

## (上接B261版)

7.14.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.14.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.14.5.5 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	2018年7月23日(基金转型前日)至2018年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,569,491,411	19,523,623

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率

计息。

7.14.5.6 本基金在承销期内参与与关联方承销证券的情况

无。

7.14.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.14.6 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限股票

无。

7.14.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限股票

无。

7.14.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.14.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.14.6.4 交易所债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事证券交易的债券正回购

形成的卖出回购证券款余额4,000,000.00元,于2019年1月2日到期,该类交

易要求本基金支付回购款,按证券交易所规定的折价折算为标准券后,

不计息。债券回购的交易余额。

7.14.7 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

公允价值量是否属于公允价值,由对公允价值计量整体而言具有重要意

义的输入值所确定的最低层次决定:

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) 持续的公允价值量的金融工具

(i) 各层次金融工具的公允价值

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

益的金融资产余额为第一层余额38,829,524.97元,属于第二层次的余

额5,856,740.40元,无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值量的层级之间的重大变动

本基金以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

括涨停跌停的交易不活跃),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,交易不活跃期间或停牌期间将相关股票和债券的公允

价值列入第一层次;并根据评估调整中采用的不可观察输入值对于公允价值

的调整幅度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第二层次公允价值量的变动金额

(e) 非持续的以公允价值量的金融工具

不以公允价值量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负

债,其公允价值与公允价值相差不多。

(2) 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。

7.2.2 博时保泰保本混合型证券投资基金管理人

会计主体:博时保泰保本混合型证券投资基金管理人

报告截止日:2018年7月22日(基金转型日前日)

单位:人民币元

资产/负债	本期末(2018年7月22日) (基金转型日前日)	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	5,771,272.96	64,273,464.72
结算备付金	25,396,495.84	10,473,131.42
存出保证金	206,243.07	76,080.92
交易保证金	131,043,346.40	2,293,133,946.01
其中:按揭贷款	-	231,032,937.11
基金投资	-	-
债券投资	131,043,346.40	1,992,446,412.99
货币市场基金投资	-	69,654,500.00
应收利息	-	-
应收股利	-	-
应收申购款	4,396,362.80	2,003,199.12
应收票据	1,669,463.19	43,021,604.19
应收股利	-	-
应收申购款	906.43	2,173.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	171,406,179.68	2,404,463,399.69
负债:		
负债和所有者权益	171,406,179.68	2,404,463,399.69
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付票据	4,190,648.04	14,046,100.06
应付账款	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用	76,614.03	179,388.26
应付税费	8,883.28	-
应付利润	-	-95,036.67
应付股利	-	-
应付优先股	-	-
应付定期存款	-	-
应付自有资金	-	-
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	181,000,000.00
应付债券	4,190,648.04	14,046,100.06
应付卖出回购金融资产款	92,031,310.00	60,883,294.71
应付定期存款	4,190,648.04	14,046,100.06
应付应付股利	147,020.43	2,219,002.01
应付职工薪酬	24,603.36	369,936.67
应付手续费费	6,603.06	49,140.26
应付交易费用		