

# 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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2021年01月01日起至2021年06月30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                         | 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                         | 7  |
| 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合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 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             | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                       | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表                      | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| §7 投资组合报告                               | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 46 |
| 7.3 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       | 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      | 47 |
| 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   | 48 |
| 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      | 48 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 48 |
| 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基金的情况                | 50 |

|   |    |
|---|----|
| 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.....   | 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.....                   | 51 |
| 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.....   | 51 |
| 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 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 52 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 52 |
| 10.7 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 |
| 11.1 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..... | 54 |
| 11.2 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            | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 中加聚利纯债定开            |                |
| 基金主代码           | 006588              |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                |
| 基金合同生效日         | 2018年11月27日         |                |
| 基金管理人           | 中加基金管理有限公司          |                |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司        |                |
| 报告期末基金份额总额      | 721,734,760.20份     |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 中加聚利纯债定开A           | 中加聚利纯债定开C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 006588              | 006589         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 687,675,684.56份     | 34,059,075.64份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略 | <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，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。</p> |

|        |   |
|--------|---|
| 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。 |

### 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           | 中国工商银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名                   | 刘凌                 |
|         | 联系电话                 | 400-00-95526       |
|         | 电子邮箱                 | service@bobbns.com |
| 客户服务电话  | 400-00-95526         | 95588              |
| 传真      | 010-83197627         | 010-66105798       |
| 注册地址    | 北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室 | 北京市西城区复兴门内大街55号    |
| 办公地址    | 北京市西城区南纬路35号         | 北京市西城区复兴门内大街55号    |
| 邮政编码    | 100050               | 100140             |
| 法定代表人   | 夏英                   | 陈四清                |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》        |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.bobbns.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人、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

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2021年01月01日-2021年06月30日) |               |
|---------------|----------------------------------|---------------|
|               | 中加聚利纯债定开A                        | 中加聚利纯债定开C     |
| 本期已实现收益       | 11,363,292.66                    | 607,503.26    |
| 本期利润          | 8,010,506.10                     | 376,781.61    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0107                           | 0.0077        |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.04%                            | 0.76%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.07%                            | 0.89%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2021年06月30日)            |               |
| 期末可供分配利润      | 25,820,745.01                    | 985,905.12    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0375                           | 0.0289        |
| 期末基金资产净值      | 713,496,429.57                   | 35,044,980.76 |
| 期末基金份额净值      | 1.0375                           | 1.0289        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2021年06月30日)            |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 11.78%                           | 10.78%        |

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

中加聚利纯债定开A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | -0.07%       | 0.02%               | -0.04%             | 0.03%                     | -0.03% | -0.01% |
| 过去三个月          | 0.77%        | 0.04%               | 0.45%              | 0.03%                     | 0.32%  | 0.01%  |
| 过去六个月          | 1.07%        | 0.04%               | 0.65%              | 0.04%                     | 0.42%  | 0.00%  |
| 过去一年           | 0.79%        | 0.06%               | -0.20%             | 0.06%                     | 0.99%  | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.78%       | 0.09%               | 2.68%              | 0.07%                     | 9.10%  | 0.02%  |

## 中加聚利纯债定开C

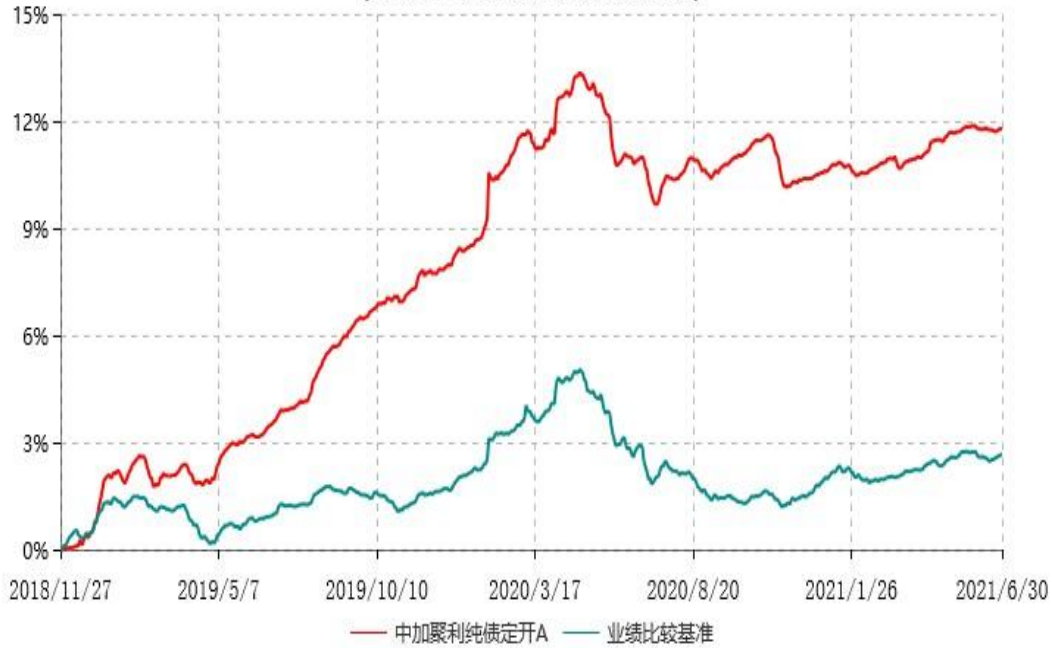
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | -0.10%       | 0.02%               | -0.04%             | 0.03%                     | -0.06% | -0.01% |
| 过去三个月          | 0.68%        | 0.04%               | 0.45%              | 0.03%                     | 0.23%  | 0.01%  |
| 过去六个月          | 0.89%        | 0.04%               | 0.65%              | 0.04%                     | 0.24%  | 0.00%  |
| 过去一年           | 0.44%        | 0.06%               | -0.20%             | 0.06%                     | 0.64%  | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 10.78%       | 0.09%               | 2.68%              | 0.07%                     | 8.10%  | 0.02%  |

