

---

中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2024年第2季度报告

2024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:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月18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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年04月01日起至2024年06月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	中加安盈一年定开债券发起
基金主代码	015552
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月20日
报告期末基金份额总额	510,000,000.00份
投资目标	力争在严格控制投资风险的前提下，长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，</p>

	方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	7,304,426.85
2.本期利润	7,487,551.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0147
4.期末基金资产净值	516,290,232.33
5.期末基金份额净值	1.0123

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	0.06%	1.06%	0.07%	0.38%	-0.01%
过去六个月	2.54%	0.07%	2.42%	0.07%	0.12%	0.00%
过去一年	3.67%	0.05%	3.27%	0.06%	0.40%	-0.01%
自基金合同	6.54%	0.06%	4.54%	0.05%	2.00%	0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于跃	原本基金基金经理	2022-06-20	2024-04-01	12	于跃先生，伦敦帝国理工大学金融数学硕士。2012年5月至2015年5月，任职于民生证券股份有限公司，担任固收投资经理助理；2015年6月至2019年11月，任职于中信建投证券股份有限公司，任固定收益投资经理。2019年12月加入中加基金管理有限公司，曾任中加优享纯债债券型证券投资基金（2020年3月4日至2021年

				<p>8月20日)、中加丰裕纯债债券型证券投资基金(2020年5月7日至2021年8月20日)、中加颐信纯债债券型证券投资基金(2020年3月4日至2021年12月21日)、中加瑞利纯债债券型证券投资基金(2020年3月4日至2022年3月28日)、中加瑞合纯债债券型证券投资基金(2020年11月25日至2022年11月15日)、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金(2020年3月3日至2022年12月29日)、中加科丰价值精选混合型证券投资基金(2020年5月13日至2024年3月18日)、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金(2020年2月19日至2024年3月18日)、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022年6月20日至2024年4月1日)的基金经理,现任中加颐享纯债债券型证券投资基金(2020年3月3日至今)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金(2021年12月15日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金(2022年4月29日至今)、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022年5月13日至今)、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022年9月13日至</p>
--	--	--	--	--

					今)、中加博裕纯债债券型证券投资基金(2023年11月24日至今)、中加纯债债券型证券投资基金(2024年5月10日至今)的基金经理。
庞智桐	本基金基金经理	2024-04-01	-	6	庞智桐先生,中国科学技术大学理学学士,中国科学院大学金融硕士。2017年7月至2019年7月,任职于渤海证券有限公司债券销售交易总部,担任债券投资助理;2019年8月加入中加基金管理有限公司固定收益部从事债券投研工作。现任中加邮益一年持有期混合型证券投资基金(2024年2月1日至今)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金(2024年2月1日至今)、中加科丰价值精选混合型证券投资基金(2024年3月18日至今)、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金(2024年3月18日至今)、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2024年4月1日至今)、中加聚享增盈债券型证券投资基金(2024年6月28日至今)的基金经理。

注:1、任职日期说明:本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期。

2、离任日期说明:因工作安排,于跃先生于2024年04月01日离任本基金基金经理。

3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部规章，制定了《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。本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易制度的相关规定，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

二季度影响债券走势的最核心因素是监管通过加强对“手工补息”、智能存款等银行的行为监管进一步压降银行存款付息成本，这推动了实体部门资产配置由银行存款转向银行理财、货币基金等非银产品，非银资产荒进一步加剧的带动下，信用债收益率快速下行，信用债的信用利差、期限利差、等级利差均在压缩。期间特别国债供给速度偏缓、政治局会议提出去库存的地产政策新思路均带来了阶段性的市场波动，但未改变利率运行趋势。

货币政策对利率债波动节奏影响显著。4-5月，央行持续向市场提示长债风险，市场一度对10年国债波动区间2.2-2.4%、30年国债波动区间2.4%-2.6%形成了一致预期。6月下旬潘行长在陆家嘴金融论坛上的关于货币政策新框架的讲话提及未来考虑淡化1年

期MLF等中期政策利率的影响，市场解读为长债利率定价“失锚”，收益率曲线重回年内低点，许多品种甚至创出年内新低水平。

产品操作方面，继续秉持着稳健的配置思路，保障流动性的前提下二季度增持了部分二级资本债和有性价比的信用债，将组合久期维持在中性水平。长端利率债交易则更加灵活，4月-5月通过10年国开的波段交易获取了一定超额回报，6月之后则陆续降低了久期敞口。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加安盈一年定开债券发起基金份额净值为1.0123元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.44%，同期业绩比较基准收益率为1.06%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	621,783,059.06	99.86
	其中：债券	621,783,059.06	99.86
	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	562,836.15	0.09
8	其他资产	300,000.00	0.05
9	合计	622,645,895.21	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**

本基金本报告期末未持有境内股票。

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

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	183,956,596.37	35.63
	其中：政策性金融债	20,172,109.59	3.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	437,826,462.69	84.80
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	621,783,059.06	120.43

**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	092280069	22华夏银行二级资本债01	400,000	42,194,928.96	8.17
2	102281543	22粤珠江MTN004	400,000	41,851,278.69	8.11
3	102381697	23光大水务MTN002	400,000	41,768,852.46	8.09
4	2228041	22农业银行二级01	400,000	41,550,246.58	8.05
5	102380968	23中建七局MT	400,000	40,941,994.52	7.93

		N001			
--	--	------	--	--	--

**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**  
本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

### 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，华夏银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚。中国农业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局处罚。广州农村商业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其他主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2** 本报告期内，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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	300,000.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	300,000.00

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	510,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	510,000,000.00

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**

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.96

**§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.96%	10,000,000.00	1.96%	3年
基金管理人高	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

级管理人员					
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	1.96%	10,000,000.00	1.96%	3年

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20240401-20240630	500,000,000.00	0.00	0.00	500,000,000.00	98.04%
产品特有风险							
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。							

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中加安盈一年定期开放债券型发起式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

### 10.2 存放地点

基金管理人处

### 10.3 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

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

2024年07月18日