

民生加银稳健成长混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	56
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	68
§13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银稳健成长混合型证券投资基金
基金简称	民生加银稳健成长混合
基金主代码	690004
交易代码	690004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月29日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,831,751.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在充分控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，主要投资于成长性良好且经营稳健的企业，争取实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在资产配置中采取自上而下的策略，并在稳健投资的理念下运用自上而下的策略对基金股票资产进行适度均衡行业配置。 在个股选择上，本基金股票资产投资的企业不仅需要具有良好的成长性，而且要求经营稳健；此外，拟进入基金股票组合的企业，还需要经过估值水平和流动性的审慎筛选。本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		民生加银基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	王永民
	联系电话	0755-23999888	010-66594896
	电子邮箱	linhai@msjfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-388	95566
传真		0755-23999800	010-66594942
注册地址		深圳市福田区益田路西、福中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区益田路西、福	北京市西城区复兴门内大街 1

	中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	号
邮政编码	518026	100818
法定代表人	万青元	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区益田路西、福中路北新世界商务中心 42 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	58,061,376.59	31,509,963.09	17,233,770.36
本期利润	57,891,917.64	32,595,278.69	14,327,874.79
加权平均基金份额本期利润	0.7355	0.2262	0.0804
本期加权平均净值利润率	55.30%	27.63%	10.57%
本期基金份额净值增长率	53.58%	31.26%	10.38%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	27,040,210.09	-1,556,214.36	-41,953,084.05
期末可供分配基金份额利润	0.5217	-0.0150	-0.2582
期末基金资产净值	78,871,961.66	102,953,450.89	122,733,130.98
期末基金份额净值	1.522	0.991	0.755
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	52.20%	-0.90%	-24.50%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

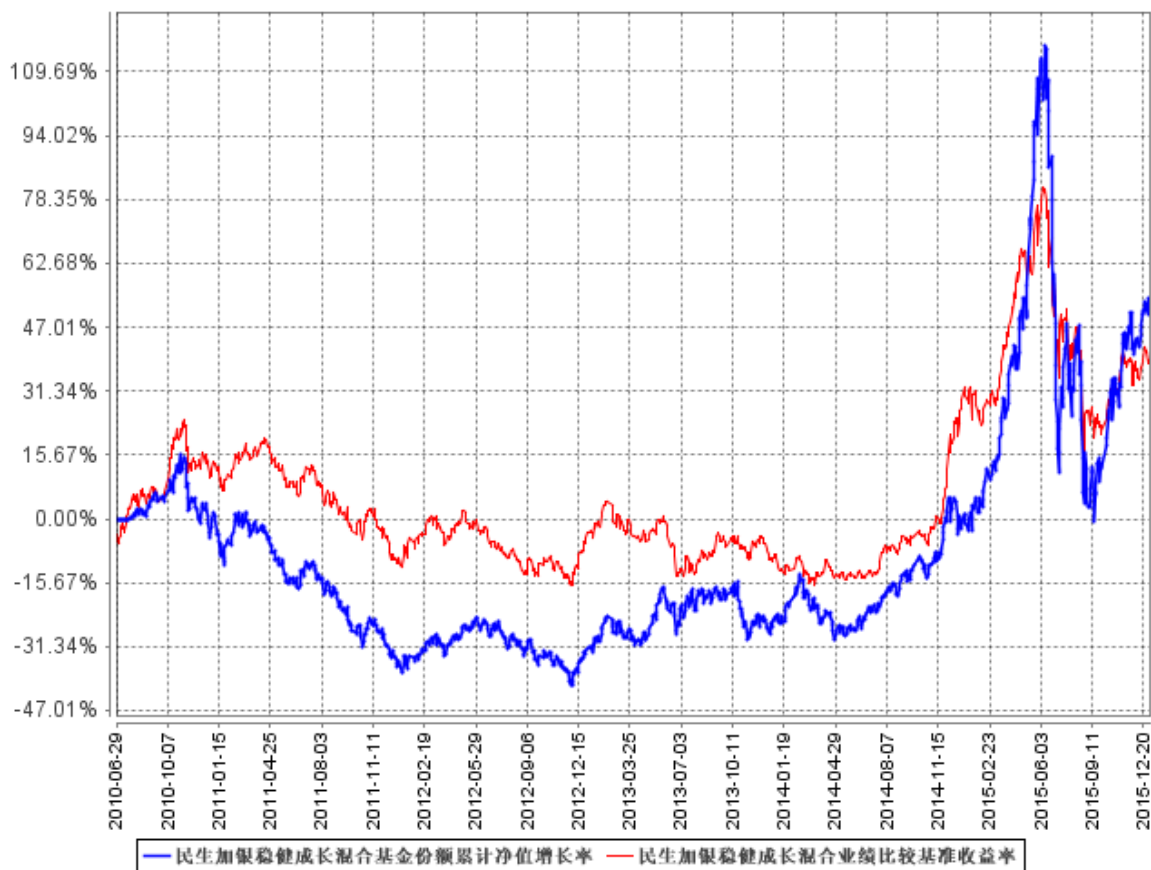
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	35.41%	2.23%	13.57%	1.34%	21.84%	0.89%
过去六个月	-4.76%	3.49%	-12.31%	2.14%	7.55%	1.35%
过去一年	53.58%	3.08%	6.98%	1.99%	46.60%	1.09%
过去三年	122.51%	2.12%	43.01%	1.43%	79.50%	0.69%
过去五年	52.35%	1.82%	22.97%	1.29%	29.38%	0.53%
自基金合同生效起至今	52.20%	1.77%	38.17%	1.28%	14.03%	0.49%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

