

(上接 D372 版) 基金销售服务费每日计提,按月支付。本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%,对于由 C 类基金份额降级为 A 类基金份额的基金份额持有人,年销售服务费率自其降级后下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率...

Table with columns: 2017年01月01日至2017年12月31日, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2017年01月01日至2017年12月31日. Rows include: 银行间市场交易的各关联方名称, 中国邮政储蓄银行股份有限公司.

注:本基金上年度可比期间未发生与关联方进行银行间市场交易的债券(含回购)交易。 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.4.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日. Rows include: 基金合同生效日(2016年11月22日)持有的基金份额, 报告期末持有的基金份额.

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日. Rows include: 基金合同生效日(2016年11月22日)持有的基金份额, 报告期末持有的基金份额.

(1) 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付; (2) 期间申购/买入总份额,含红利再投、转换入份额;期间赎回/卖出总份额,含转出份额;

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况 份额单位:份 中融现金增利货币 C

Table with columns: 关联方名称, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Rows include: 中融国际信托有限公司. (1) 除基金管理人以外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付;

Table with columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日. Rows include: 中国邮政储蓄银行股份有限公司. 本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。

Table with 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, 4 金融资产投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他各项资产.

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

Table with 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, 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, 10 合计.

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 无。 7.4.5 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 无。 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 无。 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 无。

Table with columns: 债券代码, 债券名称, 回购到期日, 期末市值, 数量(张), 期末市值, 期末市值占基金资产净值比例(%). Rows include: 150004, 150207, 170204, 170204, 111709506.

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 无。 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 银行存款、结算备付金、存出保证金等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 确定金融工具所属的公允价值层次的方法 在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次;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调整的报价;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。

(2) 各层公允价值工具公允价值 本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 9,060,711,340.22 元,无属于第一层次及第三层次的余额(上年度末:第二层次人民币 389,993,815.60 元,无属于第一层次及第三层次的余额)。

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 2 买入返售金融资产, 其中:买断式回购的买入返售金融资产, 3 银行存款和结算备付金合计, 4 其他各项资产, 5 合计.

8.2 债券回购融资情况 金额单位:人民币元 序号 项目 占基金资产净值比例(%) 1 报告期内债券回购融资余额 6.68

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1 报告期内债券回购融资余额, 其中:买断式回购融资, 2 报告期末债券回购融资余额 706,428,380.35, 其中:买断式回购融资.

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明 本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况 8.3.2 投资组合平均剩余期限分布情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 权益投资, 其中:股票, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 4 金融资产投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他各项资产, 9 合计.

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 金额单位:人民币元 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(%) 1 123006 东财转债 40 4,000.00 0.04

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1 存出保证金, 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 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

根据交易所实施的债券质押式回购规则,质押式回购利息天数采用资金实际占款天数,故回购到期日为节假日前一日的交易所回购利息余额可能为负值,本报利息将于节假日期间完成计算。 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末持有转股期的可转换债券 无。

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1 存出保证金, 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 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

Table with columns: 项目, 天数. Rows include: 报告期末投资组合平均剩余期限 72, 报告期末投资组合平均剩余期限最高值 97, 报告期末投资组合平均剩余期限最低值 20.

报告期末投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明 本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天的情况。 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布情况

Table with columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例(%), 各期限负债占基金资产净值比例(%). Rows include: 1 30天以内, 2 30天(含)-60天, 3 60天(含)-90天, 4 90天(含)-120天, 5 120天(含)-397天(含), 合计.

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天的情况。 8.5 期末投资组合品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 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 同业存单, 8 其他, 9 合计.

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 金额单位:人民币元 序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1 111718488 17华夏银行 CD488, 2 111709506 17浦发银行 CD506, 3 179949 17 贴现国债 49, 4 179957 17 贴现国债 57, 5 11172093 17 宁波银行 CD251, 6 111784550 17 赣州银行 CD259, 7 111784705 17 昆仑银行 CD040, 8 111770896 17 合肥科技农村商业银行 CD048, 9 111710662 17 兴业银行 CD662, 10 111785619 17 宁波恒裕银行 CD015.

