



(上接 D259 版) E 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费.

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:

H=Ex0.1%/当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日基金资产净值

7.4.8.2.3 销售服务费 本报告期内,本基金未向关联方支付销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金于本会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

Table with 4 columns: 关联方名称, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Rows include 兴业银行股份有限公司.

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 4 columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年11月28日至2016年12月31日. Rows include 兴业银行股份有限公司.

注:本基金通过“兴业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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券于期末持有的流通受限证券

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

(1)金融工具公允价值计量的方法

下表列示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。

(2)公允价值计量的层次

(3)金融资产公允价值计量的方法

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2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第二层次的余额为人民币1,000,447,000.00元。

于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第三层次的余额为人民币1,466,638,800.00元。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息,本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设详见附注7.4.4和7.4.5。

(上接 D261 版) 2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中

发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

7.4.8.1 股票交易 本基金在本年度与自2016年11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.8.1.2 权证交易 本基金在本年度与自2016年11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金 本基金在本年度与自2016年11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间没有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬 7.4.8.2.1 基金管理费

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费.

注:支付基金管理人中加基金的管理费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费.

注:支付基金管理人杭州银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费 单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费.

注:本基金通过“杭州银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2)其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值) 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。

88 投资组合报告 8.1 期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 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有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

8.3 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

8.4 报告期末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

8.4.2 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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 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有尾差。

8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

8.7 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

8.8 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

8.9 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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11.3 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注 8.12.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查

8.12.2 本报告期间,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本基金合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 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

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

9 基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数量(份), 占基金总份额比例

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有尾差。

记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金,于2017年12月31日的相关余额为人民币6,158,480.26元

于2016年12月31日,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为人民币4,600,000.00元

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券于期末持有的流通受限证券

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

(1)以公允价值计量的资产和负债

(2)公允价值计量的层次

(3)金融资产公允价值计量的方法

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2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第二层次的债券投资余额为1,150,061,387.40元。

于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第二层次的债券投资余额为1,150,061,387.40元。

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(包括跌停时)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。

(b)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(年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。

88 投资组合报告 8.1 期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 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有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

8.3 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

8.4 报告期末股票投资组合的重大变动

有尾差。 8.6 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

Table with 5 columns: 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(%)

8.7 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

8.8 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

8.9 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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11.3 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注 8.12.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查

8.12.2 本报告期间,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本基金合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 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

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

9 基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数量(份), 占基金总份额比例

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有尾差。

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

8.4.2 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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 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有尾差。

8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

8.7 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

8.8 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

8.9 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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11.3 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注 8.12.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查

8.12.2 本报告期间,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本基金合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 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

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

9 基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数量(份), 占基金总份额比例

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有尾差。

9.3 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

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份)

10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2016年11月28日)基金份额总额, 2016年11月28日至2016年12月31日

11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

11.4 基金投资策略的改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 应付该券商的佣金

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,内部控制制度健全;(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》,并据此提出拟选择券商名单及相应的席位租用安排。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易, 基金交易

12 影响投资者决策的其他重要信息 12.1 报告期内前一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 报告期末持有基金情况

注: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过大,该投资者赎回持有的基金份额时,存在基金份额净值波动的风险;另外,该投资者在大量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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

中加基金管理有限公司 二〇一八年三月三十日

Table with 4 columns: 项目, 份额级别, 持有份额总数量(份), 占基金总份额比例

9.3 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

10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2016年11月11日)基金份额总额, 2016年11月11日至2016年12月31日

11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

11.4 基金投资策略的改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 应付该券商的佣金

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,内部控制制度健全;(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》,并据此提出拟选择券商名单及相应的席位租用安排。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易, 基金交易

12 影响投资者决策的其他重要信息 12.1 报告期内前一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 报告期末持有基金情况

注: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过大,该投资者赎回持有的基金份额时,存在基金份额净值波动的风险;另外,该投资者在大量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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

中加基金管理有限公司 二〇一八年三月三十日