### 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



中加聚利纯债定开A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月27日-2021年06月30日)



中加聚利纯债定开C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月27日-2021年06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基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理五十七只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加核心智造混合型证券投资基金（A/C）、中加优势企业混合型证券投资基金（A/C）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金（A/C）、中加中证500指数增强型证券投资基金（A/C）、中加科享混合型证券投资基金（A/C）、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、

中加科鑫混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）。

#### 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 |        |   |
| 袁素 | 本基金基金经理 | 2020-10-23      | -    | 10     | 袁素女士，复旦大学经济学学士，北京大学西方经济学硕士。2011年至2020年，曾先后任安信证券固定收益部研究员、投资助理；民生加银基金专户理财部投资助理、投资经理。2020年加入中加基金管理有限公司，现任中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金（2020年10月16日至今）、中加博裕纯债债券型证券投资基金（2020年10月23日至今）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（2020年10月23日至今）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（2020年10月23日至今）、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金（2020年11月30日至今）、中加民丰纯债债券型证券投资基金（2020年11月30日至今）、中加聚鑫纯债一年定期开 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 放债券型证券投资基金（2020年12月14日至今）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金（2021年2月23日至今）、中加中债1-5年国开行债券指数证券投资基金（2021年6月25日至今）的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

- 1、任职日期说明：袁素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

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 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，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 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

上半年，债券市场收益率总体在震荡中下行。1月份上半月，资金面整体延续了去年年末以来的宽松局面，配置需求推动债券收益率普遍下行。下半月，集中缴税之后资金面收紧，而央行逆回购投放较少，叠加当月财政存款投放时间较晚，资金利率急剧上升，带动债券收益率整体平坦化上行，信用利差有所走阔。2月份，资金面重归平稳，而同时大宗商品供给短期收缩，海外通胀预期上升，美债收益率上行，市场密切关注海外经济刺激政策和宽松货币政策的退出时点，国内长端债券受到压制。3月份开始，债券市场收益率总体震荡下行。地方债发行节奏较往年后置，部分企业信用债发行规模下降，债券供需相对错配。同时，财政投放促使银行间资金面持续处于相对宽松的水平，资金利率整体围绕政策利率波动。两者共同作用下，债券配置需求保持相对旺盛。市场对于通胀的观点也在变化。由于基数和疫情因素，PPI持续冲高，但国内决策层和美联储均表态判断通胀是短期因素；受食品分项影响，CPI保持在了较低的水平。因此，市场对于通胀是否会导致国内货币政策收紧的担忧缓解。到6月份，地方债发行和基建投资后置给三季度可能带来的压力和对海外在疫苗推广后经济复苏进度的猜想均在一定程度上对于市场形成了扰动，但总体来说，短期的基本面平稳、货币政策稳定以及流动性整体合理充裕对于市场还是形成了较强的支撑。从半年维度来看，1年期国债收益率下行4bp至2.43%，10年期国债收益率下行6bp至3.08%。

报告期内，我们根据市场变化灵活调整仓位。考虑到市场仍处于震荡行情，资金面相对平稳，保持了较积极的杠杆水平，灵活调整组合久期，充分获取了套息收益和信用利差压缩收益。在债券的品种选择方面，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和产业龙头为主。同时，以这些信用债作为底仓，积极捕捉利率债波段交易机会，赚取价差收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加聚利纯债定开A基金份额净值为1.0375元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.07%，同期业绩比较基准收益率为0.65%；截至报告期末中加聚利纯债定开C基金份额净值为1.0289元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.89%，同期业绩比较基准收益率为0.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，基本面有一定的结构性压力，数据上出现了边际放缓的迹象。疫情有不确定性，也给全球经济的复苏增加了变数。央行货币政策态度总体温和，降准操作更是

