

# 中加紫金灵活配置混合型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月26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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中加紫金混合
基金主代码	005373
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月04日
报告期末基金份额总额	334,654,660.98份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过对行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入研究，选择出质地优秀、成长性良好的公司进行投资，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×40%+恒生指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中加紫金混合A	中加紫金混合C
下属分级基金的交易代码	005373	005374
报告期末下属分级基金的份额总额	187,463,047.01份	147,191,613.97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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	中加紫金混合A	中加紫金混合C
1. 本期已实现收益	16,239,027.46	5,272,135.00
2. 本期利润	629,297.27	-258,450.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0024	-0.0022
4. 期末基金资产净值	253,170,331.51	196,231,603.54
5. 期末基金份额净值	1.3505	1.3332

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

中加紫金混合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	0.02%	0.36%	-5.74%	0.81%	5.76%	-0.45%
过去六个月	3.68%	0.31%	-3.12%	0.70%	6.80%	-0.39%

过去一年	10.43%	0.37%	6.71%	0.75%	3.72%	-0.38%
过去三年	56.67%	1.17%	18.18%	0.84%	38.49%	0.33%
自基金合同生效起至今	35.05%	1.16%	10.07%	0.83%	24.98%	0.33%

## 中加紫金混合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	-0.05%	0.35%	-5.74%	0.81%	5.69%	-0.46%
过去六个月	3.53%	0.31%	-3.12%	0.70%	6.65%	-0.39%
过去一年	9.89%	0.37%	6.71%	0.75%	3.18%	-0.38%
过去三年	54.93%	1.17%	18.18%	0.84%	36.75%	0.33%
自基金合同生效起至今	33.32%	1.16%	10.07%	0.83%	23.25%	0.33%

## 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

中加紫金混合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04月04日-2021年09月30日)



中加紫金混合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04月04日-2021年09月30日)



## § 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	说明
----	----	-------------	----	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
许飞虎	本基金基金经理	2018-05-08	-	10	许飞虎先生，中国人民大学统计学硕士，先后就职于华西证券、合众人寿资产管理公司，担任量化投资研究员、量化投资经理。2017年12月加入中加基金，任资产配置与基金投资部副总监，主管量化投资团队、量化策略研发和投资。2018年5月8日起任中加紫金灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

- 1、任职日期说明：基金经理的任职日期为根据公司决定确定的任职日期。
- 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

年初至今，A股市场持续在震荡和分化轮动中前行。截至9月底，以中证500和中证1000为代表的中盘成长板块涨幅居前，上证50、沪深300和中证100等偏大盘指数均收跌10%左右；行业方面，钢铁煤炭有色和化工等周期板块，以及新能源涨幅在40%以上，但非银、家电等下跌近20%。报告期内，中加紫金继续优选高景气、业绩持续增长、估值相对合理的标的组合，维持分散化配置，在分化震荡市中保持风格稳健。

宏观方面，8月CPI同比增0.80%，低于前值的1.00%，PPI同比增速继续上升至9.50%，超过预期和前值的9.00%，二者剪刀差扩大至8.7%；8月社融增量2.96万亿，同比少增6295亿，新增贷款1.22万亿，同比少增631亿，M2同比增8.2%，环比上月低0.1%。总体来看，上游成本居高不下，货币和信用扩张增速放缓，有效融资需求转弱，但当前货币工具空间尚充裕，政策将相机而动，降准、再贴现及MLF等调节工具都有进一步发力空间。

市场方面，A股连续40余交易日超万亿成交，存量资金博弈加剧、换手率不断提高；资管新规过渡期收官，理财产品预期收益率下行，流动性也将持续外溢，市场流动性环境有望持续改善。

策略方面，市场板块轮动依然剧烈，宽幅震荡模式仍将延续，大小盘风格、传统蓝筹和成长赛道此消彼长，结构性行情仍将是短期主基调。中长期看，宏观经济有望触底，央行货币工具箱蓄势待发，整体盈利持续复苏也将继续带来强力支撑，性价比高的投资标的更受市场青睐。产品投资将继续精选业绩高增长，估值相对合理，成长逻辑能持续兑现的优质标的，持有风格均衡、分散化的投资组合。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加紫金混合A基金份额净值为1.3505元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.02%，同期业绩比较基准收益率为-5.74%；截至报告期末中加紫金混合C基金份额净值为1.3332元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.05%，同期业绩比较基准收益率为-5.74%。

#### 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(%)
1	权益投资	127,245,065.81	24.66
	其中：股票	127,245,065.81	24.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	343,558,000.00	66.57
	其中：债券	343,558,000.00	66.57
	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	31,500,000.00	6.10
	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	6,319,605.85	1.22
8	其他资产	7,452,457.45	1.44
9	合计	516,075,129.11	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	3,075,321.30	0.68
B	采矿业	734,080.00	0.16
C	制造业	83,076,592.11	18.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	340,370.00	0.08
E	建筑业	1,247,040.00	0.28
F	批发和零售业	513,730.08	0.11



G	交通运输、仓储和邮政业	3,134,683.20	0.70
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,927,667.25	1.10
J	金融业	16,971,613.20	3.78
K	房地产业	4,963,427.24	1.10
L	租赁和商务服务业	1,174,518.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	3,405,596.08	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	28,275.90	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	209,212.00	0.05
Q	卫生和社会工作	3,008,487.11	0.67
R	文化、体育和娱乐业	431,107.22	0.10
S	综合	-	-
	合计	127,245,065.81	28.31

### 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	300750	宁德时代	16,500	8,674,545.00	1.93
2	000858	五粮液	27,308	5,991,102.12	1.33
3	600036	招商银行	117,700	5,937,965.00	1.32
4	600519	贵州茅台	3,000	5,490,000.00	1.22
5	000333	美的集团	73,038	5,083,444.80	1.13
6	601318	中国平安	95,500	4,618,380.00	1.03
7	601012	隆基股份	53,560	4,417,628.80	0.98
8	603259	药明康德	22,180	3,389,104.00	0.75
9	002415	海康威视	60,000	3,300,000.00	0.73
10	002594	比亚迪	12,100	3,019,071.00	0.67

## 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	91,428,000.00	20.34
	其中：政策性金融债	91,428,000.00	20.34
4	企业债券	20,396,000.00	4.54
5	企业短期融资券	20,082,000.00	4.47
6	中期票据	211,652,000.00	47.10
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	343,558,000.00	76.45

## 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	210205	21国开05	300,000	30,882,000.00	6.87
2	210203	21国开03	300,000	30,402,000.00	6.76
3	190207	19国开07	300,000	30,144,000.00	6.71
4	102000981	20拉萨城投MTN001	300,000	29,952,000.00	6.66
5	1980335	19陕投债03	200,000	20,396,000.00	4.54

## 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	49,698.70
2	应收证券清算款	66,694.84
3	应收股利	-
4	应收利息	7,336,063.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,452,457.45

**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

	中加紫金混合A	中加紫金混合C
报告期期初基金份额总额	360,247,156.49	66,789,313.32
报告期期间基金总申购份额	37,179,091.10	97,472,261.21
减：报告期期间基金总赎回份额	209,963,200.58	17,069,960.56

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	187,463,047.01	147,191,613.97

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	20210714-20210930	80,711,855.13	0.00	0.00	80,711,855.13	24.12%
	2	20210927-20210927	0.00	59,925,093.63	0.00	59,925,093.63	17.91%
	3	20210701-20210907	209,274,399.82	0.00	209,274,399.82	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紫金灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加紫金灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加紫金灵活配置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：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

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10月26日