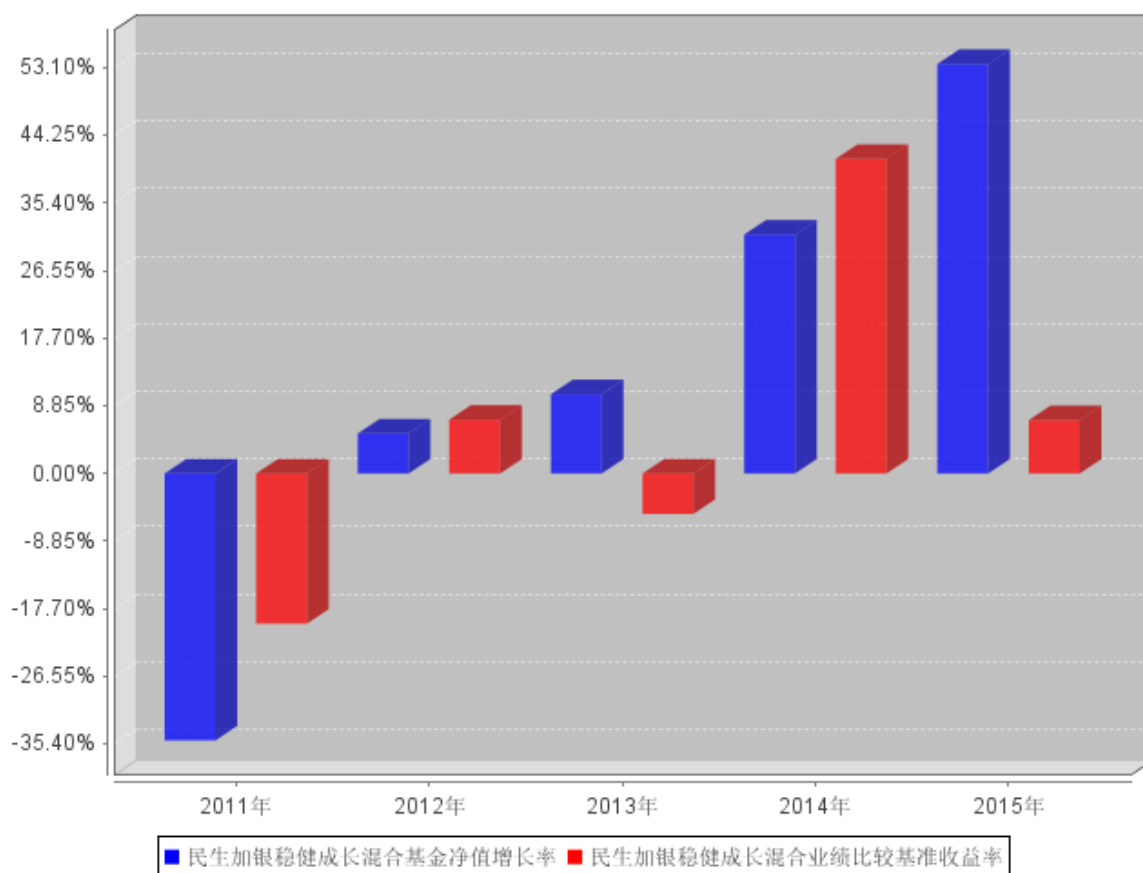
民生加银稳健成长混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2010 年 6 月 29 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民生加银稳健成长混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2010 年 6 月 29 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。经中国证监会[2008]1187号文批准，于2008年11月3日在深圳正式成立，2012年注册资本增加至3亿元人民币。

截至2015年12月31日，公司共管理25只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型

证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银家盈理财 7 天债券型证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银家盈理财月度债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置定期开放混合型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡锋亮	民生加银精选混合、民生加银稳健成长混合、民生加银内需增长混合、民生加银城镇化混合的基金经理	2011 年 7 月 29 日	-	9 年	英国格拉斯哥大学国际金融硕士。自 2006 年起在金鹰基金先后从事行业研究、策略研究、投资助理及交易主管等相关工作；2011 年 1 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统中的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

过去一年市场剧烈波动，资本市场在万众创业及经济转型的引导下通过资金杠杆基本上走了一个牛熊轮回。我们上半年的投资基本是紧扣互联网+这个主题，至下半年，由于出现系统性风险，基金的净值遭遇较大回撤。至年终，我们适当调整组合结构，买入部分估值较低的股票，以降低风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.522 元，本报告期内份额净值增长率为 53.58%，同期业绩比较基准收益率为 6.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年的投资将充满挑战但同时也是大道至简的一年。首先，维持经济增长稳定债务风险需要维持流动性宽松，但由于短期内经济增长仍未找到引擎，滞涨预期将如影随形，这将影响市场风险偏好；其次，经济上的减法是供给侧改革，虽短期不利于社会财富增长却长期利于经济转型；再次，科技创新及提高社会服务效率将是转型中的加法，中长期来看这应该是投资选择的制胜之道。由此我们认为，在今年上半段的投资中我们将尽量控制风险及平衡组合，而当部分符合未来产业方向的优秀企业出现好的价格之时，我们也将大举投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人内部对本基金的监察稽核工作主要针对本基金投资运作的合法、合规性，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部进行监察，通过实时监控、定期检查、专项检查、不定期抽查等方式，及时发现问题，提出整改意见并跟踪改进落实情况，并按照中国证监会的要求将《季度监察稽核报告》和《年度监察稽核报告》提交给公司全体董事审阅，并向中国证监会、深圳证监局上报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括分管运营的公司领导、督察长、投资总监、运营管理部、交易部、研究部、投资部、固定收益部、监察稽核部、风险管理部各部门负责

人及其指定的相关人员。研究部参加人员应包含金融工程小组及相关行业研究员。分管运营的公司领导任估值小组组长。且基金经理不参与其管理基金的相关估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期可不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在民生加银稳健成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第 60950520_H05 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	民生加银稳健成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的民生加银稳健成长混合型证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人民生加银基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了民生加银稳健成长混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	乌爱莉
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：民生加银稳健成长混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	12,135,629.52	15,113,956.42
结算备付金		981,542.82	1,005,456.41
存出保证金		93,758.20	63,421.41
交易性金融资产	7.4.7.2	66,267,040.00	96,195,524.59
其中：股票投资		66,267,040.00	96,195,524.59
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		866,782.55	484,306.23
应收利息	7.4.7.5	2,754.18	2,379.12
应收股利		-	-
应收申购款		47,766.82	20,049.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		80,395,274.09	112,885,093.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,717,544.51
应付赎回款		165,109.43	1,170,381.95
应付管理人报酬		100,440.57	143,816.23
应付托管费		16,740.10	23,969.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,000,412.38	534,795.15
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	240,609.95	341,135.71
负债合计		1,523,312.43	9,931,642.92
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	51,831,751.57	103,930,515.70
未分配利润	7.4.7.10	27,040,210.09	-977,064.81
所有者权益合计		78,871,961.66	102,953,450.89
负债和所有者权益总计		80,395,274.09	112,885,093.81

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.522 元，基金份额总额 51,831,751.57 份。

7.2 利润表

会计主体：民生加银稳健成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		63,879,888.20	38,043,018.15
1. 利息收入		146,195.94	437,613.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	113,433.04	109,425.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,762.90	328,187.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		63,567,983.19	36,508,848.09
其中：股票投资收益	7.4.7.12	63,124,425.17	35,624,329.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	443,558.02	884,518.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-169,458.95	1,085,315.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	335,168.02	11,241.32
减：二、费用		5,987,970.56	5,447,739.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,586,644.67	1,771,402.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	264,440.79	295,233.84
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	3,961,090.81	3,004,311.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	175,794.29	376,791.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,891,917.64	32,595,278.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57,891,917.64	32,595,278.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银稳健成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	103,930,515.70	-977,064.81	102,953,450.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,891,917.64	57,891,917.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-52,098,764.13	-29,874,642.74	-81,973,406.87
其中：1. 基金申购款	188,899,277.29	41,508,190.63	230,407,467.92
2. 基金赎回款	-240,998,041.42	-71,382,833.37	-312,380,874.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	51,831,751.57	27,040,210.09	78,871,961.66
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	162,470,555.44	-39,737,424.46	122,733,130.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,595,278.69	32,595,278.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-58,540,039.74	6,165,080.96	-52,374,958.78
其中：1. 基金申购款	12,453,666.29	-990,325.87	11,463,340.42
2. 基金赎回款	-70,993,706.03	7,155,406.83	-63,838,299.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	103,930,515.70	-977,064.81	102,953,450.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 吴剑飞 </u>	<u> 周吉人 </u>	<u> 洪锐珠 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

