

民生加银精选混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	40
7.7 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.....	41
7.8 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.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 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.....	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银精选混合型证券投资基金
基金简称	民生加银精选混合
基金主代码	690003
交易代码	690003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 3 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	191,092,879.70 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，追求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置与行业配置以及自下而上的个股精选相结合的策略，进行积极主动资产管理。 本基金在个股选择上采取自下而上的股票精选策略，通过构建初选股票池、精选股票池，从基本面角度筛选出具有核心竞争力优势企业，并通过估值水平和流动性筛选个股，构建股票投资组合，最后通过风险评估优化股票投资组合。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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	田青
	联系电话	0755-23999888	010-67595096
	电子邮箱	linhai@msjyfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096
传真		0755-23999800	010-66275853
注册地址		深圳市福田区益田路西、福	北京市西城区金融大街 25 号

	中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	
办公地址	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	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518026	100033
法定代表人	万青元	王洪章

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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	http://www.msjyfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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新世界商务中 心 42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-32,825,496.28
本期利润	-39,628,162.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1995
本期加权平均净值利润率	-18.60%
本期基金份额净值增长率	-15.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,823,354.99
期末可供分配基金份额利润	0.1351
期末基金资产净值	216,916,234.69
期末基金份额净值	1.135
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	13.50%

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 6 月 30 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

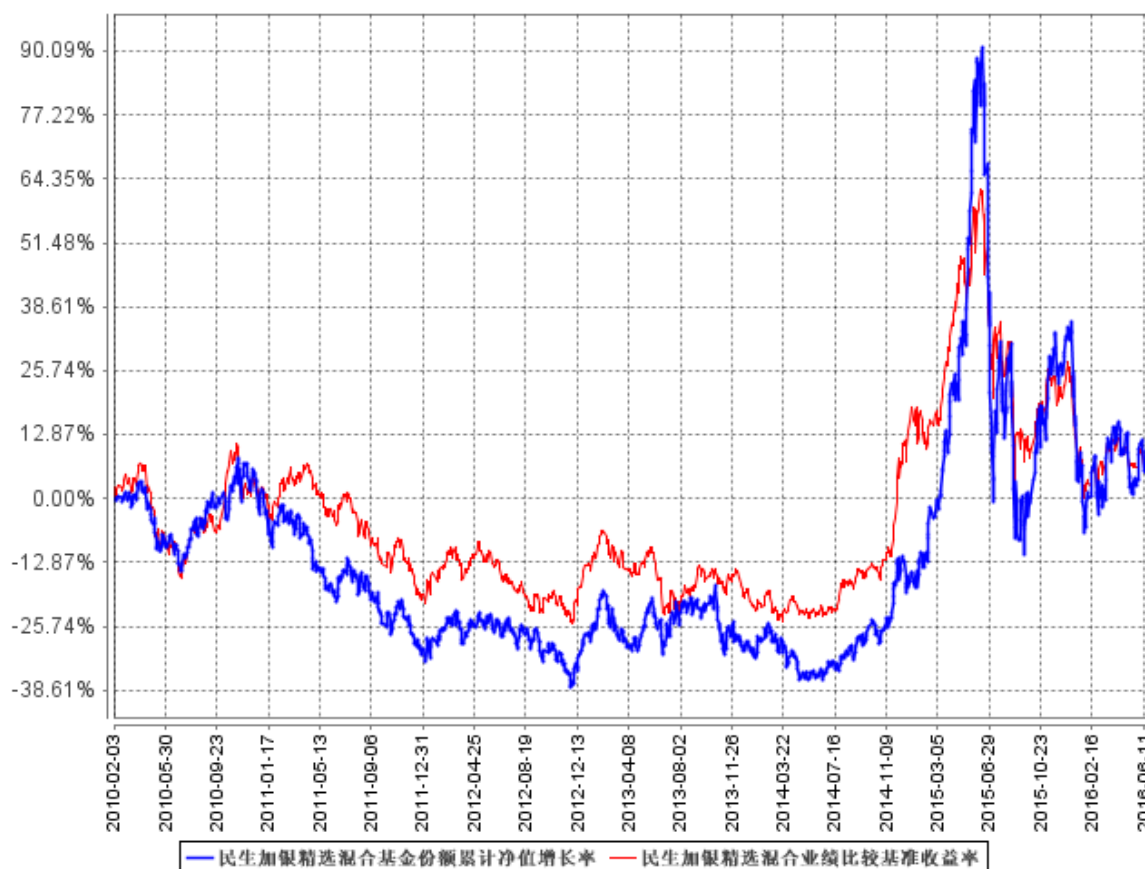
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	4.42%	1.63%	-0.32%	0.78%	4.74%	0.85%
过去三个月	2.16%	1.72%	-1.42%	0.81%	3.58%	0.91%
过去六个月	-15.17%	2.60%	-11.93%	1.47%	-3.24%	1.13%
过去一年	-19.67%	3.08%	-22.77%	1.84%	3.10%	1.24%
过去三年	61.45%	2.27%	39.74%	1.47%	21.71%	0.80%
自基金合同生效起至今	13.50%	1.80%	8.91%	1.30%	4.59%	0.50%

