

(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8日(基金合同生效日)至2018年12月31日 189,471.79

招商银行 687,692.03 189,471.79

注:本基金的银行存款由基金管理人通过银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未参与关联方承销的证券。

7.4.9.7 其他关联交易的说明

本基金本报告期末未作说明的其他关联交易。

7.4.10 期末(2019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 持有暂时停牌等受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 衍生工具间市场债券正回购

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,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码 债券名称 回购到期日 本期末估值单价 数量(份) 期末估值总额

1820069 18国债04 2019年1月4日 100.82 948,000 95,577,360.00

1820309 18国债04 2019年1月4日 102.19 198,000 20,233,620.00

187809 18国债04 2019年1月4日 101.36 520,000 52,707,200.00

101564009 18国开债 2019年1月3日 102.68 230,000 23,616,400.00

170404 17农发04 2019年1月2日 100.81 500,000 50,405,000.00

180304 18进博04 2019年1月2日 102.48 500,000 51,240,000.00

11189949 18农商行 2019年1月3日 95.88 500,000 47,480,000.00

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

公允价值计量方法所处的层次,从公允价值计量整体而言具有重要性的输入值所归属的最低层次决定:

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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

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不归属于第二层次的余额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(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)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金已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時点。

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(包括交易不活跃的交易日)或属于非公开发行等情况,本基金不会停牌日或交易恢复活跃日期间、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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

本基金未持有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。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

7.5 年度财务报表(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 本期末 上年度末 2018年6月7日 2017年12月31日

资产: 4,954,186.28 225,699.57

结算备付金 2,133,401.66 998,865.74

存出保证金 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 -

买入返售金融资产 -

应收证券清算款 1,602,327.88 1,883,375.79

应收利息 4,702,125.49 25,211.58

应收申购款 -

应付赎回款 -

应付管理人报酬 3,580.26 15,475.42

应付托管费 1,193.42 515.87

应付交易费用 -

应付税费 -

应付股利 -

应付利润 -

递延所得税资产 -

其他资产 -

资产总计 85,350,417.13 73,965,040.51

负债和所有者权益 本年末 上年度末 2018年6月7日 2017年12月31日

负债: 18,300,000.00 13,000,000.00

应付证券清算款 4,702,125.49 25,211.58

应付利息 2,036,397.49 1,728,050.28

应付股利 2,859.81 15,475.42

应付管理人报酬 1,193.42 515.87

应付托管费 1,193.42 515.87

应付交易费用 -

应付税费 -

应付利润 -

递延所得税负债 -

其他负债 69,259.30 180,000.00

负债合计 23,091,508.28 33,219,475.09

所有者权益: 60,123,593.77 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60,123,593.77份。

7.2 利润情况

会计主体:东方红纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月7日

单位:人民币元

项目 本期 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月7日 2017年1月1日至2017年12月31日

一、收入 2,096,397.49 4,840,936.66

利息收入 1,728,051.05 4,052,474.44

其中:存款利息收入 19,042.68 181,543.31

债券利息收入 3,575,457.42 379,528.23

贵金属利息收入 287.87 16,085.13

其他利息收入 2,859.81 8,569,583.10

2) 手续费收入 2,133,401.66 2,133,401.66

手续费收入 2,859.81 4,961.41

佣金收入 -

利息收入 2,096,397.49 4,840,936.66

二、损失 2,859.81 4,961.41

利息支出 1,728,051.05 4,052,474.44

其中:存款利息支出 19,042.68 181,543.31

债券利息支出 3,575,457.42 379,528.23

贵金属利息支出 287.87 16,085.13

其他利息支出 2,859.81 8,569,583.10

3) 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 626,794.52 9,357,996.26

4) 公允价值变动损失(损失以“-”号填列) -562,874.06 9,244,644.06

5) 其他收入(损失以“-”号填列) -0.06

5) 其他费用 26,637.16 88,248.78

6) 分配费用 280.55 6,049.86

7) 利息费用 352,530.09 344,598.29

其中:卖出回购金融资产支出 352,530.09 344,598.29

8) 其他费用 3,928.26 -

9) 其他费用 99,586.63 221,000.84

H = E × 0.30% × 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

F 为前一日的基金资产净值

G 为前一日的基金资产净值

H 为每日应计提的基金托管费

I 为前一日的基金资产净值

J 为前一日的基金资产净值

K 为前一日的基金资产净值

L 为前一日的基金资产净值

M 为前一日的基金资产净值

N 为前一日的基金资产净值

O 为前一日的基金资产净值

P 为前一日的基金资产净值

Q 为前一日的基金资产净值

R 为前一日的基金资产净值

S 为前一日的基金资产净值

T 为前一日的基金资产净值