

---

中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金

2026年第2季度报告

2026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

报告送出日期:2026年07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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年7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2026年04月01日起至2026年06月30日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 中加聚盈定开债券                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金主代码      | 007061                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2019年05月29日                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 469,774,479.55份                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 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</p> |

|                 |                                               |                |
|-----------------|-----------------------------------------------|----------------|
|                 | 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           | 中国工商银行股份有限公司                                  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 中加聚盈定开债券A                                     | 中加聚盈定开债券C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 007061                                        | 007062         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 417,961,179.05份                               | 51,813,300.50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(2026年04月01日 - 2026年06月30日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 中加聚盈定开债券A                      | 中加聚盈定开债券C     |
| 1.本期已实现收益      | 2,852,595.58                   | 472,079.29    |
| 2.本期利润         | 5,723,466.96                   | 1,859,272.03  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0135                         | 0.0197        |
| 4.期末基金资产净值     | 440,052,790.68                 | 54,045,064.19 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0529                         | 1.0431        |

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

中加聚盈定开债券A净值表现

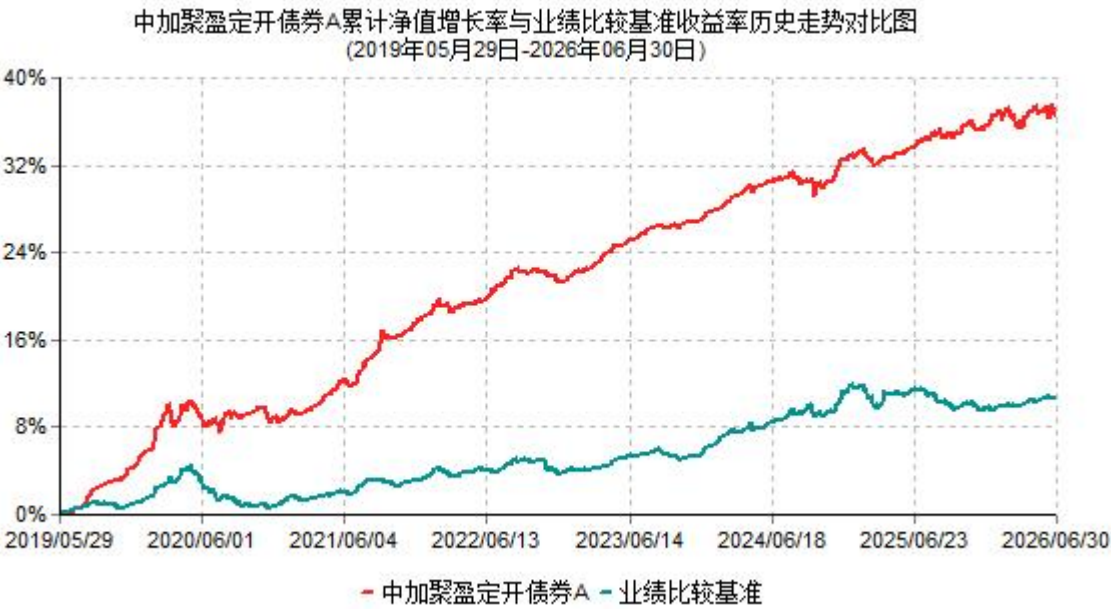
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|

|            |        |       |        | ④     |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.27%  | 0.19% | 0.62%  | 0.04% | 0.65%  | 0.15% |
| 过去六个月      | 1.07%  | 0.17% | 0.91%  | 0.04% | 0.16%  | 0.13% |
| 过去一年       | 2.44%  | 0.14% | -0.56% | 0.06% | 3.00%  | 0.08% |
| 过去三年       | 9.50%  | 0.10% | 5.12%  | 0.08% | 4.38%  | 0.02% |
| 过去五年       | 22.42% | 0.10% | 8.48%  | 0.07% | 13.94% | 0.03% |
| 过去七年       | 36.89% | 0.10% | 10.29% | 0.07% | 26.60% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.17% | 0.10% | 10.72% | 0.07% | 26.45% | 0.03% |

