

B836信息披露Disclosure

(上接 835 版)

7472 交易性金融资产				
单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
交易所属市场	-	-	-	-
债券	2,958,595,466.08	2,958,595,466.08	225,533.92	0.0042
银行间市场	2,958,595,466.08	2,958,595,466.08	225,533.92	0.0042
合计	2,958,595,466.08	2,958,595,466.08	225,533.92	0.0042
2018年12月31日				
交易所属市场	-	-	-	-
债券	2,093,338,778.26	2,088,619,000.00	-4,719,778.26	-0.1206
银行间市场	2,093,338,778.26	2,088,619,000.00	-4,719,778.26	-0.1206
合计	2,093,338,778.26	2,088,619,000.00	-4,719,778.26	-0.1206

注:
1.本基金本报告期末无因进行买式正回购而过户的债券;
2.偏离金额=影子定价-摊余成本;
3.偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。
7473 衍生金融资产/负债
本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。
7474 买入返售金融资产
7474.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
交易所属市场	250,000,000.00	-	-	-
银行间市场	2,217,730,046.59	-	-	-
合计	2,467,730,046.59	-	-	-
2018年12月31日				
交易所属市场	1,662,000,000.00	-	-	-
银行间市场	420,401,190.60	-	-	-
合计	2,082,401,190.60	-	-	-

7474.2 期末买式逆回购交易中取得的债券
本基金本报告期末及上年度末均无买式逆回购交易中取得的债券。

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
应收活期存款利息	2,744.01	5,266.73	-	-
应收定期存款利息	-	-	-	-
应收债券利息	178.42	11,665.87	-	-
应收利息合计	15,026,148.14	8,583,070.60	-	-
应收利息减值准备	2,682,044.98	4,507,306.51	-	-
应收利息净额	-	-	-	-
应收利息减值准备	-	-	-	-
合计	17,711,115.55	13,107,312.29	-	-

7476 其他资产
本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。
7477 应付交易费用

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-	-	-
银行间市场应付交易费用	70,140.54	56,778.82	-	-
合计	70,140.54	56,778.82	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
应付债券利息	-	-	-	-
应付利息	65,000.00	55,000.00	-	-
应付利息减值准备	80,000.00	-	-	-
应付利息净额	9,000.00	9,000.00	-	-
合计	154,000.00	64,000.00	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
基金合同生效日	83,053,075.63	83,053,075.63	-	-
本期申购	128,136,960.54	128,136,960.54	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-169,123,883.45	-169,123,883.45	-	-
期末	42,516,152.72	42,516,152.72	-	-

7470.1 股票交易				
单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
交易所属市场	-	-	-	-
债券	2,958,595,466.08	2,958,595,466.08	225,533.92	0.0042
银行间市场	2,958,595,466.08	2,958,595,466.08	225,533.92	0.0042
合计	2,958,595,466.08	2,958,595,466.08	225,533.92	0.0042
2018年12月31日				
交易所属市场	-	-	-	-
债券	2,093,338,778.26	2,088,619,000.00	-4,719,778.26	-0.1206
银行间市场	2,093,338,778.26	2,088,619,000.00	-4,719,778.26	-0.1206
合计	2,093,338,778.26	2,088,619,000.00	-4,719,778.26	-0.1206

注:
1.本基金本报告期末无因进行买式正回购而过户的债券;
2.偏离金额=影子定价-摊余成本;
3.偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。
7473 衍生金融资产/负债
本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。
7474 买入返售金融资产
7474.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
交易所属市场	250,000,000.00	-	-	-
银行间市场	2,217,730,046.59	-	-	-
合计	2,467,730,046.59	-	-	-
2018年12月31日				
交易所属市场	1,662,000,000.00	-	-	-
银行间市场	420,401,190.60	-	-	-
合计	2,082,401,190.60	-	-	-

7474.2 期末买式逆回购交易中取得的债券
本基金本报告期末及上年度末均无买式逆回购交易中取得的债券。

单位:人民币元				
项目	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日	2017年12月31日
应收活期存款利息	2,744.01	5,266.73	-	-
应收定期存款利息	-	-	-	-
应收债券利息	178.42	11,665.87	-	-
应收利息合计	15,026,148.14	8,583,070.60	-	-
应收利息减值准备	2,682,044.98	4,507,306.51	-	-
应收利息净额	-	-	-	-
应收利息减值准备	-	-	-	-
合计	17,711,115.55	13,107,312.29	-	-

7476 其他