

民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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 其他指标.....	错误!未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
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.....	77

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	77
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	77
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	77
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
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	79
§10 开放式基金份额变动	79
§11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息	90
§13 备查文件目录	90
13.1 备查文件目录	90
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银城镇化混合
基金主代码	000408
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 12 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	166,685,983.57 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于在城镇化建设过程中将有突出贡献并因此受益的上市公司，在充分控制基金资产风险和保持基金资产流动性的基础上，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健增值。
投资策略	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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、中期票据、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。本基金持有受益于城镇化建设的股票净值及债券净值不低于本基金非现金基金资产的 80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
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@msjfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096

传真	0755-23999800	010-66275853
注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjyfund.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	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

§ 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	2,619,222.62	58,880,997.81	22,175,654.47
本期利润	8,478,850.77	52,154,160.07	26,694,393.93
加权平均基金份额本期利润	0.0455	0.7529	0.1631
本期加权平均净值利润率	2.31%	40.99%	16.15%
本期基金份额净值增长率	-0.63%	93.20%	16.34%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	32,458,268.43	96,157,035.11	8,550,906.73
期末可供分配基金份额利润	0.1947	1.0866	0.1320
期末基金资产净值	214,907,249.01	193,529,292.59	73,311,626.97
期末基金份额净值	1.289	2.187	1.132
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

基金份额累计净值增长率	123.79%	125.22%	16.57%
-------------	---------	---------	--------

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

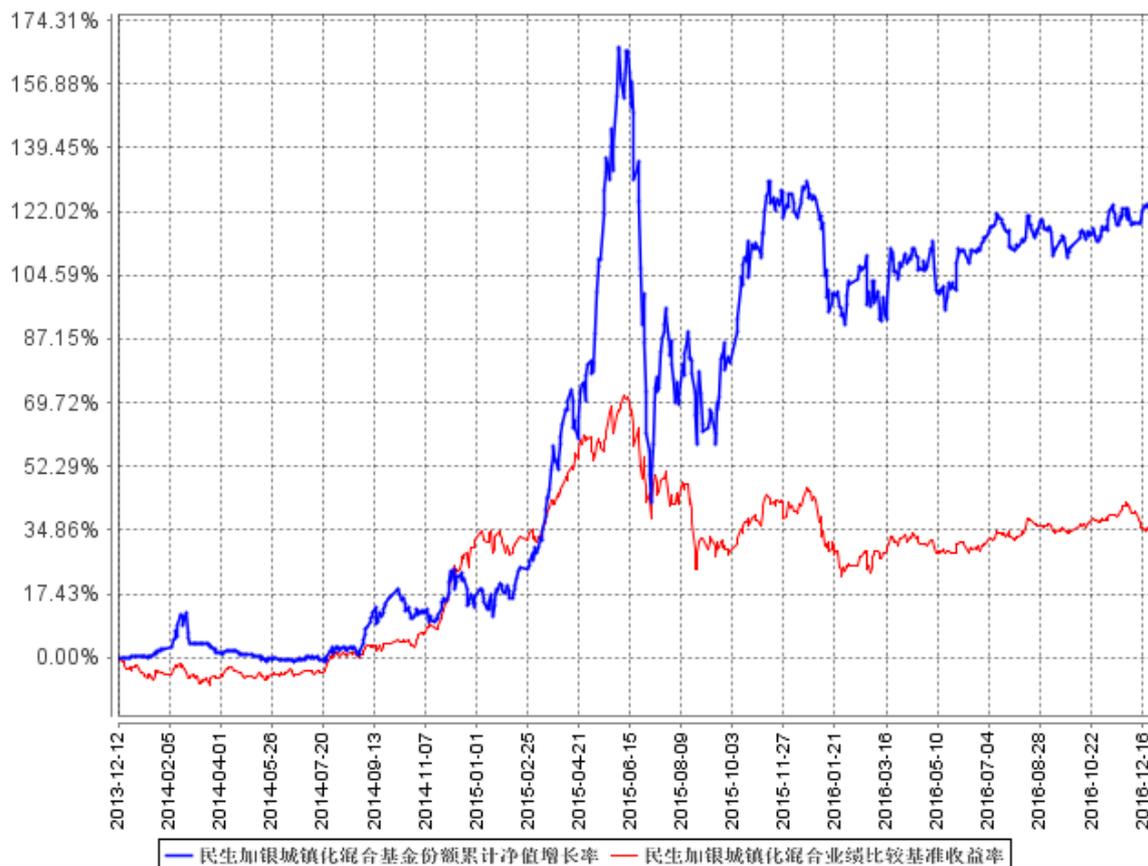
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.29%	0.66%	0.41%	0.46%	4.88%	0.20%
过去六个月	4.23%	0.75%	3.28%	0.47%	0.95%	0.28%
过去一年	-0.63%	1.27%	-5.44%	0.84%	4.81%	0.43%
过去三年	123.35%	1.81%	37.95%	1.07%	85.40%	0.74%
自基金合同生效起至今	123.79%	1.79%	35.40%	1.07%	88.39%	0.72%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*60%+中证国债指数收益率*40%

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

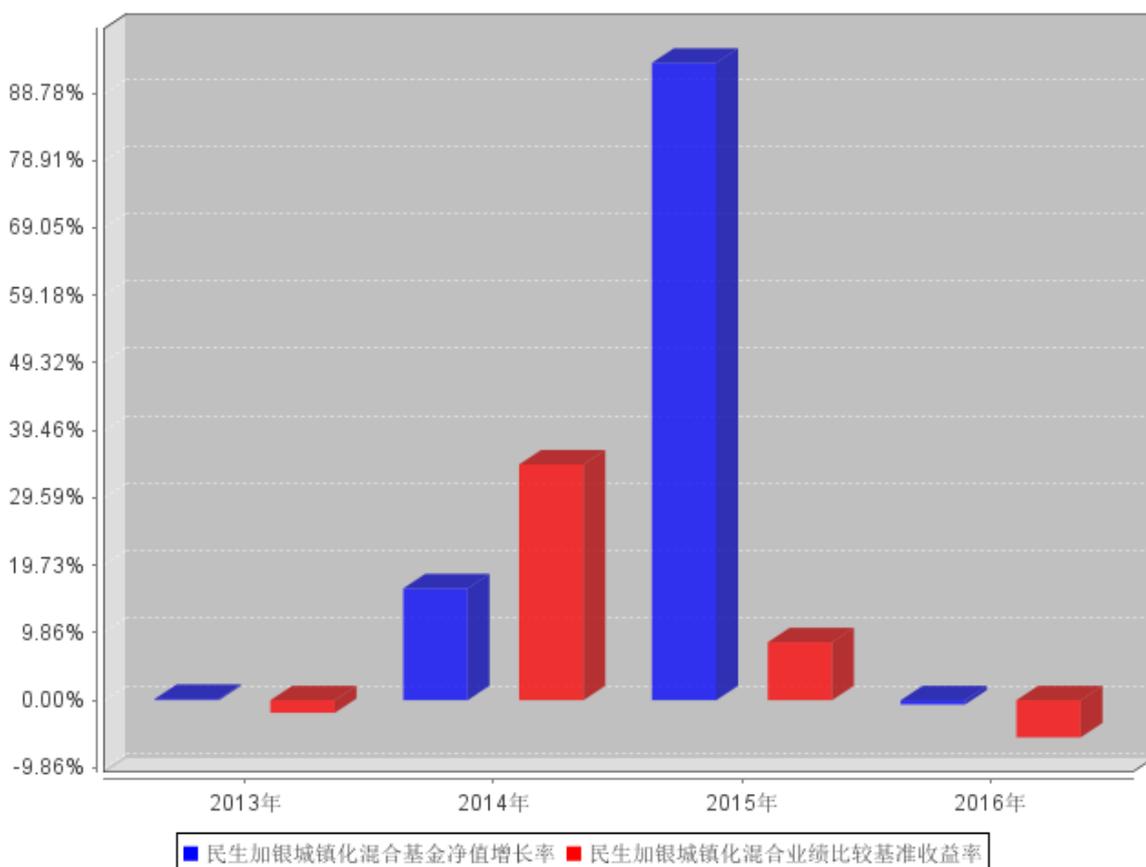
民生加银城镇化混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2013 年 12 月 12 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 自基金合同生效以来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

民生加银城镇化混合自基金合同生效以来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 2013 年 12 月 12 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

单位：人民币元

年 度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合计	备注
2016	8.650	2,988,046,956.85	20,501,140.08	3,008,548,096.93	注：-
2015	-	-	-	-	注：-
2014	0.300	683,715.28	52,298.58	736,013.86	注：-
合 计	8.950	2,988,730,672.13	20,553,438.66	3,009,284,110.79	注：-

§ 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12月31日，公司共管理37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、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、民生加银鑫盈债券型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金。

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		
黄一明	民生加银品牌蓝筹	2013年12月12日	-	9年	工商管理硕士。自2007年起历任交银施罗德基

	混合、民生加银城镇化混合、民生加银优选股票、民生加银养老服务混合的基金经理				金公司投资研究部行业研究员，平安大华基金管理公司投资研究部基金经理助理及高级研究员；自 2012 年 5 月加盟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遵规守信情况的说明

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。

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

同投资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

在跌宕起伏的 2016 年民生加银城镇化基金最终以略微负收益收官。作为基金管理人，尽管付出了诸多努力，但我们对于这个成绩内心还是充满遗憾。

回顾过去一年的基金运作，我们在 2015 年底市场上相当部分投资者憧憬着年初“春季躁动”行情的时候，感觉到了市场风险的即将降临，将股票仓位迅速下降到了 20% 以内。在一定程度上回避了 2016 年市场开年的“熔断式”下跌，取得了一定的主动权。在临近年底的 12 月初，市场上行到 3300 点附近，我们大幅降低了仓位并进行了基金分红。但遗憾的是，在期间投资过程中，为了回避可能的回撤，我们的调仓操作过于频繁；尽管多次提前把握住了可能的市场热点，但却每每在市场下跌过程中与之失之交臂。这也是导致我们的基金在全年未能实现正收益的主要原因。总结经验教训，在未来的投资中，我们会适当提高回撤的容忍度，减少重大仓位调整的频率，一年中对极端仓位的设置将保留较为有限的次数，一定程度上适当提高组合中个股的集中度。而这一组合策略的调整也是在我们对即将到来的 2017 年市场走势判断的基础上做出的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.289 元，本报告期内份额净值增长率为 -0.63%，同期业绩比较基准收益率为 -5.44%。

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 2017 年，不得不承认市场依然充满着诸多的不确定因素。相信投资者也在各种媒体轰炸之下已经提前体验到所谓的“黑天鹅”。但我们必须提醒大家注意的是，所有我们现在能够想得到的风险事件都不构成真正的风险，也不是真正的“黑天鹅”。和去年的此时此刻比起来，我们对股票市场的态度和应对反倒更加积极乐观。

首先，我们认为，市场普遍担心的人民币汇率波动和债券市场风波短期内难以再给股票市场

带来过大的影响。事实上，从 2015 年的“8.19”汇改之后，汇率波动对 A 股市场的短期影响一直在边际递减；而近期债券市场风波对 A 股的影响也只是形成很短暂的冲击且幅度有限；之所以如此，很大一部分要归因于股票市场的去杠杆在一定程度上已经在过去一年多来的三次巨大市场波动中完成了。

其次，中国经济的见底复苏，制造业的回暖是影响目前乃至未来一段时间 A 股市场走势和结构分化的核心因素。尽管岁末年初由于季节性因素导致 2016 年以来的经济复苏步伐略微放缓，但从制造业的订单增长情况来看，2017 年中国经济尤其是制造业的复苏依然最为值得乐观。消费升级和制造升级作为中国经济发展的两大引擎将会焕发出洪荒之力，而股票市场目前并没有充分地反映这一前景。在制造业普遍回暖之后，我们还将会看到银行的坏账率也将出现向下的拐点，银行股的业绩和估值水平也将得到明显提升。

