

# 民生加银优选股票型证券投资基金 2015 年 半年度报告

2015 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 18 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	9
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
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.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>51</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银优选股票型证券投资基金
基金简称	民生加银优选股票
基金主代码	000884
交易代码	000884
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 19 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	417,845,073.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
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（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、中期票据、债券回购、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（但须符合中国证监会相关规定）。 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×85%+中证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	张波
	联系电话	0755-23999888	0755-22168863
	电子邮箱	linhai@msjfund.com.cn	ZHANGBO746@pingan.com.cn
客户服务电话		400-8888-388	95511-3
传真		0755-23999800	0755-82080800-0
注册地址		深圳市福田区益田路西 福 中路北新世界商务中心	中国广东省深圳市深南东路 5047 号

	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	中国广东省深圳市深南东路 5047 号
邮政编码	518026	518001
法定代表人	万青元	孙建一

## 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》、《证 券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	<a href="http://www.msjfund.com.cn">http://www.msjfund.com.cn</a>
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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	284,801,606.64
本期利润	195,881,308.63
加权平均基金份额本期利润	0.1838
本期加权平均净值利润率	16.87%
本期基金份额净值增长率	30.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	133,974,130.13
期末可供分配基金份额利润	0.3206
期末基金资产净值	551,819,203.42
期末基金份额净值	1.321
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	32.10%

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

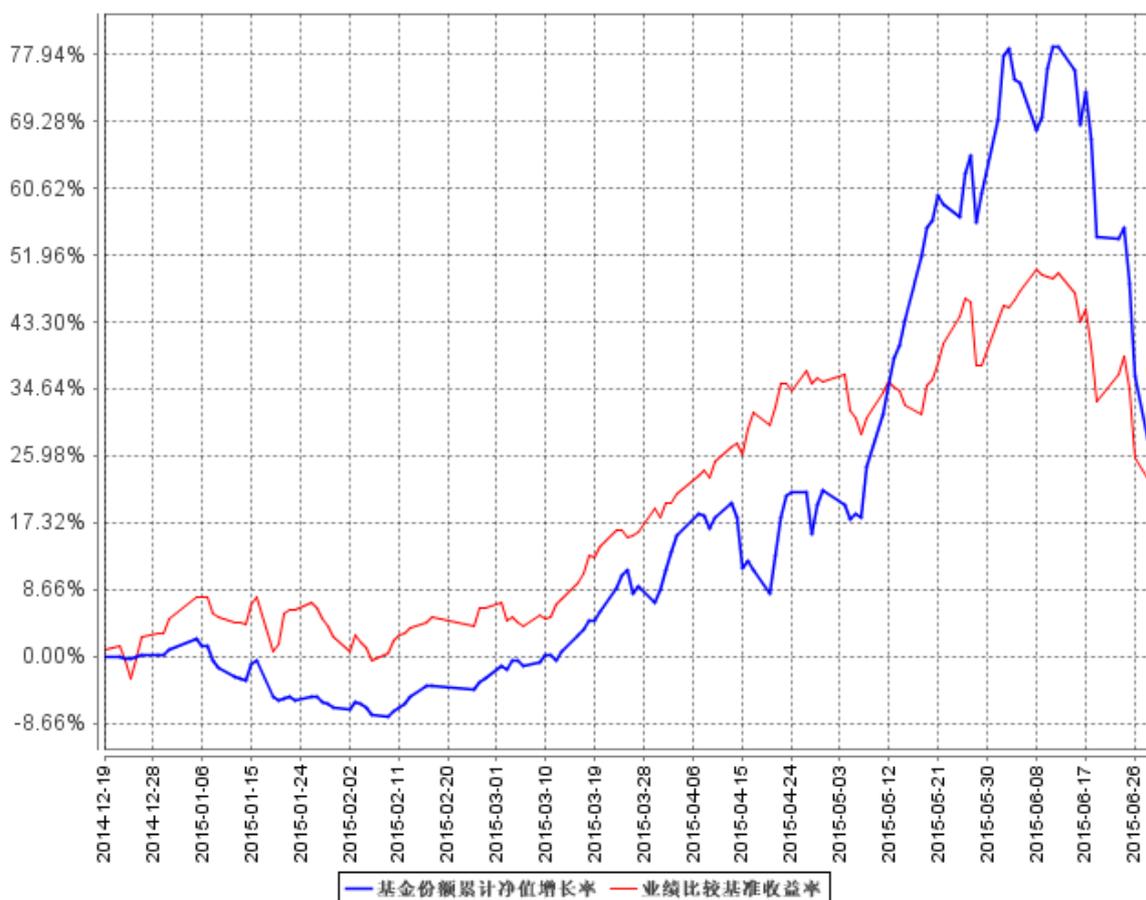
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-17.49%	4.16%	-6.29%	2.97%	-11.20%	1.19%
过去三个月	21.64%	3.35%	9.35%	2.22%	12.29%	1.13%
过去六个月	30.79%	2.55%	23.14%	1.92%	7.65%	0.63%
自基金合同生效起至今	32.10%	2.46%	29.15%	1.91%	2.95%	0.55%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率\*85%+中证国债指数收益率\*15%