中加聚盈定开债券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      | 1.17%  | 0.19%     | 0.62%      | 0.04%         | 0.55%  | 0.15% |
| 过去六个月      | 0.87%  | 0.17%     | 0.91%      | 0.04%         | -0.04% | 0.13% |
| 过去一年       | 2.03%  | 0.14%     | -0.56%     | 0.06%         | 2.59%  | 0.08% |
| 过去三年       | 8.30%  | 0.10%     | 5.12%      | 0.08%         | 3.18%  | 0.02% |
| 过去五年       | 20.13% | 0.09%     | 8.48%      | 0.07%         | 11.65% | 0.02% |
| 过去七年       | 33.25% | 0.10%     | 10.29%     | 0.07%         | 22.96% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.49% | 0.10%     | 10.72%     | 0.07%         | 22.77% | 0.03% |

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<br>经理期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                       |
|-----|---------|-----------------|----------|----------------|--------------------------|
|     |         | 任职<br>日期        | 离任<br>日期 |                |                          |
| 邹天培 | 本基金基金经理 | 2024-04-03      | -        | 13             | 邹天培先生，北京大学法学学士、经济学学士，北京大 |

|    |         |            |   |   |                                                                                                                                           |
|----|---------|------------|---|---|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         |            |   |   | 学管理学硕士，香港大学金融学硕士。2012年7月至2021年7月，任职于嘉实基金管理有限公司，先后担任研究员、投资经理；2021年8月至2023年10月，任职于山东省国际信托股份有限公司，任投资经理、组合投资部总经理。2023年10月加入中加基金管理有限公司，现任基金经理。 |
| 白亮 | 本基金基金经理 | 2026-04-09 | - | 8 | 白亮先生，中国人民大学经济学学士。2017年6月加入中加基金管理有限公司交易部，先后任职资金交易员、债券交易员；2024年1月加入中加基金管理有限公司固定收益部，任绝对收益部投资经理，主要负责“固收+”资产投资，现任基金经理。                         |

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：无。

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。

4.2 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的规定及基金合同的约定。

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

二季度以来，可转债市场走势表现较为分化，一方面高价转债尤其是科技类转债表现亮眼，价格与溢价率随正股走势上升较快，成为产品净值贡献主力；另一方面双底转债及大盘均衡类转债表现持续被压制，溢价率进一步压缩，整体二季度来看可转债绝对价格中位数有所下降，转债市场仍处于震荡行情。纯债方面二季度银行体系资金整体充裕，非银机构面临“资产荒”。这推动了长端及超长端利率债收益率一路下行，信用利差被压缩至历史极低分位数，后期伴随外部地缘政治扰动以及宏观数据修复，长端收益率出现明显的长短端分化与窄幅波动，多空博弈加剧。

产品层面我们对于各产品转债仓位进行了分层定位，按比例配置底仓资产、周期标的以及成长标的，以指数增强的主要思路去进行可转债投资，抓住科技上涨行情的同时也抓住了有价值的周期标的及调整到位的双底标的配置机会。纯债方面我们继续延续票息打底同时通过长端利率波段交易及国债期货进行久期调整，以增厚纯债部分收益。

展望三季度，可转债市场的均价已有所回落，供给层面并没有明显增量，整体来说可转债 $\beta$ 增量可能在三季度增强，仓位水平需保持同时止盈部分弹性转债更加均衡配置行业可能更适应三季度市场。纯债方面，政府债发行进入高峰期，长端及超长端多头面临供给压力；同时央行新增货币工具，对资金面把控或较二季度更加“精准浇灌”；输入性通胀对长端债市情绪也形成制约，调降政策利率的窗口选择更加谨慎，三季度政策相机抉择的特征会更明显。三季度纯债方面应更加注重票息保护垫，做好信用风险把控同时挖掘利差优势品种。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加聚盈定开债券A基金份额净值为1.0529元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.27%，同期业绩比较基准收益率为0.62%；截至报告期末中加聚盈定开债券C基金份额净值为1.0431元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.17%，同期业绩比较基准收益率为0.62%。