进一步强化了市场对于流动性保持相对宽松的预期。密切关注稳增长的政策措施，以及货币政策的进一步走向。

#### 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。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、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（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），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。公司分管风险管理业务的副总经理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、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），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，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、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；

3、本基金每份基金份额享有同等分配权；

4、基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

5、投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7、截至2021年6月30日，本基金在本报告期内利润分配合计1,042,624.54元。

#### 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

本报告期内，本基金托管人对中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金的管理人--中加基金管理有限公司在中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中加基金管理有限公司编制和披露的中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 3,325,048.55       | 5,881,213.00        |
| 结算备付金      |         | 8,644,720.36       | 19,848,321.68       |
| 存出保证金      |         | 1,009,806.25       | 2,368,510.64        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 934,957,600.00     | 1,172,083,338.40    |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 债券投资            |            | 934,957,600.00             | 1,172,083,338.40            |
| 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    | 19,437,513.42              | 23,298,130.63               |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 967,374,688.58             | 1,223,479,514.35            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2020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          | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 218,074,469.89             | 248,927,315.11              |
| 应付证券清算款         |            | 3,241.09                   | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 307,626.22                 | 411,603.30                  |
| 应付托管费           |            | 92,287.84                  | 123,480.96                  |
| 应付销售服务费         |            | 10,083.05                  | 23,947.37                   |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 29,786.16                  | 41,238.04                   |
| 应交税费            |            | 98,491.92                  | 160,681.88                  |
| 应付利息            |            | 113,725.01                 | 199,553.05                  |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 103,567.07                 | 89,000.00                   |



|               |          |                |                  |
|---------------|----------|----------------|------------------|
| 负债合计          |          | 218,833,278.25 | 249,976,819.71   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 721,734,760.20 | 947,864,678.70   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 26,806,650.13  | 25,638,015.94    |
| 所有者权益合计       |          | 748,541,410.33 | 973,502,694.64   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 967,374,688.58 | 1,223,479,514.35 |

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额721,734,760.20份。中加聚利纯债A基金份额净值为1.0375元，基金份额总额687,675,684.56份；中加聚利纯债C基金份额净值为1.0289元，基金份额总额34,059,075.64份。

## 6.2 利润表

会计主体：中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202<br>0年06月30日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、收入</b>      |          | 14,312,974.45                     | 45,510,437.61                          |
| 1.利息收入           |          | 22,292,882.50                     | 62,082,064.67                          |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11 | 48,969.99                         | 311,516.32                             |
| 债券利息收入           |          | 21,753,559.38                     | 60,618,841.06                          |
| 资产支持证券利息收入       |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收入       |          | 490,353.13                        | 1,151,707.29                           |
| 证券出借利息收入         |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -4,396,448.96                     | -13,297,002.05                         |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益           |          | -                                 | -                                      |

|                                 |            |               |               |
|---------------------------------|------------|---------------|---------------|
| 债券投资收益                          | 6.4.7.13   | -3,785,445.39 | -7,338,874.87 |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.13.3 | -             | -             |
| 贵金属投资收益                         |            | -             | -             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.14   | -611,003.57   | -5,958,127.18 |
| 股利收益                            | 6.4.7.15   | -             | -             |
| 3.公允价值变动收益(损失<br>以“-”号填列)       | 6.4.7.16   | -3,583,508.21 | -3,276,169.86 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号<br>填列)           |            | -             | -             |
| 5.其他收入(损失以“-”号<br>填列)           | 6.4.7.17   | 49.12         | 1,544.85      |
| <b>减：二、费用</b>                   |            | 5,925,686.74  | 14,692,002.24 |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 2,050,187.71  | 6,331,647.38  |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 615,056.30    | 1,899,494.20  |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 88,171.76     | 434,913.27    |
| 4. 交易费用                         | 6.4.7.18   | 24,230.74     | 119,251.61    |
| 5. 利息支出                         |            | 2,959,281.41  | 5,615,045.77  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | 2,959,281.41  | 5,615,045.77  |
| 6. 税金及附加                        |            | 62,577.55     | 154,342.13    |
| 7. 其他费用                         | 6.4.7.19   | 126,181.27    | 137,307.88    |
| <b>三、利润总额(亏损总额<br/>以“-”号填列)</b> |            | 8,387,287.71  | 30,818,435.37 |
| 减：所得税费用                         |            | -             | -             |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”<br/>号填列)</b>   |            | 8,387,287.71  | 30,818,435.37 |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021年01月01日至2021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<br>(基金净值)                    | 947,864,678.70                     | 25,638,015.94  | 973,502,694.64   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                  | 8,387,287.71   | 8,387,287.71     |
| 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)      | -226,129,918.50                    | -6,176,028.98  | -232,305,947.48  |
| 其中：1.基金申购款                             | 291,827,175.70                     | 8,287,627.24   | 300,114,802.94   |
| 2.基金赎回款                                | -517,957,094.20                    | -14,463,656.22 | -532,420,750.42  |
| 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) | -                                  | -1,042,624.54  | -1,042,624.54    |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 721,734,760.20                     | 26,806,650.13  | 748,541,410.33   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020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<br>(基金净值)                    | 1,596,333,050.52                   | 91,808,737.64  | 1,688,141,788.16 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                  | 30,818,435.37  | 30,818,435.37    |
| 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)      | 1,313,923,897.67                   | 50,853,414.46  | 1,364,777,312.13 |