再次，国企改革将不断取得突破，这也是目前乃至整个一季度我们对市场乐观的重要原因。2015 年下半年开始，中央出台了有关国企改革的一系列纲领性文件。2016 年，央企混合所有制改革逐步开展；我们预计 2017 年国企改革将会在全国大部分省市开始逐步推开。十八大以来反腐败斗争的坚决深入为国企改革的推行创造了良好的环境，同时还堵住了国有企业之前惯有的利润漏出；混合所有制的探索、职工股权激励制度实施以及国企经理人的市场化招聘等等都将成为国有企业焕发新的活力的重要手段。同时，国有企业所特有的可能的“隐形资产”也将成为国有上市公司价值重估的重要基础。我们相信，国有企业改革、国有资产证券化将会成为 2017 年资本市场的一条重要主线。

然而，尽管我们在目前乃至上半年都对股票市场抱有充分的乐观态度，但是我们依然始终把控制风险作为本基金投资的核心要素。我们认为，在市场对经济增长和国企改革有了充分预期之后，由于经济复苏趋势的不断确立，“脱虚向实”将有望在 2017 年得到初步实现。届时社会资金将会越来越多地投向实体经济，而只有真正能够实现业绩稳健增长且低估值的行业龙头品种能够得到场内资金的青睐，在此过程中，市场的整体估值水平将会受到压制。因此在二季度后期我们对市场的态度将转为谨慎。

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，本基金于 2016 年 12 月 13 日公告每 10 份基金份额派发红利 8.65 元。共计派发红利 3,008,548,096.93 元，其中以现金形式发放金额为人民币 2,988,046,956.85 元，以红利再投资形式发放金额人民币 20,501,140.08 元。权益登记日 2016 年 12 月 15 日。

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，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，本基金实施利润分配金额 3,008,548,096.93 元。

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 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(2017)审字第 60950520_H10 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	民生加银城镇化灵活配置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城镇化灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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现金增利货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

	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	2017 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	44,745,157.39	143,465,220.92
结算备付金		5,691,494.78	5,443,118.02
存出保证金		876,181.66	702,421.63
交易性金融资产	7.4.7.2	190,557,083.47	36,738,067.01
其中：股票投资		190,557,083.47	36,738,067.01
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		-	12,673,097.70
应收利息	7.4.7.5	32,892.54	31,449.67
应收股利		-	-
应收申购款		1,425,584.26	351,462.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		243,328,394.10	199,404,837.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,413,124.27	1,722,294.70
应付管理人报酬		1,618,901.04	259,979.67
应付托管费		269,816.84	43,329.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,902,481.12	3,603,457.66
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	216,821.82	246,483.06
负债合计		28,421,145.09	5,875,545.03
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	166,685,983.57	88,492,194.93
未分配利润	7.4.7.10	48,221,265.44	105,037,097.66
所有者权益合计		214,907,249.01	193,529,292.59
负债和所有者权益总计		243,328,394.10	199,404,837.62

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.289 元，基金份额总额 166,685,983.57 份。

7.2 利润表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		32,933,662.90	62,313,755.12
1. 利息收入		1,815,662.11	345,222.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,626,957.98	342,674.43
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		188,704.13	2,548.16
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,457,413.07	68,146,954.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,786,793.07	67,866,372.34
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	7.4.7.13.5	-	-
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	670,620.00	280,581.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,859,628.15	-6,726,837.74
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	5,800,959.57	548,416.27
减：二、费用		24,454,812.13	10,159,595.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,232,479.51	1,874,191.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	872,079.89	312,365.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	18,181,657.71	7,796,124.64
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	168,595.02	176,913.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,478,850.77	52,154,160.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,478,850.77	52,154,160.07

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	88,492,194.93	105,037,097.66	193,529,292.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,478,850.77	8,478,850.77
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）	78,193,788.64	2,943,253,413.94	3,021,447,202.58
其中：1. 基金申购款	3,633,340,723.66	4,035,734,100.57	7,669,074,824.23
2. 基金赎回款	-3,555,146,935.02	-1,092,480,686.63	-4,647,627,621.65
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“-”	-	-3,008,548,096.93	-3,008,548,096.93

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	166,685,983.57	48,221,265.44	214,907,249.01
项目	上年度可比期间 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)	64,760,720.24	8,550,906.73	73,311,626.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,154,160.07	52,154,160.07
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)	23,731,474.69	44,332,030.86	68,063,505.55
其中:1.基金申购款	261,436,373.20	264,144,697.39	525,581,070.59
2.基金赎回款	-237,704,898.51	-219,812,666.53	-457,517,565.04
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)	88,492,194.93	105,037,097.66	193,529,292.59

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:

 吴剑飞 周吉人 洪锐珠
 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

民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),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[2013]第929号《关于核准民生加银城镇化灵活配置混合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人募集,基金合同于2013年12月12日正式生效,首次设立募集规模为235,923,426.05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《民生加银城镇化灵活配置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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、中期票据、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、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的 0%-95%；债券、货币市场工具、现金、中期票据、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不低于基金资产的 5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金持有受益于城镇化建设的股票净值及债券净值不低于本基金非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%。

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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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归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、基金和衍生工具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其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确定公允价值；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)在符合有关分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 40%，若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于基金份额面值；即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；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)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会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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、增值税、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。

对证券投资基金(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。

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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式和买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，并从

2017 年 7 月 1 日(含)以后，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资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；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。自 2015 年 9 月 8 日起，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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	44,745,157.39	143,465,220.92
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	44,745,157.39	143,465,220.92

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	186,905,553.60	190,557,083.47	3,651,529.87
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	186,905,553.60	190,557,083.47	3,651,529.87
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	38,946,165.29	36,738,067.01	-2,208,098.28
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	38,946,165.29	36,738,067.01	-2,208,098.28

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	29,641.60	28,407.62
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	2,817.21	2,694.34
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	433.73	347.71
合计	32,892.54	31,449.67

注：其他为应收权证保证金利息。

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,902,481.12	3,603,457.66
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	5,902,481.12	3,603,457.66

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	76,821.82	6,483.06
预提费用	140,000.00	240,000.00
合计	216,821.82	246,483.06

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,492,194.93	88,492,194.93
本期申购	3,633,340,723.66	3,633,340,723.66

本期赎回（以“-”号填列）	-3,555,146,935.02	-3,555,146,935.02
- 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	166,685,983.57	166,685,983.57

注：申购含红利再投及转换入份额，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	96,157,035.11	8,880,062.55	105,037,097.66
本期利润	2,619,222.62	5,859,628.15	8,478,850.77
本期基金份额交易产生的变动数	2,942,230,107.63	1,023,306.31	2,943,253,413.94
其中：基金申购款	3,721,470,906.14	314,263,194.43	4,035,734,100.57
基金赎回款	-779,240,798.51	-313,239,888.12	-1,092,480,686.63
本期已分配利润	-3,008,548,096.93	-	-3,008,548,096.93
本期末	32,458,268.43	15,762,997.01	48,221,265.44

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,515,217.93	308,466.87
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	94,342.76	29,523.29
其他	17,397.29	4,684.27
合计	1,626,957.98	342,674.43

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	6,190,346,301.48	2,680,541,946.45
减：卖出股票成本总额	6,171,559,508.41	2,612,675,574.11

买卖股票差价收入	18,786,793.07	67,866,372.34
----------	---------------	---------------

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

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	670,620.00	280,581.66
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	670,620.00	280,581.66

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	5,859,628.15	-6,726,837.74
——股票投资	5,859,628.15	-6,726,837.74
——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	5,859,628.15	-6,726,837.74

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	5,784,875.13	501,569.24
转换费收入	16,084.44	46,847.03
合计	5,800,959.57	548,416.27

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	18,181,657.71	7,796,124.64
银行间市场交易费用	-	-
合计	18,181,657.71	7,796,124.64

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
其他费用	200.00	200.00
银行费用	22,395.02	14,213.07
债券帐户维护费	6,000.00	22,500.00
合计	168,595.02	176,913.07

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，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

截至财务报表批准日，除在 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要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
中国建设银行	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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,232,479.51	1,874,191.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,417,094.36	334,994.09

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 2016 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 1,618,901.04 元 (2015 年 12 月 31 日: 人民币 259,979.67 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	872,079.89	312,365.37

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 2016 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 269,816.84 元 (2015 年 12 月 31 日: 人民币 43,329.94 元)。

7.4.10.2.3 销售服务费

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

注: 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

注: 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

注: 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于本基金。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国建设银行	44,745,157.39	1,515,217.93	143,465,220.92	308,466.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未发生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**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016年12月15日	-	2016年12月15日	8.6502	2,988,046,956.85	20,501,140.083	3,008,548,096.93	
合计	-	-		8.6502	2,988,046,956.85	20,501,140.083	3,008,548,096.93	

7.4.12 期末（2016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**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月20日	新股锁定	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年12月1日	新股锁定	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-

601375	中原证券	2016年 12月20 日	2017年 1月3 日	新股未 上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年 12月29 日	2017年 1月9 日	新股未 上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年 12月29 日	2017年 1月6 日	新股未 上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股未 上市	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-
603228	景旺电子	2016年 12月28 日	2017年 1月6 日	新股未 上市	23.16	23.16	1,143	26,471.88	26,471.88	-
603035	常熟汽饰	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股未 上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股未 上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年 12月28 日	2017年 1月5 日	新股未 上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年 12月29 日	2017年 1月10 日	新股未 上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年 12月28 日	2017年 1月6 日	新股未 上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年 12月26 日	2017年 1月3 日	新股未 上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股未 上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年 12月26 日	2017年 1月4 日	新股未 上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股未 上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股未 上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

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
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大事项	7.48	2017年1月18日	6.73	185,800	1,335,159.00	1,389,784.00	-
300477	合纵科技	2016年9月14日	重大事项	24.84	2017年1月11日	23.52	19,300	456,189.00	479,412.00	-
300276	三丰智能	2016年9月12日	重大事项	18.15	2017年3月27日	19.97	24,800	456,325.00	450,120.00	-
300123	太阳鸟	2016年9月28日	重大事项	15.08	2017年2月15日	16.59	29,600	455,353.00	446,368.00	-
002034	美欣达	2016年10月10日	重大事项	36.33	2017年1月13日	39.96	12,200	432,087.78	443,226.00	-
300243	瑞丰高材	2016年9月20日	重大事项	15.18	2017年1月4日	16.70	29,100	455,775.00	441,738.00	-
002629	仁智股份	2016年10月10日	重大事项	13.11	2017年2月17日	12.31	27,000	324,533.52	353,970.00	-
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大事项	177.97	2017年3月13日	195.77	831	19,329.06	147,893.07	-
300104	乐视网	2016年12月7日	重大事项	35.80	2017年1月16日	36.88	2,200	85,084.00	78,760.00	-
300537	广信材料	2016年10月12日	重大事项	48.79	2017年1月13日	43.91	24	220.56	1,170.96	-