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              | -              | -                |
|    | 其中：股票             | -              | -                |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 533,977,560.58 | 97.74            |
|    | 其中：债券             | 533,977,560.58 | 97.74            |
|    | 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      | 12,315,551.49  | 2.25             |
| 8  | 其他资产              | 8,069.05       | 0.00             |
| 9  | 合计                | 546,301,181.12 | 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      | 20,399,223.93  | 4.13         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 223,568,164.51 | 45.25        |
|    | 其中：政策性金融债 | 21,980,657.53  | 4.45         |
| 4  | 企业债券      | 21,532,767.12  | 4.36         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 174,134,945.71 | 35.24        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 94,342,459.31  | 19.09        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 533,977,560.58 | 108.07       |

**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  | 242400011 | 24广发银行永续债01  | 300,000 | 30,579,715.07 | 6.19         |
| 2  | 102481581 | 24津临港投MTN001 | 270,000 | 27,611,250.41 | 5.59         |
| 3  | 230420    | 23农发20       | 200,000 | 21,980,657.53 | 4.45         |
| 4  | 2180498   | 21株洲国投债      | 200,000 | 21,532,767.12 | 4.36         |
| 5  | 102383043 | 23泰达投资MTN005 | 200,000 | 21,016,684.93 | 4.25         |

**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<br>(买/卖) | 合约市<br>值(元) | 公允价值变<br>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）     |    |              |             |               | -325,906.51 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |    |              |             |               | -64,000.00  |

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发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。农业发展银行、农业银行、北部湾银行、徽商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约定的备选股票库。