|  |                  |                |                  |
|--|------------------|----------------|------------------|
| 其中：1.基金申购款                             | 1,580,093,323.63 | 61,033,719.12  | 1,641,127,042.75 |
| 2.基金赎回款                                | -266,169,425.96  | -10,180,304.66 | -276,349,730.62  |
| 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） | -                | -79,816,625.78 | -79,816,625.78   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,910,256,948.19 | 93,663,961.69  | 3,003,920,909.88 |

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

中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金(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")于2018年8月21日证监许可[2018]1355号《关于准予中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《中加聚利纯债定期开放债券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管理有限公司,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"工商银行")。

本基金通过中加基金的直销中心公开发售,募集期为2018年11月12日起至2018年11月26日。本基金于2018年11月27日成立,成立之日基金实收份额为293,878,019.98份(含利息转份额28,315.52份),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。

根据经中国证监会备案的《中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时,收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,

本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、同业存单、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)、国债期货等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)。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2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务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况、2021年半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **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所采用的会计政策、会计估计相一致。

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度自公历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2021年1月1日至2021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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金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；

(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值

(2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 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。

#### **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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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**

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(未弥补亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，合同利率与实际利率法确定的收入差异较小的可采用合同利率。

公允价值变动损益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### 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。

本基金的交易费用于进行债券交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策



本基金每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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；基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 外币交易**

无。

#### **6.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司提供。

根据《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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### **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**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### **6.4.6 税项**

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务规定，本基金适用的主要税项列示如下：

#### 1. 企业所得税

(1)自2014年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

(2)对证券投资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。

#### 2. 个人所得税

自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 3. 增值税

(1)经国务院批准，自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，金融业全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。本基金适用不征增值税项目：存款利息收入。本基金适用免征增值税项目：①国债、地方政府债利息收入；②证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的金融商品转让收入；③金融同业往来利息收入。

(2)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

(3)自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外；管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(4)增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按5%、3%和2%的比例缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末          |  |
|--------------|--------------|--|
|              | 2021年06月30日  |  |
| 活期存款         | 3,325,048.55 |  |
| 定期存款         | -            |  |
| 其中：存款期限1个月以内 | -            |  |
| 存款期限1-3个月    | -            |  |
| 存款期限3个月以上    | -            |  |
| 其他存款         | -            |  |
| 合计           | 3,325,048.55 |  |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末            |                |                |                |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|               | 2021年06月30日    |                |                |                |
|               | 成本             | 公允价值           | 公允价值变动         |                |
| 股票            | -              | -              | -              |                |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -              | -              | -              |                |
| 债券            | 交易所市场          | 148,459,456.97 | 147,459,000.00 | -1,000,456.97  |
|               | 银行间市场          | 799,543,480.47 | 787,498,600.00 | -12,044,880.47 |
|               | 合计             | 948,002,937.44 | 934,957,600.00 | -13,045,337.44 |
| 资产支持证券        | -              | -              | -              |                |
| 基金            | -              | -              | -              |                |
| 其他            | -              | -              | -              |                |
| 合计            | 948,002,937.44 | 934,957,600.00 | -13,045,337.44 |                |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2021年06月30日 |      |    |    |
|--------|--------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义金额            | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                    | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                  | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具 | -                  | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具 | 48,905,975.00      | -    | -  | -  |
| --国债期货 | 48,905,975.00      | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                  | -    | -  | -  |
| 合计     | 48,905,975.00      | -    | -  | -  |

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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<br>2021年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 498.90             |
| 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  | 695.30             |
| 应收债券利息     | 19,436,307.72      |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 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 | -                  |
| 应收出借证券利息   | -                  |

|    |               |
|----|---------------|
| 其他 | 11.50         |
| 合计 | 19,437,513.42 |

