

(上接B130版)

于2018年12月31日,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限的证券。

4.4.2 本期持有的暂时停牌等流通受限股票

于2018年12月31日,本基金无暂时停牌等流通受限股票。

4.4.3 期末持有的股票正回购交易中作为抵押的债券

4.4.3.1 银行间市场债券正回购

于2018年12月31日,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于2018年12月31日,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

(1)为了理解了解资产和负债而需要说明的其他事项

4.5 本期因公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续性和非持续以公允价值计量的资产和负债及基于报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次,公允价值计量结果所归属的层次对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

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到的输入值;

第三层次输入值:相关资产或负债的不可观察输入值。

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为51,571,523.22元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额,其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括跌停跌停时的交易不活跃),或属于非公开发行等情况时,本基金不会停牌期间、交易不活跃期间或相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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,确定相对证券公允价值的层次。

(b)非持续的公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2)其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具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之间无重大差异。

§ 7 年度财务报表(转型前)

会计主体:诺安鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日: 2016年1月29日

单位:人民币元

资产	本期末		上年度末	
	2016年1月29日	2017年12月31日	2016年1月29日	2017年12月31日
资产:				
银行存款	411,891,170.13		3,149,984.89	
结算备付金	68,666.70		75,193.85	
交易性金融资产	565,429.94	1,222,609,646.00		
其中:股票投资	565,429.94	88,270,270,989.36		
基金投资	-			
债券投资	-	1,134,238,669.70		
资产支撑证券投资	-			
贵金属投资	-			
衍生金融资产	-			
买入返售金融资产	-			
应交税费	-			
应付交易费用	-			
应付利润	-			
应付股利	136,600.67	30,582,840.30		
应付利息	-			
应付手续费及佣金	-		497.02	
递延所得税资产	-			
其他资产	-			
资产总计	412,681,866.44	2,561,640,063.91		
负债和所有者权益				
负债:				
短期借款	-			
应付短期款项	-			
应付交易性金融负债	-			
应付债券	-			
应付股利	-			
应付手续费及佣金	-			
应付利息	-			
应付股利	107,200.13	57,461.06		
应付股利	96,659.90			
应付股利	-			
应付衍生金融负债	-			
应付交易性金融负债	-			
应付票据	-			
应付账款	-			
应付职工薪酬	-			
应交税费	-			
应付股利	-			
应付股利	192,424.67	190,811.46		
负债合计	94,561,362.04	5,112,795.25		
所有者权益:				
实收基金	306,537,841.69	2,466,123,144.40		
未分配利润	11,592,672.71	80,304,169.26		
所有者权益合计	318,130,514.00	2,546,427,313.66		
负债和所有者权益总计	412,681,866.44	2,561,640,063.91		

注:1)报告截止日2018年1月29日(基金合同失效前日),基金份额净值人民币1,028.83元,基金份额总额506,537,841.69份。②本报告期为2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)。

7.2 利润表

会计主体:诺安鑫保本混合型证券投资基金

报告本期:2018年1月1日至2018年1月29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1月29日	2017年1月1日至2017年12月31日	2018年1月1日至2018年1月29日	2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	8,827,292.73	132,112,943.94		
1.利息收入	7,272,519.47	113,064,314.07		
其中:存款利息收入	129,621.13	2,058,942.97		
拆出资金利息收入	3,562,033.60	81,620,226.06		
2.投资收益(损失以“-”填列)	-12,478,147.18	-18,080,104.68		
其中:股票投资收益	22,175,368.92	-7,704,574.48		
基金投资收益	-34,574,341.24	-13,100,209.36		
3.贵金属投资收益	-			
4.衍生工具收入	100,972.48	740,918.27		
5.其他收入	2,336,700.64			
其中:卖出回购金融资产支出	-			
6.银行存款利息收入	10,345.70	-		
7.其他收入	38,681.47	363,672.87		
减: 费用	2,261,071.03	47,337,269.99		
1.管理人报酬	1,732,346.08	2,600,122.38		
2.托管费	288,724.50	434,657.09		
3.交易费用	-			
4.汇兑损失(减汇兑收益)	-			
5.其他费用	107,200.13	57,461.06		
6.应付股利	96,659.90			
7.应付利息	-			
8.应付股利	192,424.67	190,811.46		
负债合计	94,561,362.04	5,112,795.25		
所有者权益:				
实收基金	306,537,841.69	2,466,123,144.40		
未分配利润	11,592,672.71	80,304,169.26		
所有者权益合计	318,130,514.00	2,546,427,313.66		
负债和所有者权益总计	412,681,866.44	2,561,640,063.91		

注:下述关联交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

4.8 本报告期间上年度可比期间的关联交易

4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

4.8.1.1 股票交易

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行股票交易。

4.8.1.2 权证交易

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行权证交易。

4.8.1.3 贵金属交易

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行贵金属交易。

4.8.1.4 基金投资

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行基金投资。

4.8.1.5 债券交易

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行债券交易。

4.8.1.6 货币市场基金投资

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行货币市场基金投资。

4.8.1.7 其他投资

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行其他投资。

4.8.1.8 买入返售金融资产

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行买入返售金融资产。

4.8.1.9 融资融券

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行融资融券。

4.8.1.10 其他

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行其他投资。

4.8.2 基金托管费

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行基金托管费。

4.8.3 交易费用

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行交易费用。

4.8.4 买入返售金融资产

本基金自2018年1月1日至2018年1月29日(基金合同失效前日)止期间与上年度可比期间内没有通过关联方的交易单元进行买入返售金融资产。

4.8.5