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额(元)    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 8,069.05 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 8,069.05 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 118058 | 微导转债   | 3,273,385.32 | 0.66         |
| 2  | 127037 | 银轮转债   | 2,974,113.81 | 0.60         |
| 3  | 118053 | 正帆转债   | 2,779,409.42 | 0.56         |
| 4  | 113062 | 常银转债   | 2,685,696.53 | 0.54         |
| 5  | 113046 | 金田转债   | 2,667,654.79 | 0.54         |
| 6  | 123091 | 长海转债   | 2,580,034.52 | 0.52         |
| 7  | 132026 | G三峡EB2 | 2,575,331.51 | 0.52         |
| 8  | 118059 | 顾中转债   | 2,565,252.05 | 0.52         |
| 9  | 123158 | 宙邦转债   | 2,559,768.22 | 0.52         |
| 10 | 113697 | 应流转债   | 2,199,105.47 | 0.45         |
| 11 | 128136 | 立讯转债   | 2,115,030.82 | 0.43         |
| 12 | 113066 | 平煤转债   | 1,992,914.09 | 0.40         |
| 13 | 123259 | 锦浪转02  | 1,870,026.58 | 0.38         |
| 14 | 127109 | 电化转债   | 1,864,031.51 | 0.38         |
| 15 | 113632 | 鹤21转债  | 1,781,151.01 | 0.36         |
| 16 | 127103 | 东南转债   | 1,733,069.82 | 0.35         |
| 17 | 113051 | 节能转债   | 1,677,300.87 | 0.34         |
| 18 | 113615 | 金诚转债   | 1,676,795.12 | 0.34         |
| 19 | 113699 | 金25转债  | 1,640,009.32 | 0.33         |
| 20 | 110090 | 爱迪转债   | 1,608,007.89 | 0.33         |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 21 | 123149 | 通裕转债  | 1,565,752.05 | 0.32 |
| 22 | 118030 | 睿创转债  | 1,528,564.93 | 0.31 |
| 23 | 127064 | 杭氧转债  | 1,522,896.44 | 0.31 |
| 24 | 113052 | 兴业转债  | 1,514,553.39 | 0.31 |
| 25 | 127070 | 大中转债  | 1,506,301.92 | 0.30 |
| 26 | 127067 | 恒逸转2  | 1,445,542.47 | 0.29 |
| 27 | 127040 | 国泰转债  | 1,406,594.84 | 0.28 |
| 28 | 127085 | 韵达转债  | 1,328,651.88 | 0.27 |
| 29 | 127027 | 能化转债  | 1,297,225.90 | 0.26 |
| 30 | 113674 | 华设转债  | 1,262,961.64 | 0.26 |
| 31 | 113058 | 友发转债  | 1,251,919.66 | 0.25 |
| 32 | 127108 | 太能转债  | 1,246,132.88 | 0.25 |
| 33 | 113616 | 韦尔转债  | 1,212,742.36 | 0.25 |
| 34 | 128134 | 鸿路转债  | 1,187,216.44 | 0.24 |
| 35 | 113633 | 科沃转债  | 1,178,303.29 | 0.24 |
| 36 | 110084 | 贵燃转债  | 1,059,167.68 | 0.21 |
| 37 | 127084 | 柳工转2  | 939,163.36   | 0.19 |
| 38 | 113696 | 伯25转债 | 910,000.00   | 0.18 |
| 39 | 113053 | 隆22转债 | 909,853.04   | 0.18 |
| 40 | 127110 | 广核转债  | 790,178.96   | 0.16 |
| 41 | 113056 | 重银转债  | 787,269.41   | 0.16 |
| 42 | 110075 | 南航转债  | 767,797.40   | 0.16 |
| 43 | 113655 | 欧22转债 | 750,144.46   | 0.15 |
| 44 | 113631 | 皖天转债  | 747,478.93   | 0.15 |
| 45 | 127089 | 晶澳转债  | 746,747.98   | 0.15 |
| 46 | 110077 | 洪城转债  | 689,926.87   | 0.14 |
| 47 | 111002 | 特纸转债  | 678,193.84   | 0.14 |
| 48 | 113059 | 福莱转债  | 655,246.34   | 0.13 |
| 49 | 118024 | 冠宇转债  | 649,559.59   | 0.13 |
| 50 | 127082 | 亚科转债  | 646,623.97   | 0.13 |
| 51 | 111009 | 盛泰转债  | 643,819.53   | 0.13 |
| 52 | 123119 | 康泰转2  | 632,021.52   | 0.13 |
| 53 | 113042 | 上银转债  | 629,619.09   | 0.13 |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 54 | 127111 | 金威转债  | 623,481.73 | 0.13 |
| 55 | 110086 | 精工转债  | 620,659.82 | 0.13 |
| 56 | 113666 | 爱玛转债  | 603,354.11 | 0.12 |
| 57 | 111014 | 李子转债  | 592,030.82 | 0.12 |
| 58 | 113670 | 金23转债 | 587,296.61 | 0.12 |
| 59 | 123107 | 温氏转债  | 538,790.03 | 0.11 |
| 60 | 127049 | 希望转2  | 519,084.82 | 0.11 |
| 61 | 113043 | 财通转债  | 490,787.38 | 0.10 |
| 62 | 127056 | 中特转债  | 346,190.48 | 0.07 |
| 63 | 118034 | 晶能转债  | 341,289.60 | 0.07 |
| 64 | 127031 | 洋丰转债  | 319,345.87 | 0.06 |
| 65 | 113054 | 绿动转债  | 300,025.35 | 0.06 |
| 66 | 113627 | 太平转债  | 290,253.16 | 0.06 |
| 67 | 127045 | 牧原转债  | 288,702.57 | 0.06 |
| 68 | 110076 | 华海转债  | 288,687.35 | 0.06 |
| 69 | 123090 | 三诺转债  | 282,143.34 | 0.06 |

#### 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

|                               | 中加聚盈定开债券A      | 中加聚盈定开债券C      |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 430,488,611.05 | 144,133,585.05 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,922,919.27   | 3,540,805.16   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 14,450,351.27  | 95,861,089.71  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 417,961,179.05 | 51,813,300.50  |

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              | 20260401-20260630      | 389,558,239.19 | 0.00 | 0.00 | 389,558,239.19 | 82.92% |
| 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。 |                |                        |                |      |      |                |        |

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聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加聚盈四个月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

9.2 存放地点

基金管理人处

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  
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

中加基金管理有限公司

2026年07月21日