民生加银稳健成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原名民生加银稳健成长股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]589号《关于核准民生加银稳健成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由基金管理人民生加银基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2010年6月29日正式生效,首次设立募集规模为775,700,225.52份基金份额,其中认购资金利息折合111,149.38份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司,注册登记机构为民生加银基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,民生加银基金管理有限公司决定自2015年8月8日起,将“民生加银稳健成长股票型证券投资基金”更名为“民生加银稳健成长混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银稳健成长混合型证券投资基金基金合

同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、权证、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、货币市场工具和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量；在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、货币市场工具和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值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作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映

公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利按除息日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

(5)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多 6 次;每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 50%。基金合同生效不满三个月,收益可不分配;

(6)基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日;

(7)投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位,小数点后第 3 位四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产;

(8)法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的规定,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1%由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,免征营业税。

对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	12,135,629.52	15,113,956.42
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	12,135,629.52	15,113,956.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		58,766,545.24	66,267,040.00	7,500,494.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		58,766,545.24	66,267,040.00	7,500,494.76
项目		上年度末 2014年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		88,525,570.88	96,195,524.59	7,669,953.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		88,525,570.88	96,195,524.59	7,669,953.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	2,222.00	1,850.02
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	485.87	497.75
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	46.31	31.35
合计	2,754.18	2,379.12

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,000,412.38	534,795.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,000,412.38	534,795.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	609.95	1,135.71
预提费用	240,000.00	340,000.00
合计	240,609.95	341,135.71

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	103,930,515.70	103,930,515.70
本期申购	188,899,277.29	188,899,277.29
本期赎回(以“-”号填列)	-240,998,041.42	-240,998,041.42
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	51,831,751.57	51,831,751.57

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,556,214.36	579,149.55	-977,064.81
本期利润	58,061,376.59	-169,458.95	57,891,917.64
本期基金份额交易产生的变动数	-28,150,367.17	-1,724,275.57	-29,874,642.74
其中：基金申购款	36,406,025.30	5,102,165.33	41,508,190.63
基金赎回款	-64,556,392.47	-6,826,440.90	-71,382,833.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,354,795.06	-1,314,584.97	27,040,210.09

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	90,535.45	78,575.57
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	21,103.82	29,463.22
其他	1,793.77	1,386.80
合计	113,433.04	109,425.59

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	1,332,891,954.33	997,769,340.48
减：卖出股票成本总额	1,269,767,529.16	962,145,010.94
买卖股票差价收入	63,124,425.17	35,624,329.54

7.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生金融工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	443,558.02	884,518.55
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	443,558.02	884,518.55

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-169,458.95	1,085,315.60
——股票投资	-169,458.95	1,085,315.60
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-169,458.95	1,085,315.60

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日

基金赎回费收入	276,790.19	10,051.43
转换费收入	58,377.83	1,189.89
合计	335,168.02	11,241.32

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	3,961,090.81	3,004,311.58
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,961,090.81	3,004,311.58

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	100,000.00	300,000.00
银行费用	17,794.29	18,791.55
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	175,794.29	376,791.55

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

民生加银基金管理有限公司（“民生加银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的股东
三峡财务有限责任公司	基金管理人的股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,586,644.67	1,771,402.49
其中：支付销售机构的客户维护费	317,382.90	340,468.63

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2015 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 100,440.57 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 143,816.23 元）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	264,440.79	295,233.84

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2015 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 16,740.10 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 23,969.37 元）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	12,135,629.52	90,535.45	15,113,956.42	78,575.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002018	华信国际	2015年6月15日	重大事项	30.60	-	-	196,200	6,196,536.00	6,003,720.00	-
002691	冀凯股份	2015年12月14日	重大事项	25.25	2016年2月16日	21.80	141,400	3,008,148.00	3,570,350.00	-
300162	雷曼股份	2015年11月2日	重大事项	27.06	2016年2月29日	21.47	95,300	2,279,184.41	2,578,818.00	-
002207	准油股份	2015年12月16日	重大事项	21.42	-	-	73,100	1,562,333.00	1,565,802.00	-
002049	同方国芯	2015年12月11日	重大事项	60.15	2016年3月11日	54.14	20,300	637,754.64	1,221,045.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以公募基金投资决策委员会和专户投资决策委员会核心的、由风险控制委员会、投资部、固定收益部、专户一部、专户二部、交易部、监察稽核部、风险管理部、研究部等相关业务部门构成的金融工具风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日及 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资。因此，本基金无重大的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,135,629.52	-	-	-	-	-	12,135,629.52
结算备付金	981,542.82	-	-	-	-	-	981,542.82
存出保证金	93,758.20	-	-	-	-	-	93,758.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	66,267,040.00	66,267,040.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	866,782.55	866,782.55
应收利息	-	-	-	-	-	2,754.18	2,754.18
应收申购款	-	-	-	-	-	47,766.82	47,766.82
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,210,930.54	-	-	-	-	67,184,343.55	80,395,274.09

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	165,109.43	165,109.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	100,440.57	100,440.57
应付托管费	-	-	-	-	-	16,740.10	16,740.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,000,412.38	1,000,412.38
其他负债	-	-	-	-	-	240,609.95	240,609.95
负债总计	-	-	-	-	-	1,523,312.43	1,523,312.43
利率敏感度缺口	13,210,930.54	-	-	-	-	-65,661,031.12	78,871,961.66
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	15,113,956.42	-	-	-	-	-	15,113,956.42
结算备付金	1,005,456.41	-	-	-	-	-	1,005,456.41
存出保证金	63,421.41	-	-	-	-	-	63,421.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-96,195,524.59	96,195,524.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	484,306.23	484,306.23
应收利息	-	-	-	-	-	2,379.12	2,379.12
应收申购款	-	-	-	-	-	20,049.63	20,049.63
资产总计	16,182,834.24	-	-	-	-	-96,702,259.57	112,885,093.81
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,717,544.51	7,717,544.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,170,381.95	1,170,381.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	143,816.23	143,816.23
应付托管费	-	-	-	-	-	23,969.37	23,969.37
应付交易费用	-	-	-	-	-	534,795.15	534,795.15
其他负债	-	-	-	-	-	341,135.71	341,135.71
负债总计	-	-	-	-	-	9,931,642.92	9,931,642.92
利率敏感度缺口	16,182,834.24	-	-	-	-	-86,770,616.65	102,953,450.89

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日及 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	66,267,040.00	84.02	96,195,524.59	93.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,267,040.00	84.02	96,195,524.59	93.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,860,018.68	4,707,973.54
业绩比较基准下降 5%	-4,860,018.68	-4,707,973.54	

注：本基金业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 80% + 上证国债指数收益率 × 20%

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 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、其他应收款项类投资