注：其他为应收存出保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产（其他应收款和待摊费用）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  |
| 银行间市场应付交易费用 | 29,786.16          |
| 合计          | 29,786.16          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 预提费用        | 103,567.07         |
| 合计          | 103,567.07         |

注：预提费用包括预提信息披露费、预提审计费和预提账户维护费。

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 中加聚利纯债定开A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(中加聚利纯债定开A) | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                |
|-------------------|-------------------------------|----------------|
|                   | 基金份额(份)                       | 账面金额           |
| 上年度末              | 868,615,972.18                | 868,615,972.18 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购          | 291,791,051.03  | 291,791,051.03  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -472,731,338.65 | -472,731,338.65 |
| 本期末           | 687,675,684.56  | 687,675,684.56  |

#### 6.4.7.9.2 中加聚利纯债定开C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(中加聚利纯债定开C) | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                |
|-------------------|-------------------------------|----------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末              | 79,248,706.52                 | 79,248,706.52  |
| 本期申购              | 36,124.67                     | 36,124.67      |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -45,225,755.55                | -45,225,755.55 |
| 本期末               | 34,059,075.64                 | 34,059,075.64  |

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 中加聚利纯债定开A

单位：人民币元

| 项目<br>(中加聚利纯债定开A) | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|-------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末              | 21,797,385.69  | 2,187,606.61  | 23,984,992.30  |
| 本期利润              | 11,363,292.66  | -3,352,786.56 | 8,010,506.10   |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | -5,078,595.87  | -140,700.75   | -5,219,296.62  |
| 其中：基金申购款          | 8,090,821.49   | 196,050.05    | 8,286,871.54   |
| 基金赎回款             | -13,169,417.36 | -336,750.80   | -13,506,168.16 |
| 本期已分配利润           | -955,456.77    | -             | -955,456.77    |
| 本期末               | 27,126,625.71  | -1,305,880.70 | 25,820,745.01  |

##### 6.4.7.10.2 中加聚利纯债定开C

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 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |              |             |              |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| (中加聚利纯债定开C)    |              |             |              |
| 上年度末           | 1,447,397.70 | 205,625.94  | 1,653,023.64 |
| 本期利润           | 607,503.26   | -230,721.65 | 376,781.61   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -920,863.78  | -35,868.58  | -956,732.36  |
| 其中：基金申购款       | 730.05       | 25.65       | 755.70       |
| 基金赎回款          | -921,593.83  | -35,894.23  | -957,488.06  |
| 本期已分配利润        | -87,167.77   | -           | -87,167.77   |
| 本期末            | 1,046,869.41 | -60,964.29  | 985,905.12   |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      |
|-----------|-------------------------|
|           | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 活期存款利息收入  | 21,879.59               |
| 定期存款利息收入  | -                       |
| 其他存款利息收入  | -                       |
| 结算备付金利息收入 | 20,865.09               |
| 其他        | 6,225.31                |
| 合计        | 48,969.99               |

注：其他为存出保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                      |
|-------------------------------|-------------------------|
|                               | 2021年01月01日至2021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 | -3,785,445.39           |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 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             | -3,785,445.39 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                      |
|-------------------------|-------------------------|
|                         | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,843,285,708.45        |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,816,697,219.01        |
| 减：应收利息总额                | 30,373,934.83           |
| 买卖债券差价收入                | -3,785,445.39           |

注：本基金本报告期内无债转股业务。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资赎回差价收入

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资申购差价收入

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 |
|----|--------|
|----|--------|



|      | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|------|-------------------------|
| 期货投资 | -611,003.57             |

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 1.交易性金融资产              | -3,549,911.78           |
| ——股票投资                 | -                       |
| ——债券投资                 | -3,549,911.78           |
| ——资产支持证券投资             | -                       |
| ——贵金属投资                | -                       |
| ——其他                   | -                       |
| 2.衍生工具                 | -33,596.43              |
| ——权证投资                 | -                       |
| ——期货投资                 | -33,596.43              |
| 3.其他                   | -                       |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                       |
| 合计                     | -3,583,508.21           |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | -                       |
| 转换费收入   | 49.12                   |
| 合计      | 49.12                   |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,452.24                      |
| 银行间市场交易费用 | 19,577.50                     |
| 期货市场交易费用  | 3,201.00                      |
| 合计        | 24,230.74                     |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------|-------------------------------|
| 审计费用     | 35,059.70                     |
| 信息披露费    | 59,507.37                     |
| 证券出借违约金  | -                             |
| 汇划手续费    | 13,314.20                     |
| 上清所账户维护费 | 9,300.00                      |
| 中债登账户维护费 | 9,000.00                      |
| 合计       | 126,181.27                    |

