

# 信息披露

(上接B095版)  
于本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。  
7.4.9.5 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			
关联方名称	本期 2018年6月7日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上期 2017年12月31日至2018年6月7日	当期利息收入
招商银行	687,092.03	189,471.79	-

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行间同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
本基金本报告期内未在本承销期内参与关联方承销的证券。  
7.4.9.7 其他关联交易事项的说明  
本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。  
7.4.10 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券  
7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券  
本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。  
7.4.10.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券  
7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额330,778,743.83元,是以下列债券作为质押:

金额单位:人民币元				
债券代码	债券名称	初始期限	期末估值市值	数量(张)
182009	18国债09	2019年1月4日	100.82	948,000
182039	18国债09	2019年1月4日	102.19	198,000
182049	18国债09	2019年1月4日	101.36	520,000
10154009	15国债09	2015年11月3日	102.68	230,000
170044	17国债04	2017年12月2日	100.81	500,000
180304	18国债04	2018年12月2日	102.48	500,000
111899419	18国债19	2018年12月18日	95.88	47,940,000
合计			3,396,000	341,719,580.00

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末2018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252,000,000.00元,截至2019年1月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
(1)公允价值  
(a)金融工具公允价值计量的方法  
公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价  
第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值

(b)持续的以公允价值计量的金融工具  
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价  
第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值  
(c)非持续的以公允价值计量的金融工具  
于2018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资产中属于第二层次的余额为2,351,679,566.00元,属于第三层次的余额为22,420,644.82元,无属于第一层次的余额。于2017年12月31日:第二层次70,852,237.00元,无属于第二层次和第三层次的余额。

(d)公允价值所属层次间的重大变动  
(i)公允价值导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。  
对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次;

(ii)第三层次公允价值余额和本期变动金额  
(a)非持续的以公允价值计量的金融工具  
于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。于2017年12月31日:同。

(b)不以公允价值计量的金融工具  
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(c)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.5 年度财务报表(转型前)  
7.1 资产负债表(转型前)

会计主体:东方红纯债债券型发起式证券投资基金  
报告截止日:2018年6月7日

单位:人民币元			
资产:	本期 2018年6月7日	上年度末 2017年12月31日	
货币资金	4,954,186.28	225,699.57	
银行存款	4,954,186.28	225,699.57	
结算备付金	2,133,401.66	998,954.74	
应收利息	2,859.81	4,961.41	
交易性金融资产	76,657,641.50	70,852,237.00	
其中:股票投资	-	-	
基金投资	-	-	
债券投资	76,657,641.50	70,852,237.00	
资产支持证券投资	-	-	
贵金属投资	-	-	
衍生金融资产	-	-	
买入返售金融资产	-	-	
应收证券清算款	-	-	
应收利息	1,602,327.88	1,883,375.79	
应收股利	-	-	
应收申购款	-	-	
递延所得税资产	-	-	
其他资产	-	-	
资产总计	85,390,417.13	73,965,040.51	
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款	-	-	
交易性金融负债	-	-	
应付短期融资款	-	-	
应付利息	-	-	
应付股利	-	-	
应付赎回款	-	-	
应付债券	-	-	
其他负债	-	-	
负债总计	-	-	
所有者权益			
实收基金	60,123,593.77	60,143,593.77	
未分配利润	2,135,315.08	60,191,571.65	
所有者权益合计	62,258,908.85	60,745,565.42	
负债和所有者权益总计	85,390,417.13	73,965,040.51	

注:报告截止日2018年6月7日,基金份额净值1.036元,基金份额总额2,600,123,593.77份。

7.2 利润表(转型前)

会计主体:东方红纯债债券型发起式证券投资基金  
报告期间:2018年1月1日至2018年6月7日

单位:人民币元			
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月7日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
一、收入	2,096,397.49	4,840,043.64	
1.利息收入	1,728,051.05	4,032,617.41	
其中:存款利息收入	1,728,051.05	181,554.31	
债券利息收入	1,798,720.50	3,575,454.72	
资产支持证券利息收入	-	279,523.28	
买入返售金融资产收入	287.87	16,885.13	
其他利息收入	-	-	
2.投资收益(损失以“-”填列)	-258,448.08	-8,569,383.10	
其中:股票投资收益	-	-	
基金投资收益	-	-	
债券投资收益	-258,448.08	-8,569,383.10	
资产支持证券投资收益	-	-	
衍生工具损益	-	-	
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	626,794.52	9,357,509.26	
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-	
5.其他收入(损失以“-”填列)	-	6.06	
减:二、费用	562,874.06	924,644.82	
1.管理人报酬	79,911.37	264,746.29	
2.托管费	26,637.16	88,248.78	
3.销售服务费	-	-	
4.交易费用	280.55	6,049.86	
5.利息支出	352,530.59	344,598.29	
其中:卖出回购金融资产支出	352,530.59	344,598.29	
6.其他费用	3,928.26	-	
7.其他费用	99,586.63	221,000.84	
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	1,533,523.43	3,916,299.60	
减:所得税费用	-	-	
四、净利润(净收益以“-”填列)	1,533,523.43	3,916,299.60	

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红纯债债券型发起式证券投资基金  
报告期间:2018年1月1日至2018年6月7日

单位:人民币元			
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月7日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	60,143,593.77	60,197,165	60,745,565.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,533,523.43	1,533,523.43
三、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(基金份额变动)	-20,000.00	-180.00	-20,180.00
四、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(基金份额变动)	-20,000.00	-180.00	-20,180.00
五、期末所有者权益(基金净值)	60,123,593.77	2,135,315.08	62,258,908.85

注:本基金本报告期无基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(基金份额变动)。

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额330,778,743.83元,是以下列债券作为质押:

金额单位:人民币元				
债券代码	债券名称	初始期限	期末估值市值	数量(张)
182009	18国债09	2019年1月4日	100.82	948,000
182039	18国债09	2019年1月4日	102.19	198,000
182049	18国债09	2019年1月4日	101.36	520,000
10154009	15国债09	2015年11月3日	102.68	230,000
170044	17国债04	2017年12月2日	100.81	500,000
180304	18国债04	2018年12月2日	102.48	500,000
111899419	18国债19	2018年12月18日	95.88	47,940,000
合计			3,396,000	341,719,580.00

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末2018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252,000,000.00元,截至2019年1月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
(1)公允价值  
(a)金融工具公允价值计量的方法  
公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价  
第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值

(b)持续的以公允价值计量的金融工具  
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价  
第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值  
(c)非持续的以公允价值计量的金融工具  
于2018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资产中属于第二层次的余额为2,351,679,566.00元,属于第三层次的余额为22,420,644.82元,无属于第一层次的余额。于2017年12月31日:第二层次70,852,237.00元,无属于第二层次和第三层次的余额。

(d)公允价值所属层次间的重大变动  
(i)公允价值导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。  
对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次;

(ii)第三层次公允价值余额和本期变动金额  
(a)非持续的以公允价值计量的金融工具  
于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。于2017年12月31日:同。

(b)不以公允价值计量的金融工具  
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(c)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.5 年度财务报表(转型前)  
7.1 资产负债表(转型前)

会计主体:东方红纯债债券型发起式证券投资基金  
报告截止日:2018年6月7日

单位:人民币元			
资产:	本期 2018年6月7日	上年度末 2017年12月31日	
货币资金	4,954,186.28	225,699.57	
银行存款	4,954,186.28	225,699.57	
结算备付金	2,133,401.66	998,954.74	
应收利息	2,859.81	4,961.41	
交易性金融资产	76,657,641.50	70,852,237.00	
其中:股票投资	-	-	
基金投资	-	-	
债券投资	76,657,641.50	70,852,237.00	
资产支持证券投资	-	-	
贵金属投资	-	-	
衍生金融资产	-	-	
买入返售金融资产	-	-	
应收证券清算款	-	-	
应收利息	1,602,327.88	1,883,375.79	
应收股利	-	-	
应收申购款	-	-	
递延所得税资产	-	-	
其他资产	-	-	
资产总计	85,390,417.13	73,965,040.51	
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款	-	-	
交易性金融负债	-	-	
应付短期融资款	-	-	
应付利息	-	-	
应付股利	-	-	
应付赎回款	-	-	
应付债券	-	-	
其他负债	-	-	
负债总计	-	-	
所有者权益			
实收基金	60,123,593.77	60,143,593.77	
未分配利润	2,135,315.08	60,191,571.65	
所有者权益合计	62,258,908.85	60,745,565.42	
负债和所有者权益总计	85,390,417.13	73,965,040.51	

注:报告截止日2018年6月7日,基金份额净值1.036元,基金份额总额2,600,123,593.77份。

7.2 利润表(转型前)

会计主体:东方红纯债债券型发起式证券投资基金  
报告期间:2018年1月1日至2018年6月7日

单位:人民币元			
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月7日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
一、收入	2,096,397.49	4,840,043.64	
1.利息收入	1,728,051.05	4,032,617.41	
其中:存款利息收入	1,728,051.05	181,554.31	
债券利息收入	1,798,720.50	3,575,454.72	
资产支持证券利息收入	-	279,523.28	
买入返售金融资产收入	287.87	16,885.13	
其他利息收入	-	-	
2.投资收益(损失以“-”填列)	-258,448.08	-8,569,383.10	
其中:股票投资收益	-	-	
基金投资收益	-	-	
债券投资收益	-258,448.08	-8,569,383.10	
资产支持证券投资收益	-	-	
衍生工具损益	-	-	
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	626,794.52	9,357,509.26	
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-	
5.其他收入(损失以“-”填列)	-	6.06	
减:二、费用	562,874.06	924,644.82	
1.管理人报酬	79,911.37	264,746.29	
2.托管费	26,637.16	88,248.78	
3.销售服务费	-	-	
4.交易费用	280.55	6,049.86	
5.利息支出	352,530.59	344,598.29	
其中:卖出回购金融资产支出	352,530.59	344,598.29	
6.其他费用	3,928.26	-	
7.其他费用	99,586.63	221,000.84	
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	1,533,523.43	3,916,299.60	
减:所得税费用	-	-	
四、净利润(净收益以“-”填列)	1,533,523.43	3,916,299.60	

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元			
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月7日	上期 2017年1月1日至2017年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	60,143,593.77	60,197,165	60,745,565.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,533,523.43	1,533,523.43
三、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(基金份额变动)	-20,000.00	-180.00	-20,180.00
四、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(基金份额变动)	-20,000.00	-180.00	-20,180.00
五、期末所有者权益(基金净值)	60,123,593.77	2,135,315.08	62,258,908.85

注:本基金本报告期无基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(基金份额变动)。

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额330,778,743.83元,是以下列债券作为质押:

金额单位:人民币元				
债券代码	债券名称	初始期限	期末估值市值	数量(张)
182009	18国债09	2019年1月4日	100.82	948,000
182039	18国债09	2019年1月4日	102.19	198,000
182049	18国债09	2019年1月4日	101.36	520,000
10154009	15国债09	2015年11月3日	102.68	230,000
170044	17国债04	2017年12月2日	100.81	500,000
180304	18国债04	2018年12月2日	102.48	500,000
111899419	18国债19	2018年12月18日	95.88	47,940,000
合计			3,396,000	341,719,580.00

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末2018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252,000,000.00元,截至2019年1月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。