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

民生加银精选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 2 月 3 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束及本报告期末，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。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 29 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、民生加银和鑫债券型证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫瑞债券型证券投资基金、民生加银现金添利货币市场基金。

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	2014 年 7 月 7 日	-	10 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 公平交易制度的执行情况

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内的公平交易程序，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。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 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

2016 年是供给侧改革的开局之年，大量落后产能出清将会造成短期经济阵痛期，尽管财政政策始终保持积极，基建投资对经济回落起到一定对冲，但整体来看，全年宏观经济将大概率维持“L”型，股票市场作为反映宏观经济的晴雨表，明显受制于宏观经济回落风险。

伴随着我国改革进入深水区，创新将逐步成为未来发展的新动力和新常态，这将引领未来发

展的新兴行业的投资机会，比如国家大力支持的新能源汽车行业，OLED 产业，与此同时，随着供给侧的改革和稳增长的政策实施，传统的周期品在经历了多年调整后重新焕发了活力，带来了新的投资机遇，比如煤炭，有色金属行业都是在沉寂多年后重新焕发了活力。

在经历了 2015 年的大起大落行情之后，2016 年的市场更加趋于理性，市场重新回归价值，在增量资金不明显的情况下，业绩超预期增长的标的将是市场青睐的对象。

在此背景下，本基金秉持两个方法，即：一、通过深入分析行业、公司成长前景，挖掘新经济增长亮点，寻找 A 股市场上的投资亮点，本基金将在努力寻找新兴行业的亮点的同时，努力发掘传统行业在重新焕发活力后产生的新的亮点；二、通过对于基本面和业绩的紧密跟踪，控制组合的整体估值风险，控制净值波动风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.135 元，本报告期内份额净值增长率为-15.17%，同期业绩比较基准收益率为-11.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，随着经济的触底回升，人民币汇率的逐步企稳，G20 峰会的召开，我们认为二级市场将孕育更多的投资机会，本基金将通过深入分析，发掘有价值的投资标的进行投资，同时，我们会谨防各类风险，力争为投资者带来较好回报。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：民生加银精选混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	27,114,478.01	39,885,901.44
结算备付金		563,807.99	3,225,238.34
存出保证金		274,228.12	553,270.43
交易性金融资产	6.4.7.2	190,618,711.46	222,326,512.86
其中：股票投资		190,618,711.46	222,326,512.86
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,892,611.54
应收利息	6.4.7.5	7,241.65	9,310.47
应收股利		-	-
应收申购款		479,165.55	165,024.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		219,057,632.78	269,057,869.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		337.76	-
应付赎回款		1,097,099.89	864,853.79
应付管理人报酬		264,206.26	332,032.69
应付托管费		44,034.37	55,338.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	563,280.56	3,365,881.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	172,439.25	441,557.35
负债合计		2,141,398.09	5,059,663.80
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	191,092,879.70	197,281,257.17
未分配利润	6.4.7.10	25,823,354.99	66,716,948.96
所有者权益合计		216,916,234.69	263,998,206.13
负债和所有者权益总计		219,057,632.78	269,057,869.93

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 191,092,879.70 份，基金份额净值人民币 1.135 元。