**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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

中加聚利纯债A于2021年7月2日向份额持有人分配利润756,432.82元，其中以现金形式发放总额为747,896.68元，以分红再投形式发放总额为8,536.14元。该笔分红权益登记日为2021年7月1日，除息日为2021年7月1日，每10份基金份额分红金额为0.011元。

中加聚利纯债C于2021年7月2日向份额持有人分配利润37,461.89元，其中以现金形式发放总额为35,845.99元，以分红再投形式发放总额为1,615.9元。该笔分红权益登记日为2021年7月1日，除息日为2021年7月1日，每10份基金份额分红金额为0.011元。

截至本财务报告批准报出日，除以上事项外，本基金没有需要在财务报表附注中说明的其他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

本报告期内关联方关系未发生变化。

### 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人               |
| 北京银行股份有限公司   | 基金管理人股东、基金销售机构      |

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

## 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

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至202 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202 |
|----|-----------------------|----------------------------|
|    |                       |                            |

|                 | 1年06月30日     | 0年06月30日     |
|-----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,050,187.71 | 6,331,647.38 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 323,618.56   | 1,493,481.65 |

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年01月01日至2021<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 615,056.30                        | 1,899,494.20                           |

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日      |           |           |
|----------------------------|------------------------------------|-----------|-----------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |           |           |
|                            | 中加聚利纯债定开A                          | 中加聚利纯债定开C | 合计        |
| 中加基金<br>管理有限<br>公司         | 0.00                               | 550.78    | 550.78    |
| 北京银行<br>股份有限<br>公司         | 0.00                               | 72,134.03 | 72,134.03 |
| 合计                         | 0.00                               | 72,684.81 | 72,684.81 |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方       | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |           |           |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |           |           |

| 名称         | 中加聚利纯债定开A | 中加聚利纯债定开C  | 合计         |
|------------|-----------|------------|------------|
| 中加基金管理有限公司 | 0.00      | 6,639.11   | 6,639.11   |
| 北京银行股份有限公司 | 0.00      | 324,241.11 | 324,241.11 |
| 合计         | 0.00      | 330,880.22 | 330,880.22 |

注：本基金仅针对C类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金日基金销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.35%/当年天数。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020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    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 3,325,048.55                  | 21,879.59 | 7,683,159.60                       | 80,412.82 |

注：本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2021年6月30日的相关余额合计为人民币9,654,526.61元（2020年6月30日：人民币49,663,635.72元）。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

中加聚利纯债定开A

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日      | 除息日            | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额     | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计     | 备注 |
|----|----------------|----------------|-----------------|------------------|---------------|------------------|----|
| 1  | 2021-0<br>2-25 | 2021-02-2<br>5 | 0.011           | 927,578.9<br>4   | 27,877.83     | 955,456.7<br>7   | -  |
| 合计 |                |                | 0.011           | 1,675,47<br>5.62 | 36,413.97     | 1,711,88<br>9.59 | -  |

中加聚利纯债定开C

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日      | 除息日            | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计   | 备注 |
|----|----------------|----------------|-----------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 1  | 2021-0<br>2-25 | 2021-02-2<br>5 | 0.011           | 81,887.40      | 5,280.37      | 87,167.77      | -  |
| 合计 |                |                | 0.011           | 117,733.3<br>9 | 6,896.27      | 124,629.6<br>6 | -  |

#### 6.4.12 期末（2021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。

### 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

截至本报告期末2021年6月30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款余额140,074,469.89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         |
|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 210202 | 21国开02 | 2021-07-01 | 100.09 | 500,000   | 50,045,000.00  |
| 210205 | 21国开05 | 2021-07-06 | 101.25 | 485,000   | 49,106,250.00  |
| 210210 | 21国开10 | 2021-07-01 | 99.36  | 500,000   | 49,680,000.00  |
| 合计     |        |            |        | 1,485,000 | 148,831,250.00 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，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78,000,000.00元，于2021年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

### 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

本基金为债券型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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方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，将风险控制可在可承受范围内。

#### 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工商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<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 70,301,000.00      | 150,280,000.00      |
| 合计     | 70,301,000.00      | 150,280,000.00      |

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 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<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 337,815,600.00     | 404,890,300.00      |
| AAA以下  | 376,491,000.00     | 493,569,000.00      |
| 未评级    | 150,350,000.00     | 123,344,038.40      |
| 合计     | 864,656,600.00     | 1,021,803,338.40    |

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央票。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款的风险。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。

本基金为纯债型证券投资基金，投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、同业存单、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、国债期货等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）。期末除前文披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。

于2021年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有218,074,469.89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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金的流动性风险管理，按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流

