

(上接B419版)

E为前一日基金资产净值 7.1.4.8.2 基金托管费	单位:人民币元
项目	本期
2018年7月10日至2018年12月31日	488,106.21

注:基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10% (当年天数)

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期		
银行间市场的 交易的对手 方名称	债券交易金额	基金逆回购 资金正回购
基金买入人 基金额度	36,088,721.28	-7,905,881.10
基金卖出人 基金额度	-	-
招商银行	306,000.00	108,244.28

7.1.4.8.4 各关联方对本基金的情况

7.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:份额单位:份

项目	本期
2018年7月10日至2018年12月31日	9,029,514.69

10月持有的基金份额

11月持有的基金份额

12月持有的基金份额

12月持有的基金份额占基金总份额

0.09%

7.1.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.1.4.8.5 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7月10日至2018年12月31日	3,798,246.09

7.2.3 所有者权益(基金净值)变动表

会主:国投瑞银顺鑫一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年7月9日(基金合同失效前)

单位:人民币元

项目	本期
2018年7月10日至2018年12月31日	31,711,066.20

减:净利润(净亏损以“-”号填列)

31,711,066.20 20,665,066.71

7.2.3.2 所有者权益(基金净值)变动表

会主:国投瑞银顺鑫一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年7月9日(基金合同失效前)

单位:人民币元

项目	本期
2018年7月10日至2018年12月31日	3,798,246.09

7.2.4.6.2 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.7.1 其他关联交易的说明

7.2.4.9.1 (2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1.1 因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可赎回日期	流通受限情况	认购价格	期末估值(单位:人民币元)	备注
112637	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	9998.0000	100.00
7	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	998.0000	99.00
110206	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	180.02	180.02
110206	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	364.0967	364.0967

7.2.4.9.2 本基金持有的暂时停牌或暂停流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌或暂停流通受限的股票。

7.2.4.9.3 与基金逆回购正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期无其他关联交易事项。

7.2.4.9.4 (2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.5 (2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	回购到期日	期末估值(单位:人民币元)
180206	18国开行06	2019-01-04	106.21
180205	18国开行05	2019-01-04	106.90
180203	18国开行03	2019-01-04	106.90
180211	18国开行11	2019-01-04	106.47
180211	18国开行11	2019-01-04	101.33
180310	18进出口01	2019-01-04	108.13
180406	18农发06	2019-01-04	106.93
180206	18招商银行01	2019-01-02	101.69

7.2.4.9.6 本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.9.7 本基金本报告期无与公允价值量划分为第三层次的金融工具,金额单位:人民币元

7.2.4.10.1 有助于理解分析会计报表需要说明的其他事项

7.2.4.10.2 承诺事项

本基金无需要说明的承诺事项。

7.2.4.10.3 其他事项

7.2.4.10.4 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相等。

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中划分为第三层次的余额为1,254,072,180.82元,无划分为第一层次和第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值量划分为第三层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易上市的可转换、可交换债券,若出现交易不活跃的情况,本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次,根据估值调整中所用的可观察性和重要性,确定相关债券公允价值应属

于第二层次或第三层次。

7.2.4.11.1 本基金持有的暂时停牌或暂停流通受限股票

本基金本报告期无暂停停牌或暂停流通受限的股票。

7.2.4.11.2 与基金逆回购正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期无其他关联交易事项。

7.2.4.11.3 因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可赎回日期	流通受限情况	认购价格	期末估值(单位:人民币元)	备注
112637	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	9998.0000	100.00
7	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	998.0000	99.00
110206	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	180.02	180.02
110206	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	364.0967	364.0967

7.2.4.11.4 与基金逆回购正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期无其他关联交易事项。

7.2.4.11.5 因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可赎回日期	流通受限情况	认购价格	期末估值(单位:人民币元)	备注
112637	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	9998.0000	100.00
7	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	998.0000	99.00
110206	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	180.02	180.02
110206	18股	2018-01-20	2018-01-16	新债上市	99.08	364.0967	364.0967

7.2.4.11.6 与基金逆回购正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期无其他关联交易事项。

7.2.4.11.7 因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 证券代码 | 证券名称 |
<th
| --- | --- |