6.2 利润表

会计主体：民生加银精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-34,973,197.50	259,162,935.94
1.利息收入		147,640.03	276,513.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	137,064.31	207,070.52
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		10,575.72	69,442.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-28,340,030.98	306,426,384.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-28,989,292.76	305,253,872.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	649,261.78	1,172,512.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,802,666.11	-47,745,105.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	21,859.56	205,143.66
减：二、费用		4,654,964.89	11,738,465.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,590,849.87	3,479,372.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	265,141.61	579,895.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,616,912.42	7,482,433.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	182,060.99	196,764.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-39,628,162.39	247,424,470.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-39,628,162.39	247,424,470.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银精选混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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)	197,281,257.17	66,716,948.96	263,998,206.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-39,628,162.39	-39,628,162.39
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)	-6,188,377.47	-1,265,431.58	-7,453,809.05
其中：1.基金申购款	19,119,484.07	1,253,894.90	20,373,378.97
2.基金赎回款	-25,307,861.54	-2,519,326.48	-27,827,188.02
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)	191,092,879.70	25,823,354.99	216,916,234.69
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	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)	555,796,075.27	-93,234,182.27	462,561,893.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	247,424,470.03	247,424,470.03
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)	-309,637,006.39	-52,633,652.03	-362,270,658.42
其中：1.基金申购款	166,969,865.94	81,934,363.53	248,904,229.47
2.基金赎回款	-476,606,872.33	-134,568,015.56	-611,174,887.89
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)	246,159,068.88	101,556,635.73	347,715,704.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原民生加银精选股票型证券投资基金更名而来,该更名事项已经相关基金托管人同意,并报中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)备案,并于 2015 年 8 月 8 日进行了公告。基金管理人民生加银基金管理有限公司对上述基金的基金合同、托管协议等文件的基金名称、基金类型、基金的风险收益特征描述、基金托管人信息等内容进行修订和更新。

原民生加银精选股票型证券投资基金系经中国证监会证监许可[2009]1323 号文《关于核准民生加银精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,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 2 月 3 日正式生效,首次设立募集规模为 2,475,168,598.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 533,987.27 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银精选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:股票等权益类资产占基金资产的 60%-95%,其中,权证投资比例占基金资产净值的比例不高于 3%;债券等固定收益类资产占基金资产的 0%-35%,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 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁

布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施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》、财税[2015]101 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c)自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

(d)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e)对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25%计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照 10%的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照 7%的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	27,114,478.01
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	27,114,478.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	173,363,644.24	190,618,711.46	17,255,067.22
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	173,363,644.24	190,618,711.46	17,255,067.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	6,864.55
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	253.70
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	123.40
合计	7,241.65

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	563,280.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	563,280.56

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,368.53

预提信息披露费用	149,179.94
预提审计费用	19,890.78
合计	172,439.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,281,257.17	197,281,257.17
本期申购	19,119,484.07	19,119,484.07
本期赎回(以“-”号填列)	-25,307,861.54	-25,307,861.54
- 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	191,092,879.70	191,092,879.70

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	79,537,359.08	-12,820,410.12	66,716,948.96
本期利润	-32,825,496.28	-6,802,666.11	-39,628,162.39
本期基金份额交易产生的变动数	-1,074,060.66	-191,370.92	-1,265,431.58
其中：基金申购款	5,826,703.83	-4,572,808.93	1,253,894.90
基金赎回款	-6,900,764.49	4,381,438.01	-2,519,326.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,637,802.14	-19,814,447.15	25,823,354.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	15,126.43
其他	3,021.91

合计	137,064.31
----	------------

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	872,402,054.18
减：卖出股票成本总额	901,391,346.94
买卖股票差价收入	-28,989,292.76

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生金融工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	649,261.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	649,261.78

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,802,666.11
——股票投资	-6,802,666.11
——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	-6,802,666.11

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	21,153.71
基金转换费收入	705.85
合计	21,859.56

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	2,616,912.42
银行间市场交易费用	-
合计	2,616,912.42

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	149,179.94
债券帐户维护费	6,000.00
银行费用	6,990.27
合计	182,060.99