动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年06<br>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                   | 3,325,048.55   | -              | -              | -             | 3,325,048.55   |
| 结算备付金                  | 1,545,027.46   | -              | -              | 7,099,692.90  | 8,644,720.36   |
| 存出保证金                  | 25,506.25      | -              | -              | 984,300.00    | 1,009,806.25   |
| 交易性金融资产                | 317,028,600.00 | 517,624,000.00 | 100,305,000.00 | -             | 934,957,600.00 |
| 应收利息                   | -              | -              | -              | 19,437,513.42 | 19,437,513.42  |
| 资产总计                   | 321,924,182.26 | 517,624,000.00 | 100,305,000.00 | 27,521,506.32 | 967,374,688.58 |
| 负债                     |                |                |                |               |                |
| 卖出回购金融资产款              | 218,074,469.89 | -              | -              | -             | 218,074,469.89 |
| 应付证券清算款                | -              | -              | -              | 3,241.09      | 3,241.09       |
| 应付管理人报酬                | -              | -              | -              | 307,626.22    | 307,626.22     |
| 应付托管费                  | -              | -              | -              | 92,287.84     | 92,287.84      |
| 应付销售服务费                | -              | -              | -              | 10,083.05     | 10,083.05      |
| 应付交易费用                 | -              | -              | -              | 29,786.16     | 29,786.16      |
| 应交税费                   | -              | -              | -              | 98,491.92     | 98,491.92      |
| 应付利息                   | -              | -              | -              | 113,725.01    | 113,725.01     |

|                         |                |                |                |               |                  |
|-------------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 预提费用                    | -              | -              | -              | 103,567.07    | 103,567.07       |
| 负债总计                    | 218,074,469.89 | -              | -              | 758,808.36    | 218,833,278.25   |
| 利率敏感度缺口                 | 103,849,712.37 | 517,624,000.00 | 100,305,000.00 | 26,762,697.96 | 748,541,410.33   |
| 上年度末<br>2020年12<br>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                    | 5,881,213.00   | -              | -              | -             | 5,881,213.00     |
| 结算备付金                   | 9,467,687.78   | -              | -              | 10,380,633.90 | 19,848,321.68    |
| 存出保证金                   | 17,350.64      | -              | -              | 2,351,160.00  | 2,368,510.64     |
| 交易性金融资产                 | 249,095,338.40 | 872,308,000.00 | 50,680,000.00  | -             | 1,172,083,338.40 |
| 应收利息                    | -              | -              | -              | 23,298,130.63 | 23,298,130.63    |
| 资产总计                    | 264,461,589.82 | 872,308,000.00 | 50,680,000.00  | 36,029,924.53 | 1,223,479,514.35 |
| 负债                      |                |                |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款               | 248,927,315.11 | -              | -              | -             | 248,927,315.11   |
| 应付管理人报酬                 | -              | -              | -              | 411,603.30    | 411,603.30       |
| 应付托管费                   | -              | -              | -              | 123,480.96    | 123,480.96       |
| 应付销售服务费                 | -              | -              | -              | 23,947.37     | 23,947.37        |
| 应付交易费用                  | -              | -              | -              | 41,238.04     | 41,238.04        |
| 应交税费                    | -              | -              | -              | 160,681.88    | 160,681.88       |
| 应付利息                    | -              | -              | -              | 199,553.05    | 199,553.05       |
| 预提费用                    | -              | -              | -              | 89,000.00     | 89,000.00        |
| 负债总计                    | 248,927,315.11 | -              | -              | 1,049,504.60  | 249,976,819.71   |
| 利率敏感度缺口                 | 15,534,274.71  | 872,308,000.00 | 50,680,000.00  | 34,980,419.93 | 973,502,694.64   |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 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<br>2021年06月30日          | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点 | 4,417,674.66                | 5,831,114.61        |

|  |             |               |               |
|--|-------------|---------------|---------------|
|  | 市场利率上升25个基点 | -4,417,674.66 | -5,831,114.61 |
|--|-------------|---------------|---------------|

#### 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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。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。

于2021年6月30日，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年06月30日 |                          | 上年度末<br>2020年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—债券投资  | 934,957,600.00     | 124.90                   | 1,172,083,338.40    | 120.40                   |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 衍生金融资产        | -                  | -                        | -                   | -                        |

|       |                |        |                  |        |
|-------|----------------|--------|------------------|--------|
| 一权证投资 |                |        |                  |        |
| 其他    | -              | -      | -                | -      |
| 合计    | 934,957,600.00 | 124.90 | 1,172,083,338.40 | 120.40 |

#### 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) 以公允价值计量的金融工具

##### (a) 以公允价值计量的资产和负债

以下描述了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年6月30日，本基金持有的持续的公允价值计量资产中属于第二层次的债券投资余额为934,957,600.00元，无属于第一层次和第三层次债券投资余额。于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的资产的三个层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

##### (b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### (2) 其他金融工具的公允价值(报告期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、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。