8.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离 本基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值之间的偏离度的绝对值在报告期内未超过 0.25% 的情况。 8.8 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天的情况。 8.9 期末投资组合品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 权益投资, 其中:股票, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 4 金融资产投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他各项资产, 9 合计.

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 金额单位:人民币元 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(%) 1 123006 东财转债 40 4,000.00 0.04

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%). Rows include: 1 存出保证金, 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 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

根据交易所实施的债券质押式回购规则,质押式回购利息天数采用资金实际占款天数,故回购到期日为节假日前一日的交易所回购利息余额可能为负值,本报利息将于节假日期间完成计算。 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末持有转股期的可转换债券 无。

Table with columns: 项目, 持有份额, 持有份额占基金资产净值比例(%), 发起份额, 发起份额占基金资产净值比例(%). Rows include: 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理等人员, 基金管理人股东, 其他, 合计.

Table with columns: 项目, 偏离情况. Rows include: 报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5% 之间的次数, 报告期内偏离度的最高值, 报告期内偏离度的最低值, 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值.

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明 本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25% 的情况。 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明 本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5% 的情况。 8.8 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 本基金本报告期末持有资产支持证券 无。

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收利息, 4 应收申购款, 5 其他应收款, 7 其他, 8 合计.

8.9 投资组合报告附注 8.9.1 基金计价方法说明 8.9.2 估值调整情况说明 8.9.3 其他重要事项说明

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。 8.9 基金持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:份

Table with columns: 份额级别, 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, 持有份额, 占总份额比例, 持有份额, 占总份额比例. Rows include: 中融现金增利货币 A, 中融现金增利货币 C, 合计.

分级基金机构/个人投资者持有基金份额占基金份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分子采用各自级别的份额,对合计数,比例的分子采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

Table with columns: 序号, 持有人类别, 持有份额(份), 持有份额占基金份额的比例(%). Rows include: 1 银行类机构, 2 银行类机构, 3 保险类机构, 4 银行类机构, 5 券商类机构, 6 券商类机构, 7 银行类机构, 8 保险类机构, 9 银行类机构, 10 银行类机构.

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.3.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.3.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额的数量, 持有基金份额占基金资产净值比例. Rows include: 中融现金增利货币 A, 中融现金增利货币 C, 合计.

8.10 重大事件揭示 8.10.1 基金份额持有人大会决议 8.10.2 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 8.10.3 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门发生大额人事变动 8.10.4 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 8.10.5 基金投资策略的重大调整 8.10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 8.10.7 基金租用证券公司交易单元的情况 8.10.8 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 权益投资, 其中:股票, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 4 金融资产投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他各项资产, 9 合计.

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 金额单位:人民币元 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(%) 1 123006 东财转债 40 4,000.00 0.04

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 存出保证金, 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 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有份额总数(份), 占基金总资产比例. Rows include: 中融现金增利货币 A, 中融现金增利货币 C, 合计.

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.4.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 9.4.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额的数量, 持有基金份额占基金资产净值比例. Rows include: 中融现金增利货币 A, 中融现金增利货币 C, 合计.

8.10 重大事件揭示 8.10.1 基金份额持有人大会决议 8.10.2 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 8.10.3 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门发生大额人事变动 8.10.4 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 8.10.5 基金投资策略的重大调整 8.10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 8.10.7 基金租用证券公司交易单元的情况 8.10.8 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 权益投资, 其中:股票, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 4 金融资产投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他各项资产, 9 合计.

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 金额单位:人民币元 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(%) 1 123006 东财转债 40 4,000.00 0.04

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include: 1 存出保证金, 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 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

根据交易所实施的债券质押式回购规则,质押式回购利息天数采用资金实际占款天数,故回购到期日为节假日前一日的交易所回购利息余额可能为负值,本报利息将于节假日期间完成计算。 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末持有转股期的可转换债券 无。

Table with columns: 项目, 持有份额, 持有份额占基金资产净值比例(%), 发起份额, 发起份额占基金资产净值比例(%). Rows include: 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理等人员, 基金管理人股东, 其他, 合计.