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 2016 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 2016 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 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券投资。因此，本基金无重大的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券可在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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受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 2016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	44,745,157.39	-	-	-	-	-	44,745,157.39
结算备付金	5,691,494.78	-	-	-	-	-	5,691,494.78
存出保证金	876,181.66	-	-	-	-	-	876,181.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	190,557,083.47	190,557,083.47
应收利息	-	-	-	-	-	32,892.54	32,892.54
应收申购款	-	-	-	-	-	1,425,584.26	1,425,584.26
资产总计	51,312,833.83	-	-	-	-	192,015,560.27	243,328,394.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,413,124.27	20,413,124.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,618,901.04	1,618,901.04
应付托管费	-	-	-	-	-	269,816.84	269,816.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,902,481.12	5,902,481.12
其他负债	-	-	-	-	-	216,821.82	216,821.82
负债总计	-	-	-	-	-	28,421,145.09	28,421,145.09
利率敏感度缺口	51,312,833.83	-	-	-	-	163,594,415.18	214,907,249.01
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	143,465,220.92	-	-	-	-	-	143,465,220.92
结算备付金	5,443,118.02	-	-	-	-	-	5,443,118.02
存出保证金	702,421.63	-	-	-	-	-	702,421.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	36,738,067.01	36,738,067.01
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,673,097.70	12,673,097.70
应收利息	-	-	-	-	-	31,449.67	31,449.67
应收申购款	-	-	-	-	-	351,462.67	351,462.67

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	149,610,760.57	-	-	-	-	49,794,077.05	199,404,837.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,722,294.70	1,722,294.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	259,979.67	259,979.67
应付托管费	-	-	-	-	-	43,329.94	43,329.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,603,457.66	3,603,457.66
其他负债	-	-	-	-	-	246,483.06	246,483.06
负债总计	-	-	-	-	-	5,875,545.03	5,875,545.03
利率敏感度缺口	149,610,760.57	-	-	-	-	43,918,532.02	193,529,292.59

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有的交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本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 2016 年 12 月 31 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	190,557,083.47	88.67	36,738,067.01	18.98
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	190,557,083.47	88.67	36,738,067.01	18.98

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
1、本基金业绩比较基准上升5%		11,707,149.19	12,723,792.28
2、本基金业绩比较基准下降5%		-11,707,149.19	-12,723,792.28

注：本基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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2016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185,889,316.53元，划分为第二层次的余额为人民币4,667,766.94

元，无划分为第三层次的余额。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 27,597,152.67 元，划分为第二层次的余额为人民币 9,140,914.34 元，无划分为第三层次的余额。

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，本基金本报告期末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。

§ 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	190,557,083.47	78.31
	其中：股票	190,557,083.47	78.31
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	50,436,652.17	20.73
7	其他各项资产	2,334,658.46	0.96

8	合计	243,328,394.10	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,879,515.00	1.81
B	采矿业	394,191.20	0.18
C	制造业	127,078,823.24	59.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,925.53	0.02
E	建筑业	15,412,362.07	7.17
F	批发和零售业	29,474,526.09	13.71
G	交通运输、仓储和邮政业	1,814,765.01	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	358,715.13	0.17
J	金融业	3,669,057.20	1.71
K	房地产业	8,437,203.00	3.93
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	190,557,083.47	88.67

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	600519	贵州茅台	42,040	14,047,666.00	6.54
2	600619	海立股份	744,900	10,763,805.00	5.01
3	601989	中国重工	1,229,400	8,716,446.00	4.06
4	601800	中国交建	532,200	8,084,118.00	3.76
5	600689	上海三毛	333,000	6,653,340.00	3.10
6	000651	格力电器	246,700	6,073,754.00	2.83
7	600616	金枫酒业	491,400	6,044,220.00	2.81
8	000019	深深宝A	356,000	5,763,640.00	2.68
9	600031	三一重工	896,700	5,469,870.00	2.55
10	002756	永兴特钢	184,660	5,443,776.80	2.53
11	600833	第一医药	262,400	5,392,320.00	2.51
12	002057	中钢天源	307,002	5,209,823.94	2.42
13	600128	弘业股份	339,400	5,162,274.00	2.40
14	000554	泰山石油	439,200	4,861,944.00	2.26
15	600272	开开实业	236,800	4,560,768.00	2.12
16	600843	上工申贝	238,228	4,483,450.96	2.09
17	600686	金龙汽车	268,700	3,818,227.00	1.78
18	600871	石化油服	900,400	3,691,640.00	1.72
19	000011	深物业A	169,800	3,180,354.00	1.48
20	000901	航天科技	86,400	2,839,104.00	1.32
21	600598	北大荒	231,000	2,818,200.00	1.31
22	000006	深振业A	294,500	2,783,025.00	1.29
23	600820	隧道股份	247,700	2,727,177.00	1.27
24	600500	中化国际	227,600	2,653,816.00	1.23
25	000514	渝开发	211,800	2,473,824.00	1.15
26	600378	天科股份	149,680	2,231,728.80	1.04
27	002313	日海通讯	94,500	2,201,850.00	1.02
28	600824	益民集团	303,890	2,200,163.60	1.02
29	600391	成发科技	62,200	2,192,550.00	1.02
30	600848	上海临港	112,100	2,169,135.00	1.01
31	601668	中国建筑	239,600	2,122,856.00	0.99
32	600535	天士力	50,300	2,086,947.00	0.97
33	600309	万华化学	95,800	2,062,574.00	0.96
34	600106	重庆路桥	257,533	1,805,306.33	0.84

35	601998	中信银行	280,100	1,795,441.00	0.84
36	000927	一汽夏利	295,400	1,778,308.00	0.83
37	600877	中国嘉陵	173,700	1,625,832.00	0.76
38	000930	中粮生化	114,700	1,541,568.00	0.72
39	000157	中联重科	336,500	1,527,710.00	0.71
40	000563	陕国投A	185,800	1,389,784.00	0.65
41	600449	宁夏建材	99,200	1,207,264.00	0.56
42	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.56
43	600502	安徽水利	117,100	1,168,658.00	0.54
44	000032	深桑达A	76,500	1,142,910.00	0.53
45	600838	上海九百	62,400	1,138,800.00	0.53
46	600523	贵航股份	49,000	1,124,060.00	0.52
47	600343	航天动力	51,800	1,088,836.00	0.51
48	600688	上海石化	169,000	1,088,360.00	0.51
49	600148	长春一东	38,600	1,080,414.00	0.50
50	600072	钢构工程	62,300	1,080,282.00	0.50
51	002122	天马股份	84,700	1,074,843.00	0.50
52	601618	中国中冶	230,100	1,072,266.00	0.50
53	000151	中成股份	54,546	1,068,556.14	0.50
54	002037	久联发展	62,048	1,062,261.76	0.49
55	600354	敦煌种业	116,500	1,061,315.00	0.49
56	600628	新世界	74,000	1,045,620.00	0.49
57	000523	广州浪奇	90,600	1,029,216.00	0.48
58	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.39
59	600006	东风汽车	118,380	814,454.40	0.38
60	300477	合纵科技	19,300	479,412.00	0.22
61	300276	三丰智能	24,800	450,120.00	0.21
62	300123	太阳鸟	29,600	446,368.00	0.21
63	002034	美欣达	12,200	443,226.00	0.21
64	300243	瑞丰高材	29,100	441,738.00	0.21
65	600909	华安证券	30,044	377,052.20	0.18
66	002629	仁智股份	27,000	353,970.00	0.16
67	300165	天瑞仪器	34,200	342,000.00	0.16
68	002821	凯莱英	2,293	329,022.57	0.15
69	600996	贵广网络	11,958	224,690.82	0.10
70	002779	中坚科技	6,500	219,440.00	0.10
71	000708	大冶特钢	17,200	219,128.00	0.10
72	603708	家家悦	5,874	185,794.62	0.09
73	603986	兆易创新	831	147,893.07	0.07

74	300569	天能重工	1,314	131,452.56	0.06
75	002822	中装建设	4,097	118,362.33	0.06
76	002831	裕同科技	1,620	112,104.00	0.05
77	300568	星源材质	1,310	107,262.80	0.05
78	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.05
79	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.05
80	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.05
81	300565	科信技术	2,382	94,517.76	0.04
82	300319	麦捷科技	2,300	90,367.00	0.04
83	002823	凯中精密	1,947	89,951.40	0.04
84	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.04
85	300104	乐视网	2,200	78,760.00	0.04
86	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.03
87	603987	康德莱	2,222	71,748.38	0.03
88	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
89	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03
90	603336	宏辉果蔬	1,471	69,239.97	0.03
91	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.03
92	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.03
93	603819	神力股份	1,698	67,580.40	0.03
94	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.03
95	002819	东方中科	1,293	61,559.73	0.03
96	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.03
97	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.03
98	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.03
99	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.03
100	002825	纳尔股份	1,139	53,521.61	0.02
101	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.02
102	603633	徕木股份	1,258	51,590.58	0.02
103	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.02
104	603585	苏利股份	694	48,385.68	0.02
105	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.02
106	603878	武进不锈	1,194	47,760.00	0.02
107	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.02
108	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
109	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.02
110	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.02
111	603689	皖天然气	4,819	37,925.53	0.02
112	601163	三角轮胎	1,078	36,598.10	0.02

113	601882	海天精工	1,448	36,547.52	0.02
114	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.02
115	603886	元祖股份	1,569	27,771.30	0.01
116	603228	景旺电子	1,143	26,471.88	0.01
117	603239	浙江仙通	835	26,260.75	0.01
118	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
119	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
120	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
121	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
122	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
123	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
124	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
125	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
126	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
127	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
128	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
129	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
130	300537	广信材料	24	1,170.96	0.00

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	600383	金地集团	51,184,510.39	26.45
2	600549	厦门钨业	42,904,914.49	22.17
3	000937	冀中能源	40,707,969.95	21.03
4	000402	金融街	39,604,887.72	20.46
5	600111	北方稀土	37,901,589.63	19.58
6	600048	保利地产	37,194,439.86	19.22
7	001979	招商蛇口	35,627,144.59	18.41
8	600519	贵州茅台	35,403,887.89	18.29
9	601699	潞安环能	35,383,424.77	18.28
10	601225	陕西煤业	34,589,473.90	17.87
11	000983	西山煤电	33,161,357.47	17.14
12	601688	华泰证券	33,019,177.66	17.06

13	600259	广晟有色	32,932,622.54	17.02
14	600188	兖州煤业	32,487,560.73	16.79
15	600606	绿地控股	31,977,119.00	16.52
16	601898	中煤能源	31,193,463.93	16.12
17	600397	安源煤业	29,873,027.14	15.44
18	000960	锡业股份	29,309,948.96	15.14
19	601166	兴业银行	29,011,944.64	14.99
20	600997	开滦股份	28,983,463.15	14.98
21	600010	包钢股份	27,752,761.50	14.34
22	000060	中金岭南	27,649,840.50	14.29
23	000709	河钢股份	27,342,864.68	14.13
24	601600	中国铝业	25,875,779.00	13.37
25	600085	同仁堂	25,767,903.16	13.31
26	000831	*ST 五稀	24,890,012.25	12.86
27	000630	铜陵有色	24,594,054.00	12.71
28	600497	驰宏锌锗	24,584,386.54	12.70
29	600395	盘江股份	24,326,684.40	12.57
30	002362	汉王科技	24,153,963.00	12.48
31	600109	国金证券	23,391,945.18	12.09
32	601336	新华保险	22,725,722.59	11.74
33	000807	云铝股份	22,658,374.31	11.71
34	601555	东吴证券	22,063,893.14	11.40
35	000002	万科A	21,929,060.77	11.33
36	600958	东方证券	21,677,142.04	11.20
37	600325	华发股份	21,511,557.48	11.12
38	601666	平煤股份	21,049,550.69	10.88
39	002446	盛路通信	20,905,912.75	10.80
40	601818	光大银行	20,490,937.90	10.59
41	600160	巨化股份	20,079,535.81	10.38
42	600971	恒源煤电	20,064,050.66	10.37
43	300302	同有科技	20,025,600.70	10.35
44	601198	东兴证券	19,994,951.12	10.33
45	002500	山西证券	19,991,169.15	10.33
46	000930	中粮生化	19,906,121.80	10.29
47	000878	云南铜业	19,645,378.13	10.15
48	300030	阳普医疗	19,353,648.80	10.00