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

本基金在本期末及上年度可比期间末均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,590,849.87	3,479,372.93
其中：支付销售机构的客户维护费	215,049.95	417,113.28

注：支付基金管理人民生加银基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	265,141.61	579,895.45

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

除管理人之外的其他关联方在本期及上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	27,114,478.01	118,915.97	46,514,993.58	161,670.61

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的备付金，于2016年6月30日的相关余额为人民币563,807.99元。（2015年12月31日：人民币3,225,238.34元）

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金在本期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,643	21,326.14	21,326.14	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 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
002691	冀凯股份	2016年2月23日	重大事项	26.47	2016年7月26日	23.23	463,579	9,874,732.00	12,270,936.13	-
300338	开元仪器	2016年4月15日	重大事项	19.82	-	-	342,394	5,524,849.64	6,786,249.08	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大事项	28.23	-	-	226,498	6,157,181.31	6,394,038.54	-
603838	四通股份	2016年3月24日	重大事项	16.20	-	-	317,196	4,952,696.98	5,138,575.20	-
002207	准油股份	2015年12月16日	重大事项	19.75	-	-	244,100	5,218,874.00	4,820,975.00	-

601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	5,042	17,495.74	105,478.64	-
002089	新海宜	2016年1月8日	重大事项	16.88	2016年7月18日	18.55	6	133.93	101.28	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责

制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会合规与风险管理委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以合规与风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金均未持有信用类债券。因此，本基金无重大的信用风险。

6.4.13.3 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遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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，除附注期末本基金持有的流通受限证券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，其余金融资产均能及时变现。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资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有人的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证

金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

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进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30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	27,114,478.01	-	-	-	-	-	27,114,478.01
结算备付金	563,807.99	-	-	-	-	-	563,807.99
存出保证金	274,228.12	-	-	-	-	-	274,228.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	190,618,711.46	190,618,711.46
应收利息	-	-	-	-	-	7,241.65	7,241.65
应收申购款	-	-	-	-	-	479,165.55	479,165.55
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,952,514.12	-	-	-	-	191,105,118.66	219,057,632.78
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	337.76	337.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,097,099.89	1,097,099.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	264,206.26	264,206.26
应付托管费	-	-	-	-	-	44,034.37	44,034.37
应付交易费用	-	-	-	-	-	563,280.56	563,280.56
其他负债	-	-	-	-	-	172,439.25	172,439.25
负债总计	-	-	-	-	-	2,141,398.09	2,141,398.09
利率敏感度缺口	27,952,514.12	-	-	-	-	-188,963,720.57	216,916,234.69
上年度末 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	39,885,901.44	-	-	-	-	-	39,885,901.44
结算备付金	3,225,238.34	-	-	-	-	-	3,225,238.34
存出保证金	553,270.43	-	-	-	-	-	553,270.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	222,326,512.86	222,326,512.86
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,892,611.54	2,892,611.54
应收利息	-	-	-	-	-	9,310.47	9,310.47
应收申购款	-	-	-	-	-	165,024.85	165,024.85

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,664,410.21	-	-	-	-225,393,459.72	269,057,869.93
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	864,853.79	864,853.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	332,032.69	332,032.69
应付托管费	-	-	-	-	55,338.73	55,338.73
应付交易费用	-	-	-	-	3,365,881.24	3,365,881.24
其他负债	-	-	-	-	441,557.35	441,557.35
负债总计	-	-	-	-	5,059,663.80	5,059,663.80
利率敏感度缺口	43,664,410.21	-	-	-	-220,333,795.92	263,998,206.13

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金均未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	190,618,711.46	87.88	222,326,512.86	84.22
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	190,618,711.46	87.88	222,326,512.86	84.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1、本基金业绩比较基准上升5%	17,601,097.91	16,345,891.33
	2、本基金业绩比较基准下降5%	-17,601,097.91	16,345,891.33

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次如下：

各层次金融工具公允价值

于2016年6月30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155,052,492.37元，划分为第二层次的余额为人民币35,566,219.09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。

第三层次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。

(b) 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(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

本报告期本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均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(年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 投资组合报告