## §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              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 934,957,600.00 | 96.65        |
|    | 其中：债券             | 934,957,600.00 | 96.65        |
|    | 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      | 11,969,768.91  | 1.24         |
| 8  | 其他各项资产            | 20,447,319.67  | 2.11         |
| 9  | 合计                | 967,374,688.58 | 100.00       |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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。

### 7.2.2 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。

## 7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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      | 150,350,000.00 | 20.09        |
|    | 其中：政策性金融债 | 150,350,000.00 | 20.09        |
| 4  | 企业债券      | 163,889,000.00 | 21.89        |
| 5  | 企业短期融资券   | 70,301,000.00  | 9.39         |
| 6  | 中期票据      | 550,417,600.00 | 73.53        |
| 7  | 可转债(可交换债) | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 934,957,600.00 | 124.90       |

#### 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  | 210205    | 21国开05        | 500,000 | 50,625,000.00 | 6.76         |
| 2  | 101900934 | 19哈尔滨投MT N002 | 500,000 | 50,115,000.00 | 6.70         |

|   |        |        |         |               |      |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 3 | 210202 | 21国开02 | 500,000 | 50,045,000.00 | 6.69 |
| 4 | 136685 | 16海投债  | 500,000 | 50,010,000.00 | 6.68 |
| 5 | 210210 | 21国开10 | 500,000 | 49,680,000.00 | 6.64 |

**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 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。

**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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 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。

**7.11.2 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      |
|-------------------|-------|----------|----------------|-------------|-------------|
| T2109             | T2109 | -50      | -49,215,000.00 | -309,025.00 | -           |
| 公允价值变动总额合计(元)     |       |          |                |             | -309,025.00 |
| 国债期货投资本期收益(元)     |       |          |                |             | -611,003.57 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) |       |          |                |             | -33,596.43  |



### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 本报告期内，本基金未投资于股票，相应的不存在投资的前十名股票超过基金合同规定的备选股票库的情况。

### 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   | 1,009,806.25  |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 19,437,513.42 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 20,447,319.67 |

### 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

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

### 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  |
| 中加聚利纯债定开A | 1,945    | 353,560.76 | 458,373,427.71 | 66.66% | 229,302,256.85 | 33.34%  |
| 中加聚利纯债定开C | 698      | 48,795.24  | 0.00           | 0.00%  | 34,059,075.64  | 100.00% |
| 合计        | 2,643    | 273,074.07 | 458,373,427.71 | 63.51% | 263,361,332.49 | 36.49%  |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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基金 | 中加聚利纯债定开A | 36,878.25  | 0.01%    |
|                  | 中加聚利纯债定开C | 246,114.40 | 0.72%    |
|                  | 合计        | 282,992.65 | 0.04%    |

### 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<br>研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 中加聚利纯债定开<br>A | -     |
|  | 中加聚利纯债定开<br>C | 10~50 |
|  | 合计            | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 中加聚利纯债定开<br>A | -     |
|  | 中加聚利纯债定开<br>C | -     |
|  | 合计            | -     |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 中加聚利纯债定开A      | 中加聚利纯债定开C     |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日(2018年11月27<br>日)基金份额总额 | 276,161,272.19 | 17,716,747.79 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 868,615,972.18 | 79,248,706.52 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 291,791,051.03 | 36,124.67     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 472,731,338.65 | 45,225,755.55 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 687,675,684.56 | 34,059,075.64 |

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。

## §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，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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：无。

基金托管人本报告期内人事变动情况：中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托

管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立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稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 方正证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

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,由监察稽核门部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。

### 10.7.2 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 |              | 基金交易 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 方正证券 | 630,590,469.67 | 100.00%      | 3,094,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 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  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金2020年第四季度报告    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-01-21 |
| 2  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金分红公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-02-24 |
| 3  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换业务公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-02-26 |
| 4  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金2020年年度报告      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-03-30 |
| 5  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金2021年第一季度报告    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-21 |
| 6  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金托管协议           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-02 |
| 7  | 中加聚利纯债定期开放债券                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-02 |

|    |                                     |              |            |
|----|-------------------------------------|--------------|------------|
|    | 型证券投资基金基金合同                         |              |            |
| 8  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-07 |
| 9  | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书(更新)        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-07 |
| 10 | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金分红公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-30 |
| 11 | 中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换业务公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-30 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 20210308-20210630      | 0.00 | 145,856,670.56 | 0.00       | 145,856,670.56 | 20.21% |
|  | 2              | 20210308-20210630      | 0.00 | 145,856,670.56 | 0.00       | 145,856,670.56 | 20.21% |
| 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。 |                |                        |      |                |            |                |        |

### 11.2 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聚利纯债定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加聚利纯债定期开放债券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

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 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55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  
二〇二一年八月二十七日