

(上接 D244 版)

中加纯债一年 A 基金份额单位:份

项目 本期 2017年01月01日至2017年12月31日

7.4.8.4.2 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

关联方名称 本期 2017年01月01日至2017年12月31日

注:本年度期末余额仅为活期存款,利息收入为活期存款利息收入。

债券代码 债券名称 回购到期日 期末估值单 数量(张) 期末估值总 额

(上接 D245 版)

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

项目 本期 2017年01月01日至2017年12月31日

注:(1)支付基金管理人中加基金的管理人报酬按前一日基金资产净值

项目 本期 2017年01月01日至2017年12月31日

注:(1)本基金通过“广州农村商业银行股份有限公司保管基金托管核算

关联方名称 本期 2017年01月01日至2017年12月31日

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

8.1 期末基金资产组合情况

序号 项目 金额 占基金总资产的 比例(%)

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

债券代码 债券名称 回购到期日 期末估值单 数量(张) 期末估值总 额

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

8.1 期末基金资产组合情况

序号 项目 金额 占基金总资产的 比例(%)

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能

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(%)

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行人主体本期未出现被监

8.12 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

序号 名称 金额

8.12.4 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 数量(张) 公允价值 占基金资产 净值比例(%)

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

序号 名称 金额

8.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行人主体本期未出现被监

11.1 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。

序号 名称 金额

8.12.4 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 数量(张) 公允价值 占基金资产 净值比例(%)

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行人主体本期未出现被监

11.1 基金份额持有人大会决议

序号 名称 金额

8.12.4 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 数量(张) 公允价值 占基金资产 净值比例(%)

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

序号 名称 金额

8.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行人主体本期未出现被监