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若。

各层次金融工具公允价值

于 2015 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一层次的余额为人民币 51,327,305.00 元，划分为第二层次的余额为人民币 14,939,735.00 元，无划分为第三层次余额。（于 2014 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一层次的余额为人民币 87,489,589.73 元，划分为第二层次的余额为人民币 8,705,934.86 元，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(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。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	66,267,040.00	82.43
	其中：股票	66,267,040.00	82.43
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,117,172.34	16.32
7	其他各项资产	1,011,061.75	1.26
8	合计	80,395,274.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,052,079.20	2.60
B	采矿业	7,868,877.70	9.98
C	制造业	41,574,968.86	52.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,381,209.00	3.02
J	金融业	7,483,374.44	9.49
K	房地产业	1,858,374.00	2.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,048,156.80	3.86
S	综合	-	-
	合计	66,267,040.00	84.02

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002018	华信国际	196,200	6,003,720.00	7.61
2	002576	通达动力	127,086	4,001,938.14	5.07
3	002691	冀凯股份	141,400	3,570,350.00	4.53
4	600136	道博股份	48,880	3,048,156.80	3.86
5	600816	安信信托	122,800	2,796,156.00	3.55
6	300083	劲胜精密	57,731	2,731,830.92	3.46
7	300219	鸿利光电	165,200	2,631,636.00	3.34
8	300327	中颖电子	65,764	2,610,830.80	3.31
9	300162	雷曼股份	95,300	2,578,818.00	3.27
10	601628	中国人寿	86,786	2,456,911.66	3.12
11	600157	永泰能源	503,457	2,401,489.89	3.04
12	000710	天兴仪表	58,416	2,388,046.08	3.03
13	600756	浪潮软件	46,300	2,381,209.00	3.02
14	600395	盘江股份	280,715	2,304,670.15	2.92
15	601336	新华保险	42,718	2,230,306.78	2.83
16	002509	天广消防	100,300	2,101,285.00	2.66
17	002089	新海宜	92,100	2,073,171.00	2.63
18	002086	东方海洋	69,327	2,052,079.20	2.60
19	300086	康芝药业	114,000	2,006,400.00	2.54
20	000671	阳光城	205,800	1,858,374.00	2.36
21	600766	园城黄金	78,357	1,596,915.66	2.02
22	002098	浔兴股份	102,700	1,587,742.00	2.01
23	002207	准油股份	73,100	1,565,802.00	1.99
24	600475	华光股份	75,400	1,560,026.00	1.98
25	600519	贵州茅台	6,900	1,505,511.00	1.91
26	300192	科斯伍德	87,017	1,411,415.74	1.79
27	002049	同方国芯	20,300	1,221,045.00	1.55
28	600702	沱牌舍得	36,800	842,352.00	1.07
29	002729	好利来	9,878	748,851.18	0.95

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动**8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601628	中国人寿	14,913,968.48	14.49
2	002090	金智科技	13,282,821.66	12.90
3	600446	金证股份	12,038,136.60	11.69
4	300128	锦富新材	11,667,069.00	11.33
5	300219	鸿利光电	11,578,922.29	11.25
6	300086	康芝药业	11,470,134.13	11.14
7	600136	道博股份	11,446,125.14	11.12
8	300131	英唐智控	9,989,681.00	9.70
9	601318	中国平安	9,929,527.00	9.64
10	601688	华泰证券	9,576,829.46	9.30
11	000732	泰禾集团	9,542,380.42	9.27
12	600536	中国软件	9,532,377.35	9.26
13	300261	雅本化学	8,879,043.05	8.62
14	600004	白云机场	8,827,952.10	8.57
15	600077	宋都股份	8,693,468.49	8.44
16	300147	香雪制药	8,677,029.00	8.43
17	300162	雷曼股份	8,496,794.41	8.25
18	002646	青青稞酒	8,394,466.09	8.15
19	600158	中体产业	8,196,136.16	7.96
20	002345	潮宏基	7,946,882.58	7.72
21	300384	三联虹普	7,945,087.00	7.72
22	000728	国元证券	7,943,335.40	7.72
23	000977	浪潮信息	7,856,402.00	7.63
24	300431	暴风科技	7,695,028.50	7.47
25	000887	中鼎股份	7,571,387.74	7.35
26	002207	准油股份	7,460,024.00	7.25
27	600036	招商银行	7,312,285.61	7.10
28	002016	世荣兆业	7,297,895.82	7.09
29	600410	华胜天成	7,172,481.13	6.97
30	601007	金陵饭店	7,072,295.99	6.87
31	300287	飞利信	7,042,554.92	6.84
32	000089	深圳机场	6,969,252.00	6.77
33	300251	光线传媒	6,920,205.28	6.72
34	603588	高能环境	6,910,591.00	6.71

35	601166	兴业银行	6,905,976.00	6.71
36	300240	飞力达	6,890,591.65	6.69
37	300089	文化长城	6,713,532.00	6.52
38	002368	太极股份	6,670,391.60	6.48
39	300217	东方电热	6,576,289.98	6.39
40	300046	台基股份	6,574,178.00	6.39
41	002739	万达院线	6,414,851.00	6.23
42	600825	新华传媒	6,346,143.20	6.16
43	300104	乐视网	6,309,431.83	6.13
44	002612	朗姿股份	6,225,040.19	6.05
45	002018	华信国际	6,196,536.00	6.02
46	300094	国联水产	6,079,985.76	5.91
47	300254	仟源医药	6,048,698.60	5.88
48	600661	新南洋	6,037,526.00	5.86
49	600557	康缘药业	6,017,556.00	5.84
50	601336	新华保险	5,900,713.40	5.73
51	600818	中路股份	5,888,481.50	5.72
52	002638	勤上光电	5,722,054.00	5.56
53	300369	绿盟科技	5,572,922.00	5.41
54	600885	宏发股份	5,502,081.00	5.34
55	002707	众信旅游	5,454,264.00	5.30
56	002292	奥飞动漫	5,295,025.09	5.14
57	000060	中金岭南	5,290,967.30	5.14
58	000712	锦龙股份	5,287,098.76	5.14
59	600570	恒生电子	5,281,731.85	5.13
60	300151	昌红科技	5,169,924.00	5.02
61	300192	科斯伍德	5,156,624.72	5.01
62	601601	中国太保	5,089,893.84	4.94
63	000488	晨鸣纸业	5,052,266.00	4.91
64	002031	巨轮智能	5,039,056.44	4.89
65	600958	东方证券	5,038,451.00	4.89
66	002509	天广消防	4,934,460.00	4.79
67	300253	卫宁软件	4,865,177.00	4.73
68	000718	苏宁环球	4,856,553.05	4.72
69	600798	宁波海运	4,836,060.84	4.70
70	600687	刚泰控股	4,720,963.00	4.59

