

中加丰裕纯债债券型证券投资基金

资产管理部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成,主要负责投资组合策略的制定和公允价值的计算,并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及基金份额净值的影响。公司督察长在风险控制小组内,成员包括风险管理部、监察稽核部相关人员,主要负责对估值时采用的估值模型、假设、参数及其输入值进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金销售的会计师事务所共同参与本基金的估值程序,基金管理人参与确定本基金估值程序。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议,采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值,与中证指数有限公司签订协议,采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值机构相关人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历,上述参与估值机构各方之间不存在重大利益冲突。

47 理财人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金收益分配方式分两种,现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认收益分配方式是现金分红。
2. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不得低于面值。
3. 本基金每份基金份额享有同等分配权。
4. 基金可供分配利润为正的期间,方可进行收益分配。
5. 投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位,小数点后第3位开始舍去,舍去部分归基金资产。

截至**2018年6月30日**,本期利润分配**30,870,989.06元**。
48 报告期内管理人对本基金持有人或基金产品净值增长情况的说明
本基金报告期内未发生重大净值二十个工作日内出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五十万元的情况。

5 托管人报告
5 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
托管人声明,在报告期内,基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,尽职尽责地履行了应尽的义务。

52 理财人对报告期内本基金投资运作遵守法律、行政法规、部门规章及基金合同约定的情况说明
报告期内基金管理人未在投资运作、基金资产净值的管理、利润分配等方面违反法律法规的规定,基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在重要方面均严格执行基金合同约定的规定。

53 理财人对本半年度报告中财务信息真实、准确和完整发表意见
本半年度报告中财务报告、净值报告、财务会计报告、利润分配报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 资产负债表
会计主体:中加丰裕纯债债券型证券投资基金
报告截止日:**2018年06月30日**

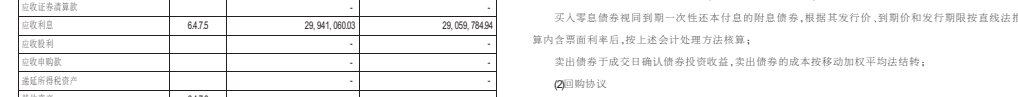
资产	期末数	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
货币资产	6473	2,107,803.08	807,380.03
结算备付金	-	-	-
应收利息	6473	12,948.18	37,074.94
应收股利	-	-	-
买入返售金融资产	6472	1,658,705,250.00	1,466,638,800.00
其中:质押式回购	-	-	-
拆出资金	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	6472	1,658,705,250.00	1,466,638,800.00
负债	-	-	-
应付短期融资券	-	-	-
应付账款	-	-	-
应付利息	6473	-	-
应付股利	6474	-	-
其他负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
所有者权益	-	-	-
实收基金	6473	1,658,705,250.00	1,466,638,800.00
未分配利润	-	-	-
所有者权益合计	6472	1,658,705,250.00	1,466,638,800.00

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32 基金净值表现
32.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准
过去一个月	0.25%	0.00%	0.25%	0.00%	-0.17%	-0.03%
过去三个月	0.25%	0.00%	0.25%	0.00%	-0.09%	-0.05%
过去六个月	2.78%	0.00%	2.78%	0.00%	0.62%	-0.04%
过去一年	3.82%	0.00%	3.82%	0.00%	2.99%	-0.02%
自基金合同生效以来	6.48%	0.00%	-3.01%	0.00%	5.49%	-0.05%

32.2 本基金合同生效以来基金净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3 基金业绩比较基准
32.3.1 基金业绩比较基准的构成
32.3.2 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.3 基金业绩比较基准的说明
32.3.4 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.5 基金业绩比较基准的说明
32.3.6 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.7 基金业绩比较基准的说明
32.3.8 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.9 基金业绩比较基准的说明
32.3.10 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.11 基金业绩比较基准的说明
32.3.12 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.13 基金业绩比较基准的说明
32.3.14 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.15 基金业绩比较基准的说明
32.3.16 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.17 基金业绩比较基准的说明
32.3.18 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.19 基金业绩比较基准的说明
32.3.20 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.21 基金业绩比较基准的说明
32.3.22 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.23 基金业绩比较基准的说明
32.3.24 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.25 基金业绩比较基准的说明
32.3.26 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.27 基金业绩比较基准的说明
32.3.28 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.29 基金业绩比较基准的说明
32.3.30 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.31 基金业绩比较基准的说明
32.3.32 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.33 基金业绩比较基准的说明
32.3.34 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.35 基金业绩比较基准的说明
32.3.36 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

32.3.37 基金业绩比较基准的说明
32.3.38 基金业绩比较基准的说明

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2018年半年度报告摘要

前需过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳,已缴纳增值税的,已缴纳从管理人以后月份增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税。
(6)基金作为流通股股东在股权登记日后收到上市公司通过派发新股的股份,视为应税,暂免征收印花税,企业所得和个人所得税。

(8)基金取得的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2016年1月1日起,对取得的利息收入根据持有期限差异化计算个人所得税的应纳税所得额,持有期限在1个月以内(含1个月),其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持有期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持有期限超过1年的,股息红利所得自2016年1月1日起至2016年9月30日期间,暂减按25%计入应纳税所得额,自2016年9月30日及以后,暂免征收个人所得税。

(9)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
(10)投资者(包括个人和机构投资者)以基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

647关联方关系
647.1本报告存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况
647.2本报告存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况

647.3本报告与基金发生关联交易的各项关系
注:由于四合五人的原因公允价值与基金资产净值的比例之和与合计可能有尾差。

76 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

序号	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	18国债01	1,000,000.00	0.06
2	18国债02	1,000,000.00	0.06
3	18国债03	1,000,000.00	0.06
4	18国债04	1,000,000.00	0.06
5	18国债05	1,000,000.00	0.06
6	18国债06	1,000,000.00	0.06
7	18国债07	1,000,000.00	0.06
8	18国债08	1,000,000.00	0.06
9	18国债09	1,000,000.00	0.06
10	合计	1,000,000.00	0.06

注:由于四合五人的原因公允价值与基金资产净值的比例之和与合计可能有尾差。
76 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

序号	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	18国债01	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
2	18国债02	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
3	18国债03	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
4	18国债04	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
5	18国债05	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
6	18国债06	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
7	18国债07	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
8	18国债08	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
9	18国债09	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26
10	合计	1,000,000.00	100,000,000.00	0.26

77 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

78 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
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

79 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
本基金本报告期末未持有权证投资。

80 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

81 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
70 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

82 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
70 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有期权。

83 报告期末本基金投资的境外证券投资情况
70 报告期末本基金投资的境外证券投资持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有境外证券投资。

84 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

85 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

86 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

87 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

88 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

89 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

90 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

91 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

92 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

93 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

94 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

95 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

96 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

97 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

98 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

99 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

100 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

101 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

102 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

103 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的总额
70 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

70 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

序号	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	18国债01	1,000,000.00	0.06
2	18国债02	1,000,000.00	0.06
3	18国债03	1,000,000.00	0.06
4	18国债04	1,000,000.00	0.06
5	18国债05	1,000,000.00	0.06
6	18国债06	1,000,000.00	0.06
7	18国债07	1,000,000.00	0.06
8			