49	601998	中信银行	19,123,135.11	9.88
50	002128	露天煤业	18,998,545.54	9.82
51	002284	亚太股份	18,600,114.86	9.61
52	300096	易联众	18,465,271.81	9.54
53	600348	阳泉煤业	18,447,058.03	9.53
54	300168	万达信息	18,411,345.84	9.51
55	000751	锌业股份	18,332,139.43	9.47
56	300383	光环新网	18,197,175.07	9.40
57	002202	金风科技	18,166,285.99	9.39
58	601118	海南橡胶	18,140,512.29	9.37
59	000776	广发证券	18,085,266.99	9.34
60	600782	新钢股份	17,823,298.82	9.21
61	600392	盛和资源	17,750,771.30	9.17
62	300166	东方国信	17,746,796.32	9.17
63	002070	众和股份	17,728,835.92	9.16
64	300009	安科生物	17,592,903.00	9.09
65	000732	泰禾集团	17,543,629.97	9.07
66	300098	高新兴	17,539,608.62	9.06
67	002268	卫士通	17,451,338.75	9.02
68	300097	智云股份	17,389,535.21	8.99
69	600155	宝硕股份	17,286,294.00	8.93
70	600697	欧亚集团	17,090,400.25	8.83
71	600598	北大荒	16,906,085.04	8.74
72	000998	隆平高科	16,828,060.95	8.70
73	002183	怡亚通	16,766,667.63	8.66
74	000932	华菱钢铁	16,721,492.77	8.64
75	000670	*ST 盈方	16,609,549.34	8.58
76	600619	海立股份	16,449,927.00	8.50
77	600622	嘉宝集团	16,404,434.36	8.48
78	600123	兰花科创	16,365,012.19	8.46
79	600694	大商股份	16,173,874.02	8.36
80	002537	海立美达	15,903,473.06	8.22
81	000783	长江证券	15,888,946.38	8.21
82	603019	中科曙光	15,793,328.16	8.16
83	600343	航天动力	15,725,477.45	8.13
84	300084	海默科技	15,409,545.18	7.96

85	002428	云南锗业	15,366,413.13	7.94
86	600005	武钢股份	15,159,556.18	7.83
87	002518	科士达	14,961,827.08	7.73
88	601788	光大证券	14,822,727.18	7.66
89	601088	中国神华	14,546,192.67	7.52
90	002230	科大讯飞	14,379,032.92	7.43
91	600961	株冶集团	14,342,638.56	7.41
92	300252	金信诺	14,289,052.73	7.38
93	000728	国元证券	14,237,030.94	7.36
94	300222	科大智能	14,199,016.31	7.34
95	300208	恒顺众昇	14,150,634.00	7.31
96	601001	大同煤业	14,097,533.31	7.28
97	000933	*ST 神火	13,956,511.50	7.21
98	600432	*ST 吉恩	13,882,241.80	7.17
99	300523	辰安科技	13,852,190.00	7.16
100	300007	汉威电子	13,661,078.91	7.06
101	300452	山河药辅	13,656,846.66	7.06
102	002378	章源钨业	13,651,572.91	7.05
103	002090	金智科技	13,622,053.45	7.04
104	000821	京山轻机	13,613,099.46	7.03
105	600061	国投安信	13,321,471.25	6.88
106	603799	华友钴业	13,319,350.63	6.88
107	002146	荣盛发展	13,281,093.90	6.86
108	002488	金固股份	13,240,256.22	6.84
109	002673	西部证券	13,149,671.22	6.79
110	002273	水晶光电	13,121,699.17	6.78
111	002136	安纳达	13,110,296.13	6.77
112	000898	鞍钢股份	13,092,470.85	6.77
113	600399	抚顺特钢	12,774,971.00	6.60
114	300188	美亚柏科	12,731,100.57	6.58
115	600208	新潮中宝	12,622,823.84	6.52
116	300310	宜通世纪	12,599,561.10	6.51
117	600648	外高桥	12,574,145.38	6.50
118	300085	银之杰	12,558,034.82	6.49
119	600157	永泰能源	12,540,948.99	6.48
120	600030	中信证券	12,524,214.50	6.47

121	000166	申万宏源	12,423,515.12	6.42
122	300207	欣旺达	12,394,193.55	6.40
123	000631	顺发恒业	12,361,654.35	6.39
124	300036	超图软件	12,279,686.08	6.35
125	300481	濮阳惠成	12,227,348.72	6.32
126	600576	万家文化	12,135,649.84	6.27
127	300486	东杰智能	12,119,721.50	6.26
128	300369	绿盟科技	12,090,730.90	6.25
129	002077	大港股份	12,062,938.90	6.23
130	600963	岳阳林纸	12,050,703.58	6.23
131	300101	振芯科技	11,972,664.58	6.19
132	300088	长信科技	11,882,494.53	6.14
133	000625	长安汽车	11,861,958.00	6.13
134	300299	富春通信	11,854,533.28	6.13
135	000532	力合股份	11,826,051.81	6.11
136	300033	同花顺	11,815,286.90	6.11
137	600688	上海石化	11,798,263.70	6.10
138	002113	天润数娱	11,792,428.35	6.09
139	000795	英洛华	11,789,572.23	6.09
140	601101	昊华能源	11,773,721.09	6.08
141	000750	国海证券	11,667,887.68	6.03
142	600595	中孚实业	11,621,762.30	6.01
143	002736	国信证券	11,584,289.01	5.99
144	601958	金钼股份	11,504,106.56	5.94
145	600871	石化油服	11,474,187.00	5.93
146	300081	恒信移动	11,418,800.64	5.90
147	000959	首钢股份	11,412,276.95	5.90
148	300144	宋城演艺	11,409,393.31	5.90
149	000786	北新建材	11,403,542.48	5.89
150	300359	全通教育	11,342,892.00	5.86
151	002439	启明星辰	11,235,355.37	5.81
152	000612	焦作万方	11,096,362.58	5.73
153	002041	登海种业	11,062,287.96	5.72
154	600340	华夏幸福	11,024,340.60	5.70
155	000926	福星股份	10,905,070.35	5.63
156	000975	银泰资源	10,890,693.02	5.63

157	601800	中国交建	10,884,238.00	5.62
158	300001	特锐德	10,877,489.90	5.62
159	600378	天科股份	10,872,788.58	5.62
160	000797	中国武夷	10,787,558.57	5.57
161	600231	凌钢股份	10,758,423.23	5.56
162	300078	思创医惠	10,754,686.54	5.56
163	600999	招商证券	10,728,868.71	5.54
164	600376	首开股份	10,701,559.05	5.53
165	000018	神州长城	10,641,241.50	5.50
166	000656	金科股份	10,605,897.99	5.48
167	000552	靖远煤电	10,599,033.38	5.48
168	600737	中粮屯河	10,593,488.80	5.47
169	300236	上海新阳	10,566,818.42	5.46
170	300059	东方财富	10,515,691.20	5.43
171	000712	锦龙股份	10,472,121.45	5.41
172	601377	兴业证券	10,464,381.82	5.41
173	300347	泰格医药	10,438,551.61	5.39
174	000996	中国中期	10,414,416.60	5.38
175	600403	大有能源	10,274,531.04	5.31
176	002326	永太科技	10,206,487.90	5.27
177	600546	*ST 山煤	10,197,955.43	5.27
178	002769	普路通	10,183,340.50	5.26
179	300401	花园生物	10,129,290.76	5.23
180	300113	顺网科技	10,122,420.29	5.23
181	600446	金证股份	10,113,791.20	5.23
182	300104	乐视网	10,112,493.00	5.23
183	600988	赤峰黄金	10,106,946.06	5.22
184	002103	广博股份	10,104,206.51	5.22
185	300379	东方通	9,936,906.00	5.13
186	601003	柳钢股份	9,916,688.01	5.12
187	002364	中恒电气	9,910,723.73	5.12
188	002019	亿帆医药	9,896,985.92	5.11
189	603993	洛阳钼业	9,819,140.50	5.07
190	002590	万安科技	9,808,901.73	5.07
191	600117	西宁特钢	9,770,006.60	5.05
192	300170	汉得信息	9,766,668.43	5.05

193	600459	贵研铂业	9,602,477.70	4.96
194	601009	南京银行	9,523,266.92	4.92
195	600802	福建水泥	9,483,918.22	4.90
196	300248	新开普	9,482,590.32	4.90
197	600699	均胜电子	9,432,202.00	4.87
198	002407	多氟多	9,348,566.00	4.83
199	600569	安阳钢铁	9,313,194.50	4.81
200	601918	*ST 新集	9,310,989.03	4.81
201	300339	润和软件	9,301,106.00	4.81
202	000761	本钢板材	9,162,860.40	4.73
203	000426	兴业矿业	9,117,741.54	4.71
204	000671	阳光城	9,116,705.00	4.71
205	601989	中国重工	9,108,984.00	4.71
206	600489	中金黄金	9,099,783.66	4.70
207	600019	宝钢股份	9,004,329.21	4.65
208	600206	有研新材	8,982,568.00	4.64
209	002224	三力士	8,978,465.49	4.64
210	300384	三联虹普	8,967,284.20	4.63
211	000952	广济药业	8,866,245.25	4.58
212	002444	巨星科技	8,802,794.64	4.55
213	600686	金龙汽车	8,794,871.98	4.54
214	000768	中航飞机	8,754,007.40	4.52
215	002142	宁波银行	8,734,335.00	4.51
216	000151	中成股份	8,734,168.29	4.51
217	300276	三丰智能	8,702,190.14	4.50
218	002601	佰利联	8,688,312.50	4.49
219	600022	山东钢铁	8,660,956.06	4.48
220	600808	马钢股份	8,654,420.24	4.47
221	002742	三圣股份	8,635,390.00	4.46
222	300410	正业科技	8,626,862.47	4.46
223	300377	赢时胜	8,619,538.20	4.45
224	002001	新和成	8,587,481.48	4.44
225	300364	中文在线	8,544,863.70	4.42
226	600015	华夏银行	8,541,210.00	4.41
227	600547	山东黄金	8,535,300.02	4.41
228	600148	长春一东	8,475,466.24	4.38

229	300065	海兰信	8,447,308.32	4.36
230	300100	双林股份	8,439,193.50	4.36
231	000012	南玻A	8,419,387.01	4.35
232	300341	麦迪电气	8,405,620.50	4.34
233	300229	拓尔思	8,379,794.15	4.33
234	600303	曙光股份	8,362,618.10	4.32
235	600743	华远地产	8,333,008.78	4.31
236	002184	海得控制	8,314,185.34	4.30
237	300211	亿通科技	8,215,246.97	4.24
238	000779	三毛派神	8,188,408.94	4.23
239	600748	上实发展	8,178,103.82	4.23
240	600278	东方创业	8,161,601.95	4.22
241	002114	罗平锌电	8,061,256.13	4.17
242	000523	广州浪奇	8,030,753.52	4.15
243	002299	圣农发展	8,000,559.96	4.13
244	600848	上海临港	7,919,151.92	4.09
245	002205	国统股份	7,811,919.39	4.04
246	600702	沱牌舍得	7,808,651.59	4.03
247	300176	鸿特精密	7,721,435.34	3.99
248	600820	隧道股份	7,648,415.48	3.95
249	600108	亚盛集团	7,609,321.56	3.93
250	600075	新疆天业	7,605,825.89	3.93
251	002562	兄弟科技	7,603,557.00	3.93
252	600433	冠豪高新	7,574,362.29	3.91
253	000563	陕国投A	7,569,743.06	3.91
254	300395	菲利华	7,516,549.78	3.88
255	000629	*ST 钒钛	7,514,599.00	3.88
256	002385	大北农	7,496,847.00	3.87
257	002066	瑞泰科技	7,490,880.06	3.87
258	300017	网宿科技	7,484,352.92	3.87
259	002104	恒宝股份	7,443,422.00	3.85
260	600833	第一医药	7,414,207.59	3.83
261	600000	浦发银行	7,410,887.26	3.83
262	600552	凯盛科技	7,409,751.20	3.83
263	002155	湖南黄金	7,407,767.56	3.83
264	601668	中国建筑	7,380,085.85	3.81