71	601818	光大银行	4,717,268.00	4.58
72	600185	格力地产	4,705,551.96	4.57
73	002065	东华软件	4,696,708.67	4.56
74	002095	生意宝	4,636,116.69	4.50
75	600897	厦门空港	4,617,659.05	4.49
76	600307	酒钢宏兴	4,597,197.84	4.47
77	600104	上汽集团	4,566,141.00	4.44
78	000002	万科A	4,496,068.00	4.37
79	300182	捷成股份	4,474,819.00	4.35
80	600501	航天晨光	4,447,698.84	4.32
81	000023	深天地A	4,408,197.72	4.28
82	000056	皇庭国际	4,393,333.51	4.27
83	000655	金岭矿业	4,313,646.60	4.19
84	600062	华润双鹤	4,312,741.00	4.19
85	002034	美欣达	4,291,474.00	4.17
86	300457	赢合科技	4,282,048.16	4.16
87	300001	特锐德	4,246,104.50	4.12
88	600391	成发科技	4,236,712.20	4.12
89	600080	金花股份	4,203,168.46	4.08
90	000670	盈方微	4,110,807.00	3.99
91	300033	同花顺	4,100,504.00	3.98
92	002405	四维图新	4,055,135.24	3.94
93	000540	中天城投	4,052,255.00	3.94
94	002512	达华智能	4,006,686.00	3.89
95	600109	国金证券	3,929,728.00	3.82
96	601398	工商银行	3,889,236.00	3.78
97	000710	天兴仪表	3,869,022.01	3.76
98	002154	报喜鸟	3,814,245.35	3.70
99	002631	德尔未来	3,749,461.00	3.64
100	002431	棕榈园林	3,747,410.00	3.64
101	300010	立思辰	3,741,816.00	3.63
102	300171	东富龙	3,740,513.00	3.63
103	600837	海通证券	3,727,252.00	3.62
104	002202	金风科技	3,672,508.00	3.57
105	002279	久其软件	3,665,495.80	3.56
106	300073	当升科技	3,663,460.98	3.56

107	300312	邦讯技术	3,522,150.90	3.42
108	600518	康美药业	3,513,828.36	3.41
109	600366	宁波韵升	3,511,415.19	3.41
110	600816	安信信托	3,503,627.34	3.40
111	002227	奥特迅	3,493,460.00	3.39
112	002118	紫鑫药业	3,485,744.00	3.39
113	002576	通达动力	3,451,932.94	3.35
114	603077	和邦生物	3,416,271.00	3.32
115	600259	广晟有色	3,408,183.99	3.31
116	000733	振华科技	3,406,572.00	3.31
117	002329	皇氏集团	3,403,417.50	3.31
118	600208	新湖中宝	3,320,811.00	3.23
119	600767	运盛医疗	3,286,648.00	3.19
120	600005	武钢股份	3,277,125.00	3.18
121	000686	东北证券	3,273,830.00	3.18
122	002302	西部建设	3,253,474.00	3.16
123	600395	盘江股份	3,232,373.96	3.14
124	002051	中工国际	3,229,765.00	3.14
125	600157	永泰能源	3,225,401.40	3.13
126	300238	冠昊生物	3,224,942.00	3.13
127	002136	安纳达	3,200,147.59	3.11
128	300036	超图软件	3,182,831.60	3.09
129	600180	瑞茂通	3,167,281.61	3.08
130	600736	苏州高新	3,158,980.00	3.07
131	300274	阳光电源	3,141,839.00	3.05
132	002439	启明星辰	3,130,331.68	3.04
133	300376	易事特	3,130,066.17	3.04
134	600895	张江高科	3,117,572.00	3.03
135	600571	信雅达	3,107,184.74	3.02
136	002230	科大讯飞	3,094,017.00	3.01
137	002454	松芝股份	3,092,276.00	3.00
138	600026	中海发展	3,086,981.00	3.00
139	002436	兴森科技	3,082,062.00	2.99
140	600503	华丽家族	3,071,124.00	2.98
141	600172	黄河旋风	3,069,883.98	2.98
142	000657	中钨高新	3,058,686.00	2.97

143	002001	新 和 成	3,046,607.00	2.96
144	000024	招商地产	3,046,367.00	2.96
145	601139	深圳燃气	3,043,471.90	2.96
146	002566	益盛药业	3,041,302.00	2.95
147	002237	恒邦股份	3,041,103.00	2.95
148	600266	北京城建	3,039,293.00	2.95
149	600999	招商证券	3,036,936.00	2.95
150	300458	全志科技	3,033,212.00	2.95
151	600260	凯乐科技	3,030,415.00	2.94
152	002215	诺 普 信	3,028,030.34	2.94
153	002086	东方海洋	3,027,103.00	2.94
154	601985	中国核电	3,014,397.00	2.93
155	002691	冀凯股份	3,008,148.00	2.92
156	002550	千红制药	2,988,833.00	2.90
157	600549	厦门钨业	2,988,629.70	2.90
158	000050	深天马A	2,976,066.00	2.89
159	601088	中国神华	2,959,814.00	2.87
160	600663	陆家嘴	2,930,498.00	2.85
161	002074	国轩高科	2,913,415.00	2.83
162	000970	中科三环	2,884,837.20	2.80
163	600688	上海石化	2,869,433.00	2.79
164	600766	园城黄金	2,864,346.00	2.78
165	002037	久联发展	2,864,145.20	2.78
166	300059	东方财富	2,858,310.00	2.78
167	600150	中国船舶	2,854,368.00	2.77
168	002276	万马股份	2,852,428.48	2.77
169	600030	中信证券	2,826,197.00	2.75
170	002208	合肥城建	2,825,397.00	2.74
171	600234	山水文化	2,818,199.00	2.74
172	000759	中百集团	2,782,132.00	2.70
173	300126	锐奇股份	2,778,148.96	2.70
174	002291	星期六	2,776,875.77	2.70
175	002348	高乐股份	2,750,390.00	2.67
176	600090	啤酒花	2,742,511.00	2.66
177	002197	证通电子	2,730,982.00	2.65
178	300300	汉鼎股份	2,725,567.00	2.65

179	002308	威创股份	2,702,894.00	2.63
180	600028	中国石化	2,686,986.00	2.61
181	300027	华谊兄弟	2,685,318.00	2.61
182	002648	卫星石化	2,667,866.00	2.59
183	600741	华域汽车	2,656,264.00	2.58
184	601006	大秦铁路	2,655,226.91	2.58
185	300294	博雅生物	2,651,035.00	2.57
186	002304	洋河股份	2,612,921.20	2.54
187	002445	中南重工	2,596,087.00	2.52
188	600718	东软集团	2,558,847.45	2.49
189	002216	三全食品	2,525,824.34	2.45
190	600399	抚顺特钢	2,503,832.00	2.43
191	002139	拓邦股份	2,502,795.00	2.43
192	000783	长江证券	2,485,119.00	2.41
193	000926	福星股份	2,471,276.04	2.40
194	600988	赤峰黄金	2,459,690.00	2.39
195	000868	安凯客车	2,441,149.00	2.37
196	300183	东软载波	2,437,448.50	2.37
197	300028	金亚科技	2,387,240.00	2.32
198	300414	中光防雷	2,383,508.00	2.32
199	600815	厦工股份	2,370,368.00	2.30
200	300205	天喻信息	2,360,955.00	2.29
201	600000	浦发银行	2,341,514.00	2.27
202	002234	民和股份	2,329,827.00	2.26
203	600528	中铁二局	2,326,118.00	2.26
204	600756	浪潮软件	2,326,030.64	2.26
205	300083	劲胜精密	2,323,169.00	2.26
206	002514	宝馨科技	2,322,084.15	2.26
207	000800	一汽轿车	2,305,757.00	2.24
208	300379	东方通	2,258,547.00	2.19
209	002462	嘉事堂	2,252,940.00	2.19
210	300207	欣旺达	2,250,427.00	2.19
211	002456	欧菲光	2,223,343.00	2.16
212	600176	中国巨石	2,223,313.00	2.16
213	002231	奥维通信	2,212,213.00	2.15
214	300327	中颖电子	2,208,615.00	2.15

