

(上接 D263 版)
7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.8.1.1 股票交易
注:本基金报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付销售机构的客户维护费.

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.30%/当年天数
E为每日应计提的基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. 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的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.10%/当年天数
E为每日应计提的基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. Rows include 基金合同生效日(2017年07月20日)持有的基金份额, 报告期期初持有的基金份额.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. Rows include 基金合同生效日(2017年07月20日)持有的基金份额, 报告期期初持有的基金份额.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

(上接 D262 版)
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日. 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的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.1%/当年天数
E为每日应计提的基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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
单位:人民币元
Table with 2 columns: 关联方名称, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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
7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

Table with 4 columns: 债券代码, 债券名称, 回购买日期, 期末估值单价, 数量(张), 期末估值总额. Rows include 150207, 170203, 170204, 170410, 01175414, 01175164, 011769035, 041751029, 091501001.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费.

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
7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

Table with 4 columns: 债券代码, 债券名称, 回购买日期, 期末估值单价, 数量(张), 期末估值总额. Rows include 1522007, 1622008, 011764078, 091401002, 091401002, 101451057, 101554044, 111780793, 111781013, 111781306, 111781306, 111784163, 111784631, 111786508.

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交易形成的卖出回购证券款余额人民币78300000元。

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. Rows include 基金合同生效日(2017年07月20日)持有的基金份额, 报告期期初持有的基金份额.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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交易形成的卖出回购证券款余额人民币90,100,000.00元。

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

(上接 D262 版)
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日. 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的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.1%/当年天数
E为每日应计提的基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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
单位:人民币元
Table with 2 columns: 关联方名称, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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
7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

Table with 4 columns: 债券代码, 债券名称, 回购买日期, 期末估值单价, 数量(张), 期末估值总额. Rows include 150207, 170203, 170204, 170410, 01175414, 01175164, 011769035, 041751029, 091501001.

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 其中:债券, 4 贵金属投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产.

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

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 其中:政策性金融债, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债(可交换债), 8 同业存单, 9 其他.

8.7 报告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
Table with 4 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(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 其中:政策性金融债, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债(可交换债), 8 同业存单, 9 其他.

8.7 报告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
Table with 4 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(%).

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 其中:政策性金融债, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债(可交换债), 8 同业存单, 9 其他.

8.7 报告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
Table with 4 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(%).

8.8 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 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
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 本期国债期货投资策略
8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.12 报告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
Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%).

8.12.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
8.12.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
8.12.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 4 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例(%), 发起份额总数, 发起份额占发起份额承诺持有期限比例(%).

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金总份额区间情况

Table with 4 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例(%), 发起份额总数, 发起份额占发起份额承诺持有期限比例(%).

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金总份额区间情况

Table with 4 columns: 项目, 中加纯债定开债券 A, 中加纯债定开债券 C. Rows include 基金合同生效日(2017年07月20日)基金份额总额, 基金合同生效日起至报告期末基金份额总额.

8.11 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

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日. Rows include 基金合同生效日(2017年07月20日)持有的基金份额, 报告期期初持有的基金份额.

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 4 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

(上接 D262 版)
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年07月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日. 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的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.1%/当年天数
E为每日应计提的基金托管费

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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
单位:人民币元
Table with 2 columns: 关联方名称, 本期 2017年07月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目, 本期 2017年12月31日. Rows include 持有的基金份额, 持有的基金份额占基金总份额的比例.

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
7.4.8.8 其他关联交易事项的说明

Table with 4 columns: 债券代码, 债券名称, 回购买日期, 期末估值单价, 数量(张), 期末估值总额. Rows include 150207, 170203, 170204, 170410, 01175414, 01175164, 011769035, 041751029, 091501001.