |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 306,700 | 4,851,994.00 | 0.87         |

### 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      | 30,078,000.00  | 5.38         |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,078,000.00  | 5.38         |
| 4  | 企业债券      | 29,625,000.00  | 5.30         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 311,163,000.00 | 55.67        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |

|    |      |                |       |
|----|------|----------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -              | -     |
| 9  | 其他   | -              | -     |
| 10 | 合计   | 370,866,000.00 | 66.35 |

### 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  | 101900678 | 19亚盛实业MT N001  | 500,000 | 50,785,000.00 | 9.09         |
| 2  | 101901289 | 19空港兴城MT N001B | 300,000 | 30,567,000.00 | 5.47         |
| 3  | 163373    | 20华融G1         | 300,000 | 29,625,000.00 | 5.30         |
| 4  | 102000471 | 20中国铜业MT N001  | 300,000 | 29,466,000.00 | 5.27         |
| 5  | 101801277 | 18黄冈城投MT N002  | 200,000 | 20,214,000.00 | 3.62         |

**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**  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**  
本基金本报告期内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

本基金主要采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人通过对宏观经济、债券市场和流动性的研究，结合不同品种和期限的国债期货的定价，选择最合适的套保品种，管理资产的利率风险。基金管理人在充分考虑国债期货收益和风险的基础，灵活利用其杠杆和方向特征，降低投资组合的整体波动性。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险指标说明     |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|------------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -          |
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |          |         |           | -          |
| 国债期货投资本期收益(元)     |    |          |         |           | 860,687.86 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) |    |          |         |           | -          |

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金主要采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人通过对宏观经济、债券市场和流动性的研究,结合不同品种和期限的国债期货的定价,选择最合适的套保品种,管理资产的利率风险。基金管理人在充分考虑国债期货收益和风险的基础,灵活利用其杠杆和方向特征,降低投资组合的整体波动性。本报告期内,本基金产品投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

### 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1** 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**5.11.2** 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 65,912.63     |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,019,009.38 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 7,511,146.19  |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 17,596,068.20 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           | 中加科盈混合A        | 中加科盈混合C        |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 534,316,838.13 | 22,907,236.52  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 142,883,846.75 | 106,411,876.11 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 261,009,803.39 | 63,096,235.09  |
| 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               | 416,190,881.49 | 66,222,877.54  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                    | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                |      | 报告期末持有基金情况     |                |        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|----------------|------|----------------|----------------|--------|
|                                                                                                                                          | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额           | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构                                                                                                                                       | 1              | 20201001-20201231      | 134,667,653.56 | 0.00 | 0.00           | 134,667,653.56 | 27.92% |
|                                                                                                                                          | 2              | 20201001-20201028      | 170,400,990.73 | 0.00 | 170,400,990.73 | 0.00           | 0.00%  |
| 产品特有风险                                                                                                                                   |                |                        |                |      |                |                |        |
| <p>本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。</p> |                |                        |                |      |                |                |        |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加科盈混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加科盈混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加科盈混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

基金托管人地址：北京市西城区复兴门内大街2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

2021年01月21日