215	600198	大唐电信	2,199,211.00	2.14
216	300302	同有科技	2,197,647.48	2.13
217	002381	双箭股份	2,195,668.00	2.13
218	600067	冠城大通	2,169,025.00	2.11
219	600737	中粮屯河	2,118,866.55	2.06
220	000558	莱茵体育	2,105,255.62	2.04
221	600598	*ST 大荒	2,099,331.00	2.04
222	002094	青岛金王	2,087,642.00	2.03
223	600855	航天长峰	2,083,370.00	2.02
224	600588	用友网络	2,077,052.00	2.02
225	601328	交通银行	2,068,929.00	2.01

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600536	中国软件	14,875,608.88	14.45
2	601318	中国平安	14,197,461.00	13.79
3	300151	昌红科技	13,718,726.41	13.33
4	002090	金智科技	12,645,007.65	12.28
5	601628	中国人寿	12,638,218.55	12.28
6	600136	道博股份	11,880,711.96	11.54
7	601688	华泰证券	11,713,171.16	11.38
8	600818	中路股份	11,685,887.63	11.35
9	300219	鸿利光电	11,640,663.99	11.31
10	002031	巨轮智能	11,362,070.17	11.04
11	600446	金证股份	11,334,478.21	11.01
12	600036	招商银行	10,347,399.58	10.05
13	300104	乐视网	10,262,549.64	9.97
14	000977	浪潮信息	10,138,825.53	9.85
15	002345	潮宏基	10,126,656.57	9.84
16	000732	泰禾集团	10,042,506.93	9.75
17	000887	中鼎股份	9,906,532.88	9.62
18	300089	文化长城	9,839,602.22	9.56
19	002646	青青稞酒	9,785,051.98	9.50

20	002612	朗姿股份	9,776,515.40	9.50
21	300086	康芝药业	9,663,935.51	9.39
22	600158	中体产业	9,395,956.81	9.13
23	601007	金陵饭店	9,361,882.73	9.09
24	300131	英唐智控	9,161,148.16	8.90
25	600077	宋都股份	9,041,527.14	8.78
26	300431	暴风科技	8,778,256.37	8.53
27	300094	国联水产	8,742,492.36	8.49
28	300147	香雪制药	8,671,394.01	8.42
29	300162	雷曼股份	8,527,684.27	8.28
30	300369	绿盟科技	8,450,731.49	8.21
31	600004	白云机场	8,383,628.38	8.14
32	300240	飞力达	8,358,455.26	8.12
33	600661	新南洋	8,204,368.86	7.97
34	000728	国元证券	8,181,085.41	7.95
35	002095	生意宝	7,939,739.02	7.71
36	600410	华胜天成	7,847,500.96	7.62
37	601818	光大银行	7,783,480.42	7.56
38	000089	深圳机场	7,715,749.60	7.49
39	300287	飞利信	7,607,742.01	7.39
40	000540	中天城投	7,587,657.68	7.37
41	600570	恒生电子	7,541,626.54	7.33
42	002207	准油股份	7,367,018.15	7.16
43	002279	久其软件	7,331,841.79	7.12
44	603588	高能环境	7,086,882.71	6.88
45	002368	太极股份	7,041,568.81	6.84
46	601166	兴业银行	6,977,647.75	6.78
47	600825	新华传媒	6,940,771.16	6.74
48	300251	光线传媒	6,882,295.07	6.68
49	002016	世荣兆业	6,787,218.87	6.59
50	300128	锦富新材	6,766,643.94	6.57
51	000002	万科A	6,713,907.97	6.52
52	002638	勤上光电	6,437,331.09	6.25
53	300217	东方电热	6,425,358.96	6.24
54	600109	国金证券	6,161,219.67	5.98
55	002739	万达院线	6,124,009.02	5.95
56	000718	苏宁环球	6,071,835.08	5.90
57	000712	锦龙股份	5,957,386.43	5.79

58	002292	奥飞动漫	5,898,924.19	5.73
59	000655	金岭矿业	5,700,948.25	5.54
60	600557	康缘药业	5,666,189.85	5.50
61	600259	广晟有色	5,646,738.80	5.48
62	002707	众信旅游	5,550,021.98	5.39
63	600798	宁波海运	5,442,744.90	5.29
64	002065	东华软件	5,404,118.66	5.25
65	600958	东方证券	5,398,651.89	5.24
66	300033	同花顺	5,344,652.41	5.19
67	600185	格力地产	5,321,123.60	5.17
68	601088	中国神华	5,317,017.73	5.16
69	600885	宏发股份	5,307,902.24	5.16
70	300253	卫宁软件	5,202,536.41	5.05
71	600000	浦发银行	5,184,270.96	5.04
72	300171	东富龙	5,028,110.71	4.88
73	000060	中金岭南	4,952,111.11	4.81
74	601601	中国太保	4,911,644.26	4.77
75	300046	台基股份	4,905,256.57	4.76
76	300261	雅本化学	4,899,778.84	4.76
77	300182	捷成股份	4,858,671.76	4.72
78	000967	上风高科	4,846,307.86	4.71
79	300384	三联虹普	4,801,163.68	4.66
80	002034	美欣达	4,752,498.94	4.62
81	000759	中百集团	4,739,301.34	4.60
82	002329	皇氏集团	4,713,082.09	4.58
83	300192	科斯伍德	4,659,842.23	4.53
84	000056	皇庭国际	4,647,664.93	4.51
85	601918	国投新集	4,643,974.45	4.51
86	600062	华润双鹤	4,447,961.50	4.32
87	300254	仟源医药	4,435,898.31	4.31
88	600104	上汽集团	4,411,580.28	4.29
89	000023	深天地A	4,390,251.15	4.26
90	600366	宁波韵升	4,220,151.93	4.10
91	600501	航天晨光	4,207,238.59	4.09
92	600080	金花股份	4,182,587.29	4.06
93	601336	新华保险	4,035,789.10	3.92
94	300010	立思辰	3,992,433.04	3.88
95	600391	成发科技	3,984,317.28	3.87

