

中加丰裕纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
基金合同生效日期:2016年11月28日

2.1 基金基本情况
基金名称:中加丰裕纯债债券型证券投资基金
基金代码:010675

2.2 基金产品说明
投资目标:力争在严格控制投资风险的前提下,长期内实现超越业绩比较基准的投资目标

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司

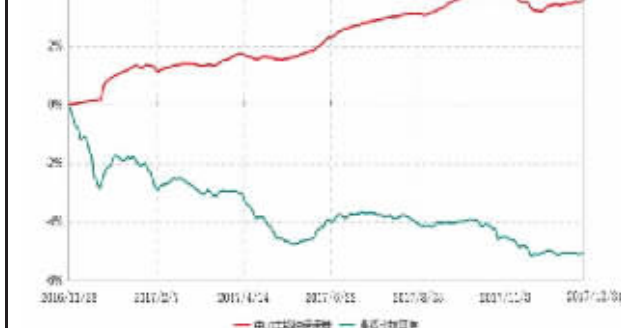
2.4 信息披露方式
基金定期报告披露网站:www.bobbb.com
基金年度报告披露地点:北京市西城区内城南路35号

Table with 4 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 2017, 2016年11月28日(基金合同生效日)-2016年12月31日, 2016年12月31日

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

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④

3.2.1 基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段:过去六个月, 过去一年, 过去一年滚动
业绩比较基准:中债综合全价指数收益率



3.2.3 过去三年基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金净值增长率, 业绩比较基准收益率

Table with 4 columns: 年度, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 备注

3.4 管理人报告
3.4.1 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司

3.4.2 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.3 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.4 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.5 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.6 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.7 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.8 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.9 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.10 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.11 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.12 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.13 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.14 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.15 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.16 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.17 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.18 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.19 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.20 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.21 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

3.4.22 基金管理人及其基金基金经理
基金管理人:中加基金管理有限公司
基金基金经理:杨宇俊

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 本期末, 上年末

Table with 4 columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年末

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

注:2.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期

注:1.本报告期末,中加丰裕纯债债券型证券投资基金资产为1,000.26亿元,负债为1,491.83亿元

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(2)回购协议
本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(按实际利率与合同利率差异较小,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

(3)股票投资
买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应付的全部价款扣除交易费用入账;

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则
除特别说明外,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。

7.4.4.6 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:

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 损益平准金
损益平准金是指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在申购或赎回款项中,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/损失占净资产比例计算的金额。

7.4.4.9 收入(损失)的确认和计量
股票投资收益,按实际利率和衍生工具收益按相关金融资产于处置日或成交金额与其成本之间的差额计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量
本基金的费用按照权责发生制原则进行确认和计量。

7.4.4.11 公允价值估值政策
1.本基金公允价值方式分类:现金分红;
2.本基金公允价值方式分类:现金分红;
3.本基金公允价值方式分类:现金分红;

7.4.4.12 外币交易
本基金外币资产投资产生的外币资产,按照交易发生日的即期汇率折算为人民币。

7.4.4.13 会计政策变更的说明
本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.4.14 会计估计变更的说明
本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.4.15 关联交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.16 关联方关系
关联方是指与本基金存在关联方关系的自然人或法人。

7.4.4.17 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.18 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.19 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.20 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.21 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.22 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.23 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.24 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.25 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.26 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.27 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.28 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.29 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。

7.4.4.30 关联方交易
本基金关联交易按照公平原则进行,关联交易价格按照市场价格确定。