

(上接B212版)

(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

对于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一层次的余额为0.00元,属于第二层次的余额为293,881,200.00元,属于第三层次的余额为0.00元。

(ii)公允价值重估期间的重大变动

对于节假日至下一个交易日的重估期间,基金不会停止交易,但可能会出现涨跌停板的交易不活跃,或属于非公开发行等情况,基金不会停止交易且在重估期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层次,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

对于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。

(d)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。

(2)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 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体:前海开源润和6个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2018年03月20日

单位:人民币元

资产	本期末	上年度末
	2018年03月20日	2017年12月31日

货币资金	1,867,402.00	612,270.74
银行存款	1,204,111.55	2,969,066.96
应收利息	8,700.00	3,084.26
交易性金融资产	17,579,318.00	33,229,939.00
其中:股票投资	-	-
债券投资	17,579,318.00	33,229,939.00
应收股利	-	-
应收利息	652,019.01	1,046,075.28
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
应付申购款	60,994.00	-
应付赎回款	5,374.60	87,163.93
应付托管费	1,174.00	17,432.79
应付交易服务费	189.30	918.13
应付交纳所得税	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付托管费	-	-
应付交易服务费	-	-
应付税费	-	-
应付股利	-	-