96	300001	特锐德	3,964,044.02	3.85
97	600767	运盛医疗	3,942,569.71	3.83
98	002405	四维图新	3,934,985.46	3.82
99	000670	盈方微	3,905,930.29	3.79
100	002512	达华智能	3,894,762.32	3.78
101	600518	康美药业	3,876,048.00	3.76
102	600687	刚泰控股	3,871,285.34	3.76
103	002136	安纳达	3,847,986.18	3.74
104	601398	工商银行	3,829,063.20	3.72
105	600111	北方稀土	3,819,227.78	3.71
106	002215	诺普信	3,805,121.61	3.70
107	002631	德尔未来	3,785,249.11	3.68
108	300312	邦讯技术	3,767,093.01	3.66
109	000733	振华科技	3,746,780.49	3.64
110	600688	上海石化	3,738,633.16	3.63
111	600716	凤凰股份	3,711,407.48	3.60
112	002154	报喜鸟	3,704,527.91	3.60
113	002439	启明星辰	3,689,736.25	3.58
114	002202	金风科技	3,652,093.67	3.55
115	300458	全志科技	3,623,611.62	3.52
116	603077	和邦生物	3,615,330.99	3.51
117	600208	新湖中宝	3,574,028.00	3.47
118	300302	同有科技	3,563,283.23	3.46
119	002118	紫鑫药业	3,544,727.11	3.44
120	002678	珠江钢琴	3,510,716.64	3.41
121	002462	嘉事堂	3,448,522.17	3.35
122	000710	天兴仪表	3,422,198.24	3.32
123	600999	招商证券	3,410,880.00	3.31
124	300036	超图软件	3,409,491.53	3.31
125	002291	星期六	3,371,946.31	3.28
126	000686	东北证券	3,357,196.52	3.26
127	002074	国轩高科	3,343,697.27	3.25
128	000488	晨鸣纸业	3,335,494.38	3.24
129	000024	招商地产	3,317,970.52	3.22
130	300457	赢合科技	3,286,258.03	3.19
131	600180	瑞茂通	3,274,028.30	3.18
132	600005	武钢股份	3,249,169.00	3.16
133	300376	易事特	3,242,493.84	3.15

134	000970	中科三环	3,218,520.42	3.13
135	300073	当升科技	3,203,111.35	3.11
136	300294	博雅生物	3,198,375.64	3.11
137	300300	汉鼎股份	3,189,502.12	3.10
138	002566	益盛药业	3,176,608.14	3.09
139	300274	阳光电源	3,171,513.40	3.08
140	600571	信雅达	3,158,604.43	3.07
141	300059	东方财富	3,158,190.14	3.07
142	600172	黄河旋风	3,138,886.90	3.05
143	601985	中国核电	3,115,639.89	3.03
144	002227	奥特迅	3,106,731.02	3.02
145	002657	中科金财	3,073,695.94	2.99
146	600837	海通证券	3,055,646.23	2.97
147	600736	苏州高新	3,044,393.11	2.96
148	600503	华丽家族	3,034,718.01	2.95
149	002302	西部建设	3,020,694.14	2.93
150	600026	中海发展	3,019,518.94	2.93
151	000657	中钨高新	2,994,222.62	2.91
152	300379	东方通	2,989,483.20	2.90
153	601139	深圳燃气	2,967,502.62	2.88
154	300126	锐奇股份	2,966,568.04	2.88
155	002001	新和成	2,946,038.82	2.86
156	600266	北京城建	2,938,336.84	2.85
157	600090	啤酒花	2,933,538.07	2.85
158	002648	卫星石化	2,917,041.01	2.83
159	600897	厦门空港	2,909,287.45	2.83
160	000001	平安银行	2,880,104.00	2.80
161	300027	华谊兄弟	2,871,847.00	2.79
162	600895	张江高科	2,836,990.55	2.76
163	002230	科大讯飞	2,817,613.42	2.74
164	002509	天广消防	2,795,544.45	2.72
165	600761	安徽合力	2,793,815.42	2.71
166	600021	上海电力	2,783,525.11	2.70
167	002308	威创股份	2,782,487.53	2.70
168	600549	厦门钨业	2,782,039.26	2.70
169	002454	松芝股份	2,778,886.85	2.70
170	601377	兴业证券	2,762,048.63	2.68
171	600028	中国石化	2,724,246.78	2.65

172	002445	中南重工	2,719,181.89	2.64
173	600718	东软集团	2,717,462.71	2.64
174	000150	宜华健康	2,715,241.90	2.64
175	002208	合肥城建	2,704,536.75	2.63
176	600030	中信证券	2,692,901.48	2.62
177	300207	欣旺达	2,683,703.79	2.61
178	601939	建设银行	2,664,790.42	2.59
179	002304	洋河股份	2,662,797.28	2.59
180	002276	万马股份	2,644,588.29	2.57
181	002037	久联发展	2,615,148.07	2.54
182	600150	中国船舶	2,612,043.04	2.54
183	002216	三全食品	2,592,916.00	2.52
184	600399	抚顺特钢	2,591,764.00	2.52
185	300205	天喻信息	2,561,603.16	2.49
186	601006	大秦铁路	2,529,871.68	2.46
187	002237	恒邦股份	2,519,889.89	2.45
188	002514	宝馨科技	2,513,752.07	2.44
189	600988	赤峰黄金	2,505,059.12	2.43
190	002436	兴森科技	2,503,488.87	2.43
191	002366	台海核电	2,499,565.07	2.43
192	002348	高乐股份	2,499,196.10	2.43
193	002051	中工国际	2,495,575.45	2.42
194	002431	棕榈园林	2,490,080.45	2.42
195	002550	千红制药	2,483,518.34	2.41
196	600048	保利地产	2,481,642.37	2.41
197	000783	长江证券	2,474,602.26	2.40
198	300238	冠昊生物	2,447,229.16	2.38
199	000926	福星股份	2,445,658.38	2.38
200	002234	民和股份	2,442,248.43	2.37
201	601901	方正证券	2,431,566.97	2.36
202	000915	山大华特	2,420,474.11	2.35
203	000050	深天马A	2,403,389.12	2.33
204	600234	山水文化	2,400,921.74	2.33
205	600307	酒钢宏兴	2,360,250.00	2.29
206	600663	陆家嘴	2,342,306.18	2.28
207	000800	一汽轿车	2,328,546.50	2.26
208	600198	大唐电信	2,325,442.35	2.26
209	002701	奥瑞金	2,314,188.85	2.25

210	002139	拓邦股份	2,298,187.59	2.23
211	300414	中光防雷	2,294,576.75	2.23
212	300183	东软载波	2,284,216.49	2.22
213	000868	安凯客车	2,258,642.48	2.19
214	600067	冠城大通	2,241,765.53	2.18
215	002231	奥维通信	2,236,817.94	2.17
216	300328	宜安科技	2,230,809.96	2.17
217	600588	用友网络	2,206,935.66	2.14
218	300353	东土科技	2,181,793.88	2.12
219	600741	华域汽车	2,178,377.58	2.12
220	000612	焦作万方	2,171,393.17	2.11
221	000425	徐工机械	2,170,899.57	2.11
222	000528	柳工	2,139,817.75	2.08
223	002363	隆基机械	2,135,718.86	2.07
224	300348	长亮科技	2,127,606.00	2.07
225	000558	莱茵体育	2,123,915.47	2.06
226	600176	中国巨石	2,122,882.62	2.06
227	002381	双箭股份	2,122,437.98	2.06
228	601169	北京银行	2,122,148.14	2.06
229	300066	三川股份	2,100,514.05	2.04
230	600815	厦工股份	2,092,396.00	2.03
231	002310	东方园林	2,085,581.68	2.03
232	002428	云南锗业	2,072,404.85	2.01
233	002456	欧菲光	2,063,958.39	2.00

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,240,008,503.52
卖出股票收入（成交）总额	1,332,891,954.33