265	300270	中威电子	7,377,117.52	3.81
266	600176	中国巨石	7,359,098.70	3.80
267	601901	方正证券	7,318,518.00	3.78
268	002145	中核钛白	7,209,967.14	3.73
269	000686	东北证券	7,209,016.81	3.73
270	002643	万润股份	7,203,478.00	3.72
271	300157	恒泰艾普	7,193,709.85	3.72
272	002305	南国置业	7,189,228.00	3.71
273	601628	中国人寿	7,184,051.51	3.71
274	600172	黄河旋风	7,169,229.64	3.70
275	600838	上海九百	7,167,234.47	3.70
276	601211	国泰君安	7,117,803.42	3.68
277	300458	全志科技	7,100,507.46	3.67
278	601099	太平洋	7,084,218.00	3.66
279	600628	新世界	7,070,885.13	3.65
280	000608	阳光股份	7,055,512.41	3.65
281	002382	蓝帆医疗	7,024,661.89	3.63
282	300083	劲胜精密	7,015,465.76	3.63
283	002716	金贵银业	7,015,056.32	3.62
284	002560	通达股份	7,001,894.00	3.62
285	300024	机器人	6,981,467.00	3.61
286	002174	游族网络	6,952,326.58	3.59
287	600429	三元股份	6,942,384.00	3.59
288	002751	易尚展示	6,932,616.15	3.58
289	601229	上海银行	6,921,231.53	3.58
290	600784	鲁银投资	6,917,710.00	3.57
291	600491	龙元建设	6,916,488.00	3.57
292	002056	横店东磁	6,905,758.00	3.57
293	002120	新海股份	6,901,263.00	3.57
294	300008	天海防务	6,898,122.07	3.56
295	002502	骅威文化	6,893,731.05	3.56
296	300141	和顺电气	6,867,551.16	3.55
297	600777	新潮能源	6,818,067.85	3.52
298	600149	廊坊发展	6,797,600.00	3.51
299	601005	重庆钢铁	6,788,903.00	3.51
300	000567	海德股份	6,777,657.84	3.50

301	002715	登云股份	6,776,141.80	3.50
302	600307	酒钢宏兴	6,762,935.00	3.49
303	600689	上海三毛	6,739,295.76	3.48
304	300508	维宏股份	6,725,048.60	3.47
305	600837	海通证券	6,717,131.26	3.47
306	600570	恒生电子	6,710,546.90	3.47
307	002626	金达威	6,604,605.96	3.41
308	300271	华宇软件	6,596,871.16	3.41
309	002007	华兰生物	6,582,368.12	3.40
310	600213	亚星客车	6,580,802.34	3.40
311	002671	龙泉股份	6,579,281.87	3.40
312	601933	永辉超市	6,537,773.00	3.38
313	300470	日机密封	6,532,125.80	3.38
314	000615	京汉股份	6,492,749.94	3.35
315	000733	振华科技	6,473,968.79	3.35
316	000911	南宁糖业	6,467,564.00	3.34
317	601908	京运通	6,465,057.71	3.34
318	002036	联创电子	6,448,533.59	3.33
319	002448	中原内配	6,437,872.46	3.33
320	000687	华讯方舟	6,437,829.39	3.33
321	002371	七星电子	6,417,082.31	3.32
322	601038	一拖股份	6,381,503.96	3.30
323	000537	广宇发展	6,357,635.93	3.29
324	600058	五矿发展	6,354,754.60	3.28
325	002247	帝龙文化	6,293,313.16	3.25
326	600824	益民集团	6,288,740.46	3.25
327	300415	伊之密	6,285,176.55	3.25
328	002420	毅昌股份	6,265,458.13	3.24
329	002575	群兴玩具	6,225,469.67	3.22
330	600708	光明地产	6,218,596.24	3.21
331	601866	中海集运	6,209,273.00	3.21
332	600272	开开实业	6,204,150.38	3.21
333	600787	中储股份	6,155,475.18	3.18
334	600126	杭钢股份	6,153,406.36	3.18
335	600616	金枫酒业	6,153,356.94	3.18
336	000758	中色股份	6,115,625.00	3.16

337	600120	浙江东方	6,112,381.00	3.16
338	600714	金瑞矿业	6,106,248.51	3.16
339	000780	平庄能源	6,104,202.00	3.15
340	002261	拓维信息	6,079,046.96	3.14
341	002245	澳洋顺昌	6,054,856.66	3.13
342	601689	拓普集团	6,037,809.40	3.12
343	300400	劲拓股份	6,020,744.48	3.11
344	002529	海源机械	6,016,133.41	3.11
345	300287	飞利信	5,982,682.00	3.09
346	000651	格力电器	5,979,841.00	3.09
347	600535	天士力	5,926,459.26	3.06
348	600115	东方航空	5,911,616.00	3.05
349	000019	深深宝A	5,908,691.00	3.05
350	000858	五粮液	5,893,892.40	3.05
351	600850	华东电脑	5,878,418.29	3.04
352	002519	银河电子	5,869,455.14	3.03
353	002559	亚威股份	5,816,289.00	3.01
354	300161	华中数控	5,804,248.26	3.00
355	300228	富瑞特装	5,765,598.64	2.98
356	002177	御银股份	5,760,407.03	2.98
357	002395	双象股份	5,757,334.00	2.97
358	002110	三钢闽光	5,706,404.00	2.95
359	000417	合肥百货	5,703,856.95	2.95
360	600662	强生控股	5,678,729.00	2.93
361	002693	双成药业	5,628,522.95	2.91
362	000001	平安银行	5,628,360.00	2.91
363	002755	东方新星	5,615,422.09	2.90
364	002436	兴森科技	5,605,368.84	2.90
365	002782	可立克	5,598,183.00	2.89
366	300501	海顺新材	5,595,977.00	2.89
367	600391	成发科技	5,590,786.25	2.89
368	600759	洲际油气	5,556,352.00	2.87
369	300198	纳川股份	5,554,993.06	2.87
370	002458	益生股份	5,553,754.40	2.87
371	600536	中国软件	5,528,456.37	2.86
372	002609	捷顺科技	5,524,992.31	2.85

373	000031	中粮地产	5,522,309.45	2.85
374	300340	科恒股份	5,521,525.00	2.85
375	601618	中国中冶	5,517,751.00	2.85
376	600031	三一重工	5,499,131.50	2.84
377	002756	永兴特钢	5,495,567.00	2.84
378	002189	利达光电	5,492,279.40	2.84
379	002416	爱施德	5,492,219.86	2.84
380	300264	佳创视讯	5,491,191.10	2.84
381	600780	通宝能源	5,478,823.77	2.83
382	603901	永创智能	5,438,573.00	2.81
383	300018	中元股份	5,367,572.20	2.77
384	600638	新黄浦	5,363,627.00	2.77
385	600036	招商银行	5,352,206.22	2.77
386	300490	华自科技	5,346,599.00	2.76
387	002581	未名医药	5,324,133.48	2.75
388	002355	兴民智通	5,309,012.00	2.74
389	600331	宏达股份	5,300,676.00	2.74
390	002009	天奇股份	5,293,931.80	2.74
391	300022	吉峰农机	5,293,585.77	2.74
392	600639	浦东金桥	5,287,759.00	2.73
393	601718	际华集团	5,285,058.00	2.73
394	000778	新兴铸管	5,274,314.00	2.73
395	600866	*ST 星湖	5,272,013.00	2.72
396	000011	深物业 A	5,244,759.40	2.71
397	000022	深赤湾 A	5,199,787.40	2.69
398	600809	山西汾酒	5,184,084.65	2.68
399	300354	东华测试	5,179,099.59	2.68
400	600834	申通地铁	5,169,124.97	2.67
401	601069	西部黄金	5,160,067.04	2.67
402	000971	高升控股	5,148,872.00	2.66
403	600128	弘业股份	5,138,067.00	2.65
404	300173	智慧松德	5,128,909.75	2.65
405	002738	中矿资源	5,124,070.20	2.65
406	600559	老白干酒	5,123,704.00	2.65
407	002148	北纬通信	5,123,604.88	2.65
408	300073	当升科技	5,120,608.00	2.65

409	600074	保千里	5,117,450.00	2.64
410	000688	建新矿业	5,098,573.95	2.63
411	300087	荃银高科	5,087,739.50	2.63
412	002466	天齐锂业	5,078,358.00	2.62
413	600766	园城黄金	5,073,566.75	2.62
414	600876	洛阳玻璃	5,059,897.70	2.61
415	000006	深振业A	5,048,222.76	2.61
416	000554	泰山石油	4,988,269.00	2.58
417	600284	浦东建设	4,957,780.00	2.56
418	002426	胜利精密	4,949,316.70	2.56
419	002353	杰瑞股份	4,944,943.77	2.56
420	300066	三川智慧	4,923,955.50	2.54
421	300479	神思电子	4,912,967.48	2.54
422	002384	东山精密	4,905,100.08	2.53
423	300418	昆仑万维	4,877,279.22	2.52
424	000540	中天城投	4,864,191.87	2.51
425	600501	航天晨光	4,852,866.38	2.51
426	002055	得润电子	4,831,756.20	2.50
427	601128	常熟银行	4,825,655.98	2.49
428	000100	TCL 集团	4,823,390.00	2.49
429	300322	硕贝德	4,818,026.00	2.49
430	002191	劲嘉股份	4,810,148.00	2.49
431	600422	昆药集团	4,796,243.27	2.48
432	000039	中集集团	4,787,216.14	2.47
433	002192	融捷股份	4,786,954.00	2.47
434	300130	新国都	4,736,648.00	2.45
435	000708	大冶特钢	4,735,169.50	2.45
436	000713	丰乐种业	4,733,368.00	2.45
437	603018	中设集团	4,687,663.25	2.42
438	600801	华新水泥	4,684,818.58	2.42
439	300202	聚龙股份	4,677,153.00	2.42
440	600073	上海梅林	4,666,898.00	2.41
441	002321	华英农业	4,661,824.62	2.41
442	600562	国睿科技	4,659,967.00	2.41
443	002057	中钢天源	4,650,964.86	2.40
444	300031	宝通科技	4,649,305.00	2.40

445	002642	荣之联	4,641,242.25	2.40
446	600179	*ST 黑化	4,624,282.00	2.39
447	300021	大禹节水	4,588,268.37	2.37
448	000969	安泰科技	4,576,468.49	2.36
449	300253	卫宁健康	4,550,151.00	2.35
450	002037	久联发展	4,540,799.22	2.35
451	300240	飞力达	4,529,055.00	2.34
452	300373	扬杰科技	4,515,947.00	2.33
453	002443	金洲管道	4,512,111.12	2.33
454	601766	中国中车	4,498,738.70	2.32
455	002279	久其软件	4,485,058.00	2.32
456	600843	上工申贝	4,479,166.00	2.31
457	000410	沈阳机床	4,457,269.50	2.30
458	000032	深桑达 A	4,448,873.80	2.30
459	300106	西部牧业	4,435,299.45	2.29
460	600887	伊利股份	4,419,965.40	2.28
461	002354	天神娱乐	4,404,561.09	2.28
462	300467	迅游科技	4,401,313.76	2.27
463	300491	通合科技	4,371,804.50	2.26
464	000701	厦门信达	4,371,638.76	2.26
465	000524	岭南控股	4,369,714.00	2.26
466	002357	富临运业	4,328,678.20	2.24
467	600678	四川金顶	4,321,568.00	2.23
468	300284	苏交科	4,320,526.28	2.23
469	300348	长亮科技	4,311,141.34	2.23
470	002013	中航机电	4,280,995.44	2.21
471	600017	日照港	4,275,318.00	2.21
472	600141	兴发集团	4,253,033.43	2.20
473	000681	视觉中国	4,225,130.24	2.18
474	600872	中炬高新	4,223,139.00	2.18
475	300451	创业软件	4,221,005.99	2.18
476	300484	蓝海华腾	4,214,361.00	2.18
477	601233	桐昆股份	4,212,823.00	2.18
478	002343	慈文传媒	4,207,939.50	2.17
479	300450	先导智能	4,168,170.47	2.15
480	601012	隆基股份	4,165,706.65	2.15