7.1 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	190,618,711.46	87.02
	其中：股票	190,618,711.46	87.02
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	27,678,286.00	12.64
7	其他各项资产	760,635.32	0.35
8	合计	219,057,632.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,820,975.00	2.22
C	制造业	138,497,662.17	63.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	105,478.64	0.05
F	批发和零售业	3,847,692.00	1.77
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	33,394,037.53	15.39
J	金融业	5,721,404.00	2.64
K	房地产业	-	-
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	4,231,462.12	1.95
S	综合	-	-
	合计	190,618,711.46	87.88

7.3 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	000887	中鼎股份	574,233	12,696,291.63	5.85
2	002691	冀凯股份	463,579	12,270,936.13	5.66
3	000070	特发信息	429,400	11,258,868.00	5.19
4	300408	三环集团	602,232	10,816,086.72	4.99
5	603601	再升科技	180,800	8,701,904.00	4.01
6	002436	兴森科技	342,900	7,814,691.00	3.60
7	002273	水晶光电	264,204	7,395,069.96	3.41
8	300338	开元仪器	342,394	6,786,249.08	3.13
9	300098	高新兴	414,000	6,574,320.00	3.03
10	600887	伊利股份	389,115	6,486,547.05	2.99
11	300166	东方国信	226,498	6,394,038.54	2.95
12	002537	海立美达	210,187	6,389,684.80	2.95
13	300059	东方财富	287,695	6,386,829.00	2.94
14	300494	盛天网络	132,238	6,142,455.10	2.83
15	300457	赢合科技	79,250	6,134,742.50	2.83
16	002539	新都化工	374,926	5,732,618.54	2.64
17	601198	东兴证券	234,100	5,721,404.00	2.64
18	002364	中恒电气	208,550	5,720,526.50	2.64
19	600446	金证股份	143,549	5,160,586.55	2.38
20	603838	四通股份	317,196	5,138,575.20	2.37
21	002207	准油股份	244,100	4,820,975.00	2.22
22	002055	得润电子	154,930	4,743,956.60	2.19
23	600006	东风汽车	510,600	4,529,022.00	2.09
24	600667	太极实业	437,400	4,369,626.00	2.01
25	300336	新文化	169,394	4,231,462.12	1.95
26	002189	利达光电	141,900	4,010,094.00	1.85
27	600386	北巴传媒	206,200	3,847,692.00	1.77
28	002048	宁波华翔	168,202	3,846,779.74	1.77
29	601908	京运通	392,700	3,012,009.00	1.39
30	300113	顺网科技	68,779	2,610,850.84	1.20
31	603737	三棵树	1,062	123,276.96	0.06
32	300516	久之洋	695	121,743.15	0.06
33	300017	网宿科技	1,721	115,651.20	0.05
34	601611	中国核建	5,042	105,478.64	0.05
35	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.04

36	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
37	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
38	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
39	601127	小康股份	1,302	31,078.74	0.01
40	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
41	603958	哈森股份	1,600	23,200.00	0.01
42	601966	玲珑轮胎	1,643	21,326.14	0.01
43	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
44	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
45	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
46	002089	新海宜	6	101.28	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601788	光大证券	15,841,818.92	6.00
2	300113	顺网科技	15,765,307.41	5.97
3	600549	厦门钨业	15,010,973.66	5.69
4	600547	山东黄金	14,368,602.28	5.44
5	601998	中信银行	14,129,050.60	5.35
6	601198	东兴证券	13,484,836.01	5.11
7	600395	盘江股份	12,970,202.73	4.91
8	000831	*ST 五稀	12,550,386.98	4.75
9	000887	中鼎股份	12,146,354.74	4.60
10	000070	特发信息	11,823,254.08	4.48
11	000629	*ST 钒钛	11,817,530.50	4.48
12	300408	三环集团	11,622,900.00	4.40
13	600482	中国动力	11,108,150.94	4.21
14	002402	和而泰	10,976,089.32	4.16
15	002364	中恒电气	10,776,299.00	4.08
16	002055	得润电子	10,773,488.00	4.08
17	300240	飞力达	10,753,816.50	4.07
18	600259	广晟有色	10,705,179.60	4.06
19	002224	三力士	10,687,228.56	4.05