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	93,758.20
2	应收证券清算款	866,782.55

3	应收股利	-
4	应收利息	2,754.18
5	应收申购款	47,766.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,011,061.75

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	6,003,720.00	7.61	重大事项
2	002691	冀凯股份	3,570,350.00	4.53	重大事项
3	300162	雷曼股份	2,578,818.00	3.27	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,747	13,832.87	1,157,008.56	2.23%	50,674,743.01	97.77%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	73.30	0.0001%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月29日）基金份额总额	775,700,225.52
本报告期期初基金份额总额	103,930,515.70
本报告期基金总申购份额	188,899,277.29
减:本报告期基金总赎回份额	240,998,041.42
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	51,831,751.57

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年1月23日，本基金管理人发布公告，解聘俞岱曦先生总经理职务，由公司董事长万青元先生代为履行总经理职务。

2015年2月27日，本基金管理人发布公告，原副总经理朱晓光先生转任公司监事会主席。

2015年6月18日，本基金管理人发布公告，解聘吴剑飞先生副总经理职务。

2015年7月23日，本基金管理人发布公告，聘任吴剑飞先生为民生加银基金管理有限公司总经理。

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期支付给安永华明会计师事务所的报酬为 40,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 4 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到中国证券监督管理委员会《关于对民生加银基金管理有限公司采取责令整改及暂不受理行政许可措施的决定》，责令本公司进行为期三个月的整改，整改期间暂停受理及审核基金产品的募集申请。公司已在规定时间内完成整改，并向中国证券监督管理委员会及中国证券监督管理委员会深圳监管局报送整改报告，2015 年 11 月 6 日整改期结束。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	569,903,323.82	22.15%	522,934.78	22.15%	-
广发证券股份有限公司	1	486,455,663.87	18.91%	444,393.68	18.83%	-
东方证券股份有限公司	1	120,858,950.78	4.70%	112,556.53	4.77%	-
长江证券股份有限公司	1	968,881,562.61	37.66%	889,848.03	37.70%	-
光大证券光大证券股份有限公司	1	426,800,956.77	16.59%	390,875.69	16.56%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	116,200,000.00	33.60%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券光大证券股份有限公司	-	-	229,600,000.00	66.40%	-	-

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即： i 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币； ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告； iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定； iv 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求； v 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。② 券商专用交易单元选择程序： i 投研能力打分：由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分，填写《券商评价表》 ii 指定租用方案：由交易部根据评价结果，结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案； iii 公司领导审批：公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见； iv 交易部洽谈：交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈，并起草相关书面协议； v 律师审议：席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计； vi 交易部经办：席位租用协议生效后，由交易部专人与券商进行联系，具体办理租用手续； vii 连通测试：信息技术部接到交易部通知后，将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试； viii 通知托管行：信息技术部测试通过后，应及时通知投资部、交易部及运营部，由运营部通知托管行有关席位的具体信息； ix 席位启用：交易席位正式使用，投资部、交易部、运营部有关人员须提

前做好席位启用的准备工作。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司旗下基金 2014 年 12 月 31 日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
2	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“凤凰股份”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 6 日
3	民生加银基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上直销申购费率优惠期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 16 日
4	民生加银稳健成长股票型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 22 日
5	民生加银基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 23 日
6	民生加银基金管理有限公司关于资产支持证券投资方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 30 日
7	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加英大证券有限责任公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 3 日
8	民生加银基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 2 月 7 日

		报、公司网站	
9	民生加银稳健成长股票型证券投资基金更新招募说明书及摘要 (2015 年第 1 号)	中国证券报、公司网站	2015 年 2 月 13 日
10	民生加银基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 17 日
11	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“久其软件”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 2 月 17 日
12	民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 27 日
13	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“中鼎股份”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 19 日
14	民生加银稳健成长股票型证券投资基金 2014 年年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 26 日
15	民生加银基金管理有限公司关于旗下证券投资基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 31 日
16	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“朗姿股份”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 4 月 7 日

17	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加日发资产管理(上海)有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年4月8日
18	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年4月17日
19	民生加银稳健成长股票型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2015年4月21日
20	民生加银基金管理有限公司关于开展直销网上交易系统基金转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年4月23日
21	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“三特索道”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年4月23日
22	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“潮宏基”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年4月24日
23	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“飞力达”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年5月6日
24	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“长城集团”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年5月8日

25	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“朗姿股份”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年5月13日
26	关于公司网站进行系统维护及网上直销、网上查询和网上交易系统暂停服务的公告	公司网站	2015年5月15日
27	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“潮宏基”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年5月27日
28	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“暴风科技”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年6月17日
29	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“华信国际”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年6月17日
30	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“信雅达”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年6月17日
31	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“英唐智控”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年6月17日
32	民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2015年6月18日

		报、公司网站	
33	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“中鼎股份”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年7月1日
34	民生加银基金管理有限公司旗下证券投资基金 2015 年 6 月 30 日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年7月1日
35	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“宁波韵升”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年7月2日
36	民生加银基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年7月4日
37	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“锦富新材”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年7月4日
38	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“达华智能”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015年7月7日
39	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“英唐智控”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年7月7日
40	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“金智科	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2015年7月8日

	技” 停牌后估值方法变更的提示性公告	报、公司网站	
41	民生加银基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 8 日
42	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 9 日
43	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 10 日
44	民生加银稳健成长股票型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证券报、公司网站	2015 年 7 月 17 日
45	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 21 日
46	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 21 日
47	民生加银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 23 日
48	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券	2015 年 7 月 27 日

	旗下部分开放式基金增加上海汇付金融服务有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站	
49	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加兴业银行股份有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 27 日
50	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 7 月 29 日
51	民生加银稳健成长股票型证券投资基金更名的公告	中国证券报、公司网站	2015 年 8 月 8 日
52	民生加银稳健成长混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2015 年 8 月 8 日
53	民生加银稳健成长股票型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、公司网站	2015 年 8 月 12 日
54	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加微动利为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 13 日
55	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天天基金网费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 25 日

56	民生加银稳健成长股票型证券投资基金 2015 年半年度报告	中国证券报、公司网站	2015 年 8 月 25 日
57	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 25 日
58	民生加银基金管理有限公司关于养老金账户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 27 日
59	民生加银基金管理有限公司关于中信证券（浙江）有限责任公司并入中信证券股份有限公司期间基金业务安排的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 8 月 28 日
60	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 1 日
61	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 16 日
62	民生加银基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金变更代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 17 日
63	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 9 月 29 日

	惠活动的公告		
64	民生加银稳健成长混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证券报、公司网站	2015 年 10 月 27 日
65	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 10 月 31 日
66	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金开通定投和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 3 日
67	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 5 日
68	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 11 月 9 日
69	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 10 日
70	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 11 月 11 日
71	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券	2015 年 11 月 25 日

	旗下部分开放式基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站	
72	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 12 月 12 日
73	民生加银基金管理有限公司关于旗下公募基金调整开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 13.1.2 《民生加银稳健成长混合型证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《民生加银稳健成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 13.1.4 《民生加银稳健成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 13.1.5 法律意见书；
- 13.1.6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 13.1.7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司
2016年3月30日