481	002795	永和智控	4,164,661.50	2.15
482	300127	银河磁体	4,161,599.17	2.15
483	601333	广深铁路	4,161,061.00	2.15
484	000901	航天科技	4,158,149.99	2.15
485	000895	双汇发展	4,120,320.25	2.13
486	600682	南京新百	4,114,468.00	2.13
487	300286	安科瑞	4,102,509.41	2.12
488	601328	交通银行	4,098,289.00	2.12
489	601919	中国远洋	4,093,515.00	2.12
490	300336	新文化	4,090,084.44	2.11
491	600728	佳都科技	4,074,247.80	2.11
492	600676	交运股份	4,067,379.45	2.10
493	600755	厦门国贸	4,050,774.94	2.09
494	002210	飞马国际	4,043,228.90	2.09
495	002020	京新药业	4,042,229.00	2.09
496	600775	南京熊猫	4,041,819.00	2.09
497	600650	锦江投资	4,024,841.63	2.08
498	600306	*ST 商城	4,001,073.00	2.07
499	000090	天健集团	3,998,688.00	2.07
500	300446	乐凯新材	3,951,908.02	2.04
501	603609	禾丰牧业	3,951,866.00	2.04
502	000735	罗牛山	3,944,009.47	2.04
503	000157	中联重科	3,939,898.00	2.04
504	002313	日海通讯	3,935,048.00	2.03
505	300191	潜能恒信	3,924,232.50	2.03
506	000050	深天马A	3,921,255.42	2.03
507	002165	红宝丽	3,913,474.84	2.02
508	002522	浙江众成	3,900,093.00	2.02
509	300474	景嘉微	3,893,639.52	2.01
510	601020	华钰矿业	3,881,006.26	2.01
511	002085	万丰奥威	3,879,981.52	2.00
512	000759	中百集团	3,869,345.53	2.00

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	600383	金地集团	50,944,715.85	26.32
2	600549	厦门钨业	42,608,215.45	22.02
3	000937	冀中能源	41,451,084.92	21.42
4	000402	金融街	39,488,486.10	20.40
5	600048	保利地产	38,374,374.18	19.83
6	600111	北方稀土	37,000,713.22	19.12
7	001979	招商蛇口	36,681,674.86	18.95
8	601699	潞安环能	35,818,777.17	18.51
9	601225	陕西煤业	34,460,461.06	17.81
10	000983	西山煤电	33,124,837.70	17.12
11	601688	华泰证券	33,031,837.79	17.07
12	600259	广晟有色	32,533,969.16	16.81
13	600188	兖州煤业	32,492,313.68	16.79
14	600606	绿地控股	31,838,532.71	16.45
15	601898	中煤能源	31,042,991.20	16.04
16	000960	锡业股份	30,127,083.94	15.57
17	600397	安源煤业	29,550,414.18	15.27
18	601166	兴业银行	29,381,211.67	15.18
19	600997	开滦股份	28,384,774.25	14.67
20	000060	中金岭南	27,954,793.06	14.44
21	000709	河钢股份	27,363,216.76	14.14
22	600010	包钢股份	27,192,097.90	14.05
23	600085	同仁堂	26,260,531.58	13.57
24	601600	中国铝业	25,431,598.17	13.14
25	600497	驰宏锌锗	25,282,983.93	13.06
26	000831	*ST 五稀	24,680,009.52	12.75
27	600109	国金证券	24,599,615.05	12.71
28	000630	铜陵有色	24,323,131.00	12.57
29	002362	汉王科技	24,319,161.31	12.57
30	600395	盘江股份	24,003,455.38	12.40
31	601336	新华保险	23,368,005.44	12.07
32	601555	东吴证券	23,059,000.98	11.91
33	000807	云铝股份	23,048,883.80	11.91
34	000002	万科A	22,524,107.64	11.64

35	600325	华发股份	22,118,590.08	11.43
36	600519	贵州茅台	21,992,673.64	11.36
37	600958	东方证券	21,919,490.06	11.33
38	601666	平煤股份	21,188,561.72	10.95
39	002446	盛路通信	20,970,170.43	10.84
40	601198	东兴证券	20,638,487.59	10.66
41	601818	光大银行	20,494,433.72	10.59
42	002500	山西证券	20,183,821.12	10.43
43	300302	同有科技	19,835,164.30	10.25
44	300030	阳普医疗	19,808,764.40	10.24
45	600971	恒源煤电	19,804,070.61	10.23
46	000878	云南铜业	19,790,814.64	10.23
47	600160	巨化股份	19,767,085.40	10.21
48	000776	广发证券	19,011,639.99	9.82
49	002128	露天煤业	18,974,959.29	9.80
50	300168	万达信息	18,813,254.16	9.72
51	300383	光环新网	18,662,462.82	9.64
52	002202	金风科技	18,640,256.12	9.63
53	300096	易联众	18,604,055.73	9.61
54	000751	锌业股份	18,571,901.48	9.60
55	002284	亚太股份	18,563,586.69	9.59
56	600348	阳泉煤业	18,452,920.28	9.53
57	300097	智云股份	18,209,170.56	9.41
58	300166	东方国信	18,191,667.31	9.40
59	300009	安科生物	17,893,688.07	9.25
60	002070	众和股份	17,832,451.96	9.21
61	000732	泰禾集团	17,814,527.25	9.21
62	601118	海南橡胶	17,798,027.79	9.20
63	002268	卫士通	17,674,068.02	9.13
64	000930	中粮生化	17,602,079.12	9.10
65	600392	盛和资源	17,510,810.46	9.05
66	000932	华菱钢铁	17,502,311.76	9.04
67	300098	高新兴	17,429,277.97	9.01
68	600782	新钢股份	17,413,854.64	9.00
69	601998	中信银行	17,377,880.06	8.98
70	600155	宝硕股份	17,099,566.58	8.84
71	000998	隆平高科	17,081,518.00	8.83
72	600697	欧亚集团	16,874,843.02	8.72

73	000783	长江证券	16,283,699.65	8.41
74	600123	兰花科创	16,186,563.07	8.36
75	600694	大商股份	16,186,524.28	8.36
76	300084	海默科技	16,183,295.88	8.36
77	600622	嘉宝集团	16,043,474.98	8.29
78	002183	怡亚通	15,615,888.11	8.07
79	002518	科士达	15,380,776.21	7.95
80	002537	海立美达	15,326,674.87	7.92
81	002428	云南锗业	15,286,313.33	7.90
82	601788	光大证券	15,280,096.31	7.90
83	000728	国元证券	15,187,823.66	7.85
84	603019	中科曙光	14,958,421.56	7.73
85	600005	武钢股份	14,896,861.22	7.70
86	300222	科大智能	14,842,672.56	7.67
87	300252	金信诺	14,794,569.62	7.64
88	000670	*ST 盈方	14,603,898.38	7.55
89	002230	科大讯飞	14,529,567.99	7.51
90	600343	航天动力	14,504,700.84	7.49
91	601088	中国神华	14,387,046.84	7.43
92	000821	京山轻机	14,295,943.42	7.39
93	600598	北大荒	14,266,383.61	7.37
94	300007	汉威电子	14,034,770.51	7.25
95	300452	山河药辅	14,028,276.73	7.25
96	600961	株冶集团	13,984,113.31	7.23
97	600061	国投安信	13,980,590.86	7.22
98	600432	*ST 吉恩	13,901,526.82	7.18
99	000933	*ST 神火	13,887,102.29	7.18
100	300208	恒顺众昇	13,727,720.62	7.09
101	002673	西部证券	13,681,412.80	7.07
102	603799	华友钴业	13,565,012.33	7.01
103	002273	水晶光电	13,484,749.75	6.97
104	002378	章源钨业	13,467,180.79	6.96
105	601001	大同煤业	13,463,918.57	6.96
106	600576	万家文化	13,245,494.52	6.84
107	600399	抚顺特钢	13,184,549.56	6.81
108	002090	金智科技	13,158,190.99	6.80
109	002146	荣盛发展	13,118,581.85	6.78
110	300486	东杰智能	13,069,724.64	6.75

111	000898	鞍钢股份	13,044,679.26	6.74
112	002488	金固股份	12,896,710.72	6.66
113	000166	申万宏源	12,869,372.11	6.65
114	600030	中信证券	12,754,260.78	6.59
115	002113	天润数娱	12,751,864.64	6.59
116	300523	辰安科技	12,738,471.84	6.58
117	300310	宜通世纪	12,687,178.47	6.56
118	002136	安纳达	12,678,132.13	6.55
119	300481	濮阳惠成	12,668,275.00	6.55
120	600208	新湖中宝	12,563,330.66	6.49
121	300088	长信科技	12,541,665.00	6.48
122	300401	花园生物	12,481,019.33	6.45
123	300188	美亚柏科	12,400,032.45	6.41
124	600648	外高桥	12,399,014.92	6.41
125	300036	超图软件	12,394,462.10	6.40
126	300085	银之杰	12,386,576.50	6.40
127	300207	欣旺达	12,371,268.43	6.39
128	000532	力合股份	12,268,275.16	6.34
129	600157	永泰能源	12,258,690.33	6.33
130	300101	振芯科技	12,162,911.85	6.28
131	300369	绿盟科技	12,139,718.80	6.27
132	000750	国海证券	12,039,810.98	6.22
133	000625	长安汽车	11,993,722.00	6.20
134	002736	国信证券	11,984,410.79	6.19
135	000631	顺发恒业	11,938,304.45	6.17
136	300081	恒信移动	11,892,420.00	6.15
137	000795	英洛华	11,798,522.22	6.10
138	600963	岳阳林纸	11,785,141.88	6.09
139	300299	富春通信	11,739,611.37	6.07
140	600595	中孚实业	11,691,912.77	6.04
141	300144	宋城演艺	11,660,357.30	6.03
142	601958	金钼股份	11,636,508.63	6.01
143	601101	昊华能源	11,540,976.69	5.96
144	300033	同花顺	11,428,666.72	5.91
145	000975	银泰资源	11,285,117.37	5.83
146	000959	首钢股份	11,267,652.46	5.82
147	300359	全通教育	11,225,704.74	5.80
148	002077	大港股份	11,217,552.43	5.80