20	002539	新都化工	10,572,233.00	4.00
21	002537	海立美达	10,154,946.59	3.85
22	300120	经纬电材	10,094,778.38	3.82
23	002329	皇氏集团	9,947,504.36	3.77
24	600289	亿阳信通	9,737,466.50	3.69
25	002671	龙泉股份	9,713,361.68	3.68
26	300494	盛天网络	9,215,688.80	3.49
27	000975	银泰资源	9,119,846.45	3.45
28	002500	山西证券	8,911,480.35	3.38
29	600186	莲花健康	8,464,402.74	3.21
30	600392	盛和资源	8,323,943.85	3.15
31	000710	天兴仪表	8,192,723.05	3.10
32	600958	东方证券	8,163,330.05	3.09
33	600109	国金证券	7,961,817.80	3.02
34	000909	数源科技	7,922,370.00	3.00
35	603601	再升科技	7,826,492.00	2.96
36	002517	恺英网络	7,462,258.07	2.83
37	300222	科大智能	7,233,091.80	2.74
38	600188	兖州煤业	7,191,790.66	2.72
39	002273	水晶光电	7,191,328.50	2.72
40	603838	四通股份	7,077,106.00	2.68
41	600887	伊利股份	6,978,244.38	2.64
42	300144	宋城演艺	6,937,054.21	2.63
43	300336	新文化	6,898,956.58	2.61
44	603118	共进股份	6,842,475.99	2.59
45	300250	初灵信息	6,816,382.74	2.58
46	300202	聚龙股份	6,772,858.48	2.57
47	600223	鲁商置业	6,753,019.80	2.56
48	600562	国睿科技	6,727,220.00	2.55
49	002657	中科金财	6,699,513.00	2.54
50	300207	欣旺达	6,679,807.33	2.53
51	300098	高新兴	6,655,590.65	2.52
52	000402	金融街	6,602,617.95	2.50
53	300059	东方财富	6,538,419.70	2.48
54	300017	网宿科技	6,524,612.48	2.47
55	002117	东港股份	6,490,768.74	2.46

56	601599	鹿港文化	6,474,687.00	2.45
57	601688	华泰证券	6,393,511.80	2.42
58	600348	阳泉煤业	6,385,568.50	2.42
59	600010	包钢股份	6,364,519.00	2.41
60	601555	东吴证券	6,319,340.13	2.39
61	600446	金证股份	6,245,330.00	2.37
62	002436	兴森科技	6,211,786.58	2.35
63	300166	东方国信	6,157,181.31	2.33
64	600057	象屿股份	6,157,031.91	2.33
65	601233	桐昆股份	5,914,611.50	2.24
66	300457	赢合科技	5,811,380.58	2.20
67	300367	东方网力	5,751,661.30	2.18
68	002053	云南盐化	5,712,416.54	2.16
69	600766	园城黄金	5,637,114.05	2.14
70	300338	开元仪器	5,524,849.64	2.09
71	000932	华菱钢铁	5,347,148.00	2.03
72	300085	银之杰	5,311,360.80	2.01
73	002048	宁波华翔	5,297,412.00	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。

7.4.2 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	600395	盘江股份	22,061,553.22	8.36
2	002018	华信国际	17,960,472.00	6.80
3	600549	厦门钨业	16,088,515.96	6.09
4	000710	天兴仪表	15,439,637.42	5.85
5	601788	光大证券	14,750,118.91	5.59
6	600547	山东黄金	14,095,695.54	5.34
7	300113	顺网科技	13,327,443.57	5.05
8	601998	中信银行	12,610,031.04	4.78
9	000831	*ST 五稀	12,538,367.30	4.75
10	600259	广晟有色	11,875,752.35	4.50
11	600766	园城黄金	10,676,868.45	4.04
12	002224	三力士	10,624,979.51	4.02