149	002439	启明星辰	11,184,585.80	5.78
150	600999	招商证券	11,158,562.78	5.77
151	601377	兴业证券	11,070,851.00	5.72
152	300001	特锐德	11,068,177.08	5.72
153	600340	华夏幸福	10,972,900.12	5.67
154	002041	登海种业	10,948,727.65	5.66
155	000018	神州长城	10,938,250.30	5.65
156	000656	金科股份	10,930,777.16	5.65
157	000786	北新建材	10,920,883.40	5.64
158	300078	思创医惠	10,909,925.74	5.64
159	000612	焦作万方	10,853,539.00	5.61
160	000996	中国中期	10,842,983.49	5.60
161	000797	中国武夷	10,814,269.28	5.59
162	002769	普路通	10,732,247.52	5.55
163	300236	上海新阳	10,718,313.80	5.54
164	000552	靖远煤电	10,684,300.86	5.52
165	600376	首开股份	10,623,808.00	5.49
166	000712	锦龙股份	10,599,673.16	5.48
167	600403	大有能源	10,588,255.53	5.47
168	600231	凌钢股份	10,578,885.93	5.47
169	300059	东方财富	10,498,288.54	5.42
170	600688	上海石化	10,259,467.69	5.30
171	600737	中粮屯河	10,244,298.70	5.29
172	002326	永太科技	10,234,733.02	5.29
173	300248	新开普	10,160,474.72	5.25
174	601003	柳钢股份	10,147,289.92	5.24
175	600213	亚星客车	10,144,312.57	5.24
176	300104	乐视网	10,123,744.16	5.23
177	002364	中恒电气	10,094,586.87	5.22
178	000926	福星股份	10,081,266.50	5.21
179	300170	汉得信息	10,077,085.70	5.21
180	600988	赤峰黄金	10,051,317.20	5.19
181	600546	*ST 山煤	10,014,877.83	5.17
182	002590	万安科技	9,974,875.40	5.15
183	300347	泰格医药	9,870,396.15	5.10
184	300113	顺网科技	9,849,116.57	5.09
185	603993	洛阳钼业	9,828,808.94	5.08
186	300379	东方通	9,792,276.00	5.06

187	000426	兴业矿业	9,772,434.76	5.05
188	600117	西宁特钢	9,754,022.83	5.04
189	601009	南京银行	9,665,000.60	4.99
190	300339	润和软件	9,641,769.96	4.98
191	600446	金证股份	9,629,827.78	4.98
192	600378	天科股份	9,609,087.31	4.97
193	002103	广博股份	9,581,172.60	4.95
194	600699	均胜电子	9,580,373.24	4.95
195	002407	多氟多	9,566,147.00	4.94
196	002019	亿帆医药	9,530,392.76	4.92
197	600459	贵研铂业	9,416,956.73	4.87
198	600802	福建水泥	9,328,360.05	4.82
199	600569	安阳钢铁	9,268,179.02	4.79
200	600015	华夏银行	9,195,580.96	4.75
201	000761	本钢板材	9,112,791.41	4.71
202	002224	三力士	9,085,544.59	4.69
203	601918	*ST 新集	9,083,095.00	4.69
204	000671	阳光城	9,045,116.91	4.67
205	300384	三联虹普	9,013,386.66	4.66
206	600019	宝钢股份	9,009,520.35	4.66
207	600489	中金黄金	8,973,498.53	4.64
208	002444	巨星科技	8,953,516.01	4.63
209	300065	海兰信	8,862,006.07	4.58
210	600303	曙光股份	8,819,566.28	4.56
211	300276	三丰智能	8,794,071.63	4.54
212	300229	拓尔思	8,718,318.84	4.50
213	000012	南玻A	8,689,642.88	4.49
214	600206	有研新材	8,675,402.44	4.48
215	600022	山东钢铁	8,673,985.98	4.48
216	600808	马钢股份	8,616,600.85	4.45
217	300100	双林股份	8,598,133.86	4.44
218	300211	亿通科技	8,564,650.22	4.43
219	002142	宁波银行	8,553,799.00	4.42
220	002205	国统股份	8,529,899.30	4.41
221	002001	新和成	8,512,570.71	4.40
222	002114	罗平锌电	8,498,413.35	4.39
223	002742	三圣股份	8,489,170.28	4.39
224	300377	赢时胜	8,475,083.78	4.38

225	000768	中航飞机	8,470,636.04	4.38
226	000952	广济药业	8,418,220.50	4.35
227	002184	海得控制	8,410,244.00	4.35
228	600743	华远地产	8,373,295.54	4.33
229	300410	正业科技	8,348,640.10	4.31
230	300364	中文在线	8,332,877.31	4.31
231	600547	山东黄金	8,321,983.59	4.30
232	600278	东方创业	8,296,826.26	4.29
233	600748	上实发展	8,230,479.50	4.25
234	002601	佰利联	8,205,470.28	4.24
235	000779	三毛派神	8,161,443.80	4.22
236	601901	方正证券	8,047,374.32	4.16
237	300341	麦迪电气	7,973,967.95	4.12
238	002155	湖南黄金	7,968,767.00	4.12
239	600172	黄河旋风	7,903,192.04	4.08
240	000066	长城电脑	7,878,565.00	4.07
241	300176	鸿特精密	7,845,112.74	4.05
242	600702	沱牌舍得	7,717,383.95	3.99
243	600108	亚盛集团	7,673,245.01	3.96
244	002562	兄弟科技	7,621,361.48	3.94
245	000686	东北证券	7,612,242.56	3.93
246	300017	网宿科技	7,606,470.56	3.93
247	002385	大北农	7,537,449.50	3.89
248	300395	菲利华	7,502,353.50	3.88
249	300458	全志科技	7,496,289.39	3.87
250	601211	国泰君安	7,440,724.79	3.84
251	600000	浦发银行	7,407,189.62	3.83
252	601628	中国人寿	7,355,232.04	3.80
253	000629	*ST 钒钛	7,338,537.00	3.79
254	002066	瑞泰科技	7,319,751.15	3.78
255	000151	中成股份	7,310,286.31	3.78
256	600075	新疆天业	7,304,329.92	3.77
257	300270	中威电子	7,302,975.24	3.77
258	600552	凯盛科技	7,248,319.84	3.75
259	300008	天海防务	7,245,720.96	3.74
260	002716	金贵银业	7,245,566.00	3.74
261	600871	石化油服	7,236,573.00	3.74
262	002560	通达股份	7,207,220.93	3.72

263	600784	鲁银投资	7,206,923.12	3.72
264	002145	中核钛白	7,177,565.82	3.71
265	002174	游族网络	7,168,732.00	3.70
266	000911	南宁糖业	7,167,405.35	3.70
267	600433	冠豪高新	7,158,259.20	3.70
268	300157	恒泰艾普	7,156,723.04	3.70
269	002305	南国置业	7,154,355.80	3.70
270	002299	圣农发展	7,137,385.36	3.69
271	600777	新潮能源	7,098,863.38	3.67
272	300024	机器人	7,088,341.00	3.66
273	000608	阳光股份	7,065,242.11	3.65
274	002502	骅威文化	7,058,030.21	3.65
275	600120	浙江东方	7,049,964.00	3.64
276	002643	万润股份	7,038,580.00	3.64
277	002782	可立克	7,016,880.88	3.63
278	600837	海通证券	7,004,723.60	3.62
279	600148	长春一东	6,999,323.10	3.62
280	600176	中国巨石	6,996,111.12	3.62
281	002120	新海股份	6,958,739.10	3.60
282	000567	海德股份	6,937,110.00	3.58
283	601099	太平洋	6,902,990.70	3.57
284	600429	三元股份	6,902,893.00	3.57
285	601933	永辉超市	6,861,709.00	3.55
286	601005	重庆钢铁	6,836,753.38	3.53
287	002436	兴森科技	6,794,514.00	3.51
288	002671	龙泉股份	6,747,722.70	3.49
289	600307	酒钢宏兴	6,734,076.45	3.48
290	002715	登云股份	6,697,032.22	3.46
291	002382	蓝帆医疗	6,685,423.00	3.45
292	601229	上海银行	6,657,097.00	3.44
293	300141	和顺电气	6,655,501.50	3.44
294	000687	华讯方舟	6,652,557.16	3.44
295	600491	龙元建设	6,646,821.82	3.43
296	300470	日机密封	6,634,394.18	3.43
297	300508	维宏股份	6,633,775.80	3.43
298	002056	横店东磁	6,629,566.56	3.43
299	000523	广州浪奇	6,625,883.11	3.42
300	002448	中原内配	6,611,661.56	3.42

301	601908	京运通	6,604,990.74	3.41
302	000733	振华科技	6,598,916.73	3.41
303	002751	易尚展示	6,594,558.00	3.41
304	600149	廊坊发展	6,569,299.00	3.39
305	300083	劲胜精密	6,554,277.96	3.39
306	002626	金达威	6,538,082.79	3.38
307	300415	伊之密	6,488,695.24	3.35
308	300271	华宇软件	6,458,509.31	3.34
309	002104	恒宝股份	6,436,470.02	3.33
310	600570	恒生电子	6,434,595.02	3.32
311	002420	毅昌股份	6,416,548.57	3.32
312	002007	华兰生物	6,408,646.04	3.31
313	000537	广宇发展	6,387,777.86	3.30
314	000615	京汉股份	6,387,350.00	3.30
315	600058	五矿发展	6,335,544.76	3.27
316	002036	联创电子	6,334,336.50	3.27
317	600708	光明地产	6,299,642.80	3.26
318	002245	澳洋顺昌	6,296,808.24	3.25
319	002755	东方新星	6,246,267.94	3.23
320	600848	上海临港	6,241,718.00	3.23
321	000563	陕国投 A	6,202,933.00	3.21
322	002247	帝龙文化	6,133,264.22	3.17
323	600759	洲际油气	6,129,638.00	3.17
324	002261	拓维信息	6,120,354.31	3.16
325	300228	富瑞特装	6,070,529.95	3.14
326	002559	亚威股份	6,058,706.90	3.13
327	600838	上海九百	6,042,414.00	3.12
328	600126	杭钢股份	6,029,044.46	3.12
329	300400	劲拓股份	6,021,455.10	3.11
330	002177	御银股份	6,009,733.80	3.11
331	300161	华中数控	6,005,216.64	3.10
332	601038	一拖股份	5,985,578.00	3.09
333	002529	海源机械	5,983,444.11	3.09
334	002458	益生股份	5,957,676.55	3.08
335	002519	银河电子	5,954,202.02	3.08
336	600115	东方航空	5,944,066.02	3.07
337	601866	中海集运	5,931,434.00	3.06
338	600628	新世界	5,906,514.82	3.05

339	000758	中色股份	5,893,156.07	3.05
340	002371	七星电子	5,889,778.47	3.04
341	600787	中储股份	5,888,110.66	3.04
342	000890	法尔胜	5,868,504.11	3.03
343	000858	五粮液	5,864,975.49	3.03
344	002395	双象股份	5,839,564.37	3.02
345	603901	永创智能	5,802,451.08	3.00
346	002110	三钢闽光	5,777,542.41	2.99
347	000780	平庄能源	5,769,756.74	2.98
348	002575	群兴玩具	5,768,320.43	2.98
349	600714	金瑞矿业	5,762,647.00	2.98
350	002693	双成药业	5,723,686.00	2.96
351	601689	拓普集团	5,682,751.13	2.94
352	300501	海顺新材	5,681,066.00	2.94
353	000417	合肥百货	5,665,280.45	2.93
354	300287	飞利信	5,640,194.98	2.91
355	000001	平安银行	5,597,819.95	2.89
356	600766	园城黄金	5,584,842.90	2.89
357	600662	强生控股	5,580,413.78	2.88
358	002609	捷顺科技	5,574,672.02	2.88
359	600536	中国软件	5,523,164.00	2.85
360	300018	中元股份	5,518,155.24	2.85
361	600850	华东电脑	5,496,834.90	2.84
362	600141	兴发集团	5,432,899.98	2.81
363	601718	际华集团	5,432,246.00	2.81
364	300198	纳川股份	5,403,982.89	2.79
365	600780	通宝能源	5,388,211.17	2.78
366	002009	天奇股份	5,365,293.12	2.77
367	300340	科恒股份	5,360,655.00	2.77
368	601668	中国建筑	5,356,836.00	2.77
369	002189	利达光电	5,351,726.64	2.77
370	600686	金龙汽车	5,332,709.88	2.76
371	600331	宏达股份	5,325,203.84	2.75
372	300490	华自科技	5,320,750.21	2.75
373	600638	新黄浦	5,311,397.10	2.74
374	600639	浦东金桥	5,302,247.07	2.74
375	000031	中粮地产	5,290,518.38	2.73
376	002416	爱施德	5,279,561.20	2.73