13	000629	*ST 钒钛	10,514,220.10	3.98
14	002500	山西证券	10,380,511.83	3.93
15	002576	通达动力	10,339,435.24	3.92
16	300240	飞力达	10,329,398.00	3.91
17	300120	经纬电材	10,291,444.07	3.90
18	600289	亿阳信通	10,170,508.47	3.85
19	000975	银泰资源	10,120,924.91	3.83
20	002671	龙泉股份	9,888,930.33	3.75
21	600157	永泰能源	9,622,133.55	3.64
22	600136	当代明诚	9,242,673.86	3.50
23	600482	中国动力	9,151,744.19	3.47
24	002402	和而泰	9,061,745.92	3.43
25	600816	安信信托	8,844,885.86	3.35
26	002329	皇氏集团	8,742,590.24	3.31
27	000909	数源科技	8,726,776.33	3.31
28	600188	兖州煤业	8,582,829.26	3.25
29	600392	盛和资源	8,454,080.55	3.20
30	300222	科大智能	7,887,381.28	2.99
31	300219	鸿利智汇	7,835,111.77	2.97
32	600186	莲花健康	7,773,515.69	2.94
33	300144	宋城演艺	7,582,698.93	2.87
34	002089	新海宜	7,578,272.78	2.87
35	300083	劲胜精密	7,304,308.30	2.77
36	600958	东方证券	7,110,381.04	2.69
37	300202	聚龙股份	7,068,527.04	2.68
38	603118	共进股份	7,026,392.12	2.66
39	002517	恺英网络	6,992,205.61	2.65
40	600109	国金证券	6,983,798.62	2.65
41	601599	鹿港文化	6,958,520.95	2.64
42	000402	金融街	6,898,258.06	2.61
43	002657	中科金财	6,591,552.00	2.50
44	300327	中颖电子	6,572,780.00	2.49
45	600348	阳泉煤业	6,539,342.44	2.48
46	300162	雷曼股份	6,485,724.00	2.46
47	002086	东方海洋	6,477,594.04	2.45
48	300367	东方网力	6,460,931.54	2.45
49	300192	科斯伍德	6,450,077.50	2.44
50	300207	欣旺达	6,430,091.79	2.44

51	600756	浪潮软件	6,421,168.36	2.43
52	600562	国睿科技	6,301,259.44	2.39
53	300017	网宿科技	6,291,061.10	2.38
54	601198	东兴证券	6,282,805.48	2.38
55	002117	东港股份	6,252,082.26	2.37
56	600010	包钢股份	6,215,911.71	2.35
57	600223	鲁商置业	6,156,189.25	2.33
58	601336	新华保险	6,140,441.36	2.33
59	601555	东吴证券	6,122,013.36	2.32
60	600057	象屿股份	6,010,623.18	2.28
61	601233	桐昆股份	5,999,287.40	2.27
62	600702	沱牌舍得	5,967,875.69	2.26
63	300250	初灵信息	5,888,884.53	2.23
64	002509	天广中茂	5,878,609.04	2.23
65	002364	中恒电气	5,771,225.01	2.19
66	002055	得润电子	5,661,557.80	2.14
67	603019	中科曙光	5,598,911.40	2.12
68	601688	华泰证券	5,550,947.42	2.10
69	002537	海立美达	5,517,346.70	2.09
70	002053	云南盐化	5,457,535.75	2.07
71	300085	银之杰	5,413,866.65	2.05
72	300383	光环新网	5,401,002.61	2.05
73	601628	中国人寿	5,355,027.96	2.03
74	300160	秀强股份	5,344,451.78	2.02

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。

7.4.3 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	876,486,211.65
卖出股票收入（成交）总额	872,402,054.18

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 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	274,228.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,241.65
5	应收申购款	479,165.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	760,635.32

7.12.4 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。

7.12.5 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	002691	冀凯股份	12,270,936.13	5.66	重大事项
2	300338	开元仪器	6,786,249.08	3.13	重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
6,913	27,642.54	13,374,664.72	7.00%	177,718,214.98	93.00%

8.2 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	8,445.51	0.0044%
------------------	----------	---------

8.3 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年2月3日）基金份额总额	2,475,168,598.16
本报告期期初基金份额总额	197,281,257.17
本报告期基金总申购份额	19,119,484.07
减：本报告期基金总赎回份额	25,307,861.54
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	191,092,879.70

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2016年3月16日，本基金管理人发布公告，解聘张力女士副总经理职务。

10.3 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、基金托管业务没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 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、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国泰君安证券股份有限公司	1	387,736,562.78	22.18%	361,099.03	22.72%	-
中国国际金融股份有限公司	2	313,175,823.35	17.91%	291,660.50	18.35%	-
中国银河证券股份有限公司	2	169,766,571.52	9.71%	154,152.86	9.70%	-
安信证券股份有限公司	2	168,521,406.91	9.64%	156,944.04	9.87%	-
海通证券股份有限公司	1	142,996,972.13	8.18%	133,171.63	8.38%	-
中信建投证券股份有限公司	2	115,132,234.73	6.58%	91,121.00	5.73%	-
平安证券有限责任公司	1	112,584,200.71	6.44%	104,848.91	6.60%	-
国金证券股份有限公司	1	85,336,180.20	4.88%	79,473.02	5.00%	-
华泰证券股份有限公司	2	83,261,227.20	4.76%	59,223.62	3.73%	-
中银国际证券有限责任公司	2	56,324,117.91	3.22%	52,454.52	3.30%	-
光大证券股份有限公司	1	39,642,066.55	2.27%	36,918.88	2.32%	-

申万宏源证券 有限公司	2	32,668,738.29	1.87%	30,424.44	1.91%	-
国信证券股份 有限公司	1	19,844,227.31	1.13%	18,480.87	1.16%	-
长江证券股份 有限公司	1	18,941,633.13	1.08%	17,640.45	1.11%	-
方正证券股份 有限公司	1	2,513,860.00	0.14%	1,788.08	0.11%	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-

股份有限公司						
安信证券股份 有限公司						
海通证券股份 有限公司			50,100,000.00	57.72%		
中信建投证券 股份有限公司						
平安证券有限 责任公司			36,700,000.00	42.28%		
国金证券股份 有限公司						
华泰证券股份 有限公司						
中银国际证券 有限责任公司						
光大证券股份 有限公司						
申万宏源证券 有限公司						
国信证券股份 有限公司						
长江证券股份 有限公司						
方正证券股份 有限公司						
中泰证券股份 有限公司						
中国中投证券 有限责任公司						
英大证券有限 责任公司						
国联证券股份 有限公司						
广发证券股份 有限公司						
东方证券股份 有限公司						
中信证券股份 有限公司						
兴业证券股份 有限公司						
东兴证券股份 有限公司						
民生证券股份						

有限公司						
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

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。

③本基金本期取消东海证券股份有限公司深圳交易单元作为本基金交易单元。

10.8 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 2015 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	2016 年 1 月 4 日
2	民生加银基金管理有限公司由于交易所发生不可恢复熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016 年 1 月 5 日
3	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	2016 年 1 月 8 日
4	民生加银基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 8 日
5	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	2016 年 1 月 12 日
6	民生加银精选混合型证券投资基金 2015 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	2016 年 1 月 21 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深圳市新兰德证券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	2016 年 1 月 28 日
8	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	2016 年 2 月 26 日
9	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 3 月 16 日

	副总经理变更的公告	券报、证券时报、证 券日报、公司网站	
10	民生加银精选混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 3 月 17 日
11	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司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	2016 年 4 月 1 日
12	民生加银基金管理有限公司关于调整通过招行银行借记卡在网 上直销系统中办理业务的费率优惠公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站	2016 年 4 月 6 日
13	民生加银精选混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 4 月 20 日
14	民生加银基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、公司网站	2016 年 4 月 25 日
15	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	2016 年 4 月 25 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	2016 年 5 月 12 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参加民生银	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证	2016 年 5 月 12 日

	行直销银行申购费率优惠活动的公告	券日报、公司网站	
18	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	2016 年 5 月 14 日
19	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分已开通转换业务的开放式基金参加基金转换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	2016 年 5 月 31 日
20	民生加银基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购最低金额和赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 6 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停牌后估值方法变更的提示性公告	证券时报、公司网站	2016 年 6 月 14 日
22	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广源达信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	2016 年 6 月 15 日
23	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
24	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 12.1.2 《民生加银精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 12.1.3 《民生加银精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.4 《民生加银精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.5 法律意见书；
- 12.1.6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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8月29日