377	600036	招商银行	5,269,100.35	2.72
378	000971	高升控股	5,255,472.60	2.72
379	002355	兴民智通	5,246,158.12	2.71
380	002738	中矿资源	5,233,938.23	2.70
381	000778	新兴铸管	5,225,381.00	2.70
382	002148	北纬通信	5,224,164.00	2.70
383	002581	未名医药	5,213,817.00	2.69
384	300264	佳创视讯	5,197,175.00	2.69
385	300073	当升科技	5,179,633.00	2.68
386	600074	保千里	5,149,329.89	2.66
387	600678	四川金顶	5,130,622.00	2.65
388	000688	建新矿业	5,081,613.80	2.63
389	600834	申通地铁	5,060,418.46	2.61
390	300087	荃银高科	5,057,933.17	2.61
391	601069	西部黄金	5,057,158.00	2.61
392	300066	三川智慧	5,057,102.00	2.61
393	002466	天齐锂业	5,053,573.60	2.61
394	600809	山西汾酒	5,053,344.91	2.61
395	002353	杰瑞股份	5,031,416.70	2.60
396	300354	东华测试	5,026,962.48	2.60
397	600619	海立股份	5,021,043.00	2.59
398	300173	智慧松德	5,020,171.00	2.59
399	002426	胜利精密	5,017,512.02	2.59
400	300022	吉峰农机	5,014,603.15	2.59
401	600866	*ST 星湖	5,010,194.00	2.59
402	600073	上海梅林	4,966,942.00	2.57
403	300031	宝通科技	4,930,518.24	2.55
404	600559	老白干酒	4,921,695.00	2.54
405	300284	苏交科	4,921,525.97	2.54
406	000540	中天城投	4,919,370.01	2.54
407	300479	神思电子	4,908,277.70	2.54
408	002191	劲嘉股份	4,905,665.00	2.53
409	600820	隧道股份	4,903,534.36	2.53
410	600284	浦东建设	4,898,419.23	2.53
411	000022	深赤湾A	4,892,308.37	2.53
412	300418	昆仑万维	4,879,825.38	2.52
413	603018	中设集团	4,877,389.00	2.52
414	000713	丰乐种业	4,860,728.30	2.51

415	600501	航天晨光	4,859,206.20	2.51
416	002192	融捷股份	4,847,553.66	2.50
417	000100	TCL 集团	4,832,231.86	2.50
418	002055	得润电子	4,825,242.58	2.49
419	600179	*ST 黑化	4,802,242.44	2.48
420	300130	新国都	4,793,010.06	2.48
421	300202	聚龙股份	4,789,185.00	2.47
422	600876	洛阳玻璃	4,786,691.28	2.47
423	000410	沈阳机床	4,750,652.18	2.45
424	002642	荣之联	4,747,586.00	2.45
425	300021	大禹节水	4,696,691.68	2.43
426	002384	东山精密	4,687,731.68	2.42
427	300373	扬杰科技	4,666,390.07	2.41
428	300322	硕贝德	4,654,034.00	2.40
429	002795	永和智控	4,643,103.00	2.40
430	600562	国睿科技	4,642,068.38	2.40
431	300491	通合科技	4,612,206.88	2.38
432	000039	中集集团	4,612,084.00	2.38
433	600801	华新水泥	4,582,343.60	2.37
434	600422	昆药集团	4,578,706.80	2.37
435	601128	常熟银行	4,566,287.88	2.36
436	300450	先导智能	4,539,955.59	2.35
437	002279	久其软件	4,514,841.59	2.33
438	000708	大冶特钢	4,498,585.85	2.32
439	601766	中国中车	4,463,826.00	2.31
440	000969	安泰科技	4,459,369.83	2.30
441	300253	卫宁健康	4,451,029.28	2.30
442	002321	华英农业	4,431,349.50	2.29
443	000701	厦门信达	4,404,001.00	2.28
444	002354	天神娱乐	4,371,237.73	2.26
445	300467	迅游科技	4,344,053.00	2.24
446	600887	伊利股份	4,327,263.59	2.24
447	300106	西部牧业	4,280,334.72	2.21
448	300474	景嘉微	4,252,770.16	2.20
449	002013	中航机电	4,250,135.02	2.20
450	002343	慈文传媒	4,241,541.00	2.19
451	601233	桐昆股份	4,236,275.15	2.19
452	601012	隆基股份	4,235,495.95	2.19

453	300348	长亮科技	4,193,904.50	2.17
454	300484	蓝海华腾	4,185,424.00	2.16
455	000681	视觉中国	4,161,949.75	2.15
456	600755	厦门国贸	4,147,091.00	2.14
457	600306	*ST 商城	4,145,706.00	2.14
458	300336	新文化	4,132,088.17	2.14
459	002085	万丰奥威	4,112,326.66	2.12
460	600824	益民集团	4,109,422.00	2.12
461	300240	飞力达	4,106,443.50	2.12
462	300451	创业软件	4,103,651.26	2.12
463	000524	岭南控股	4,101,741.50	2.12
464	002237	恒邦股份	4,082,061.00	2.11
465	601328	交通银行	4,080,408.00	2.11
466	600676	交运股份	4,076,949.32	2.11
467	601618	中国中冶	4,069,984.68	2.10
468	002357	富临运业	4,067,411.00	2.10
469	600872	中炬高新	4,040,869.49	2.09
470	002443	金洲管道	4,023,295.00	2.08
471	002165	红宝丽	4,003,289.63	2.07
472	600826	兰生股份	4,000,016.28	2.07
473	300286	安科瑞	3,999,923.52	2.07
474	300127	银河磁体	3,998,764.86	2.07
475	600728	佳都科技	3,993,504.80	2.06
476	000050	深天马 A	3,971,516.84	2.05
477	000895	双汇发展	3,967,856.80	2.05
478	600775	南京熊猫	3,959,859.00	2.05
479	000090	天健集团	3,929,672.30	2.03
480	002210	飞马国际	3,919,015.60	2.03
481	600650	锦江投资	3,910,140.49	2.02
482	002020	京新药业	3,900,638.57	2.02
483	000049	德赛电池	3,895,017.08	2.01
484	002522	浙江众成	3,890,695.82	2.01
485	300446	乐凯新材	3,882,878.28	2.01
486	600369	西南证券	3,864,518.00	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	6,319,518,896.72
卖出股票收入（成交）总额	6,190,346,301.48

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

本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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	876,181.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,892.54
5	应收申购款	1,425,584.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,334,658.46

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
811,613	205.38	31,631,804.16	18.98%	135,054,179.41	81.02%

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	559,320.88	0.3356%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月12日）基金份额总额	235,923,426.05
本报告期期初基金份额总额	88,492,194.93
本报告期基金总申购份额	3,633,340,723.66
减：本报告期基金总赎回份额	3,555,146,935.02
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	166,685,983.57
-------------	----------------

§ 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

基金管理人于 2016 年 3 月 16 日在指定媒介上披露了《民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第三届董事会第十七次会议审议通过，张力女士不再担任副总经理职务。

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 3 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、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。

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	
方正证券股份有限公司		11,688,378,102.56	13.50%	1,200,948.87	11.04%	-

中国银河证券股份有限公司	2	1,496,771,149.05	11.97%	1,339,426.20	12.31%	-
国金证券股份有限公司	2	1,200,842,097.80	9.60%	1,118,345.50	10.28%	本报告期新增深圳交易单元
中国国际金融股份有限公司	2	1,110,866,783.75	8.88%	1,034,549.44	9.51%	-
华泰证券股份有限公司	2	811,534,718.76	6.49%	634,215.64	5.83%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	798,274,069.11	6.38%	743,433.10	6.83%	-
中信建投证券股份有限公司	2	755,169,816.43	6.04%	600,862.87	5.52%	-
中银国际证券有限责任公司	2	653,143,019.38	5.22%	608,273.15	5.59%	-
光大证券股份有限公司	1	624,394,129.87	4.99%	581,499.00	5.34%	-
国信证券股份有限公司	1	454,263,068.24	3.63%	423,056.46	3.89%	-
安信证券股份有限公司	2	423,513,389.33	3.39%	394,417.04	3.62%	-
兴业证券股份有限公司	1	380,819,306.85	3.05%	354,657.81	3.26%	-
申万宏源证券有限公司	2	326,390,463.78	2.61%	282,348.32	2.59%	-
东方证券股份有限公司	1	312,237,206.77	2.50%	228,338.69	2.10%	-
东吴证券股份有限公司	1	290,969,230.09	2.33%	270,979.84	2.49%	-
海通证券股份有限公司	1	255,221,292.54	2.04%	237,686.81	2.18%	-
民生证券股份有限公司	1	253,056,733.16	2.02%	235,671.89	2.17%	-
长江证券股份有限公司	1	237,743,944.03	1.90%	221,410.89	2.03%	-
招商证券股份有限公司	1	237,186,670.62	1.90%	220,891.87	2.03%	-
广发证券股份有限公司	1	123,040,746.92	0.98%	114,587.65	1.05%	-
东北证券股份有限公司	1	71,134,745.60	0.57%	36,371.66	0.33%	本报告期新增深圳交易单元
英大证券有限	1	-	-	-	-	-

责任公司						
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	本报告期新 增深圳交易 单元
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	本报告期新 增深圳交易 单元
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	本报告期新 增上海、深 圳交易单元
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	25,500,000.00	1.23%	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中信建投证券 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	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	1,683,400,000.00	81.23%	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	45,400,000.00	2.19%	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	163,500,000.00	7.89%	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	154,700,000.00	7.46%	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 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本基金本期新增东北证券股份有限公司深圳交易单元、川财证券有限责任公司深圳交易单元、天风证券有限责任公司上海和深圳交易单元、华创证券有限责任公司深圳交易单元、国金证券股份有限公司深圳交易单元作为本基金交易单元；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。

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 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、公司网站	2016 年 1 月 5 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	民生加银城镇化灵活配置混合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	2016 年 1 月 21 日
6	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、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	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

	率优惠活动的公告		
8	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	2016 年 3 月 16 日
9	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
10	民生加银基金管理有限公司关于调整通过招商银行借记卡在网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
11	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 4 月 14 日
12	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2016 年 4 月 20 日
13	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
14	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
15	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前海微众银行股份有限公司为代销	中国证券报、公司网站	2016 年 4 月 26 日

	机构并参加申购费率优惠活动的公告		
16	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行直销银行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5月12日
17	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
18	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
19	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、证券时报、公司网站	2016年6月23日
20	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
21	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
22	民生加银基金管理有限公司旗下基金 2016 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	2016年7月1日
23	民生加银基金管理有限公司基金	中国证券报、公司网	2016年7月5日

	经理变更公告	站	
24	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中民财富管理（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、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 7 月 15 日
25	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 21 日
26	民生加银城镇化灵活配置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、公司网站	2016 年 7 月 21 日
27	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肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构并开通基金转换业务、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 7 月 29 日
28	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金斧子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 8 月 1 日
29	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奕丰金融服务（深圳）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	2016 年 8 月 15 日

30	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告正文及摘要	中国证券报、公司网站	2016 年 8 月 29 日
31	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煜基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务、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 9 月 6 日
32	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汇成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 9 月 6 日
33	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、公司网站	2016 年 10 月 25 日
34	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晟视天下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 10 月 28 日
35	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行直销银行申购、定期定额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 10 月 29 日
36	民生加银基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 23 日

37	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行股份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、公司网站	2016 年 11 月 29 日
38	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第一次分红公告	中国证券报、公司网站	2016 年 12 月 13 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 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 13.1.3 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 13.1.4 《民生加银城镇化灵活配置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
2017 年 3 月 30 日