### 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

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 2014 年 12 月 19 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2015年6月30日，公司共管理24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、民生加银精选股票型证券投资基金、民生加银稳健成长股票型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、民生加银景气行业股票型证券投资基金、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。

#### 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	民生加银品牌蓝筹混合、民生加银中证内地资源主题指数、民生加银城镇化混合、民生加银优选股票的基金经理	2014年12月19日	-	8年	工商管理硕士。自2007年起历任交银施罗德基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

2015 年上半年，A 股市场迎来了波澜起伏的大震荡。1-5 月份成长股一反去年 4 季度颓废走势高歌猛进，上证指数也一举突破 5000 点大关。6 月中旬开始市场则出现断崖式下跌。无论蓝筹股还是成长股均出现暴跌。直到七月初政府强力救市才开始逐步企稳。

本基金年初投资方向有所偏差，之后迅速调整方向，把握住了成长股投资机会，买入并持有优质成长个股，并取得较好的业绩回报。但在六月份则未能及时减仓，净值出现较大幅度回撤。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.321 元，本报告期内份额净值增长率为 30.79%，同期业绩比较基准收益率为 23.14%。

#### 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 2015 年下半年，我们认为市场在 6 月的股灾之后重新企稳，短期将有恢复式上涨，之后是震荡分化，尤其是新兴成长板块个股将出现较大分化。但是本轮牛市的基本逻辑即居民大类资产配置向权益类资产迁移并没有发生变化；转型创新宏观政策大背景也没有发生变化；同时国企改革也将拉开大幕。我们的投资方向将在继续选定与经济增长新趋势密切相关的互联网、医疗卫生、环保、新材料等行业的基础上，加大对受益于国企改革推进的个股的投资。

#### 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、金融工程小组、运营管理部、交易部、研究部、投资部、固定收益部、专户一部、专户二部、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。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

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

#### 4.8 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，平安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：民生加银优选股票型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	85,983,558.10	109,471,512.99
结算备付金		4,220,920.09	-
存出保证金		6,711,854.42	-
交易性金融资产	6.4.7.2	530,723,515.45	743,216,597.12
其中：股票投资		530,723,515.45	743,216,597.12
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	-	916,600,000.00
应收证券清算款		-	122,256,082.65
应收利息	6.4.7.5	27,249.44	707,291.30
应收股利		-	-
应收申购款		2,106,958.43	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		629,774,055.93	1,892,251,484.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>

<b>负 债:</b>			
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		-	34,102,393.06
应付赎回款		74,431,003.49	-
应付管理人报酬		1,053,743.44	906,298.71
应付托管费		175,623.88	151,049.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,954,432.62	649,345.08
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	340,049.08	-
负债合计		77,954,852.51	35,809,086.63
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	417,845,073.29	1,837,563,753.87
未分配利润	6.4.7.10	133,974,130.13	18,878,643.56
所有者权益合计		551,819,203.42	1,856,442,397.43
负债和所有者权益总计		629,774,055.93	1,892,251,484.06

注: 报告截止日 2015 年 6 月 30 日, 基金份额净值人民币 1.321 元, 基金份额总额 417,845,073.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 民生加银优选股票型证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		221,260,660.34	-
1.利息收入		4,010,650.05	-
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	1,072,841.68	-
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		2,937,808.37	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		297,821,711.10	-
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	296,940,954.02	-
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	880,757.08	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-88,920,298.01	-
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	8,348,597.20	-
<b>减：二、费用</b>		25,379,351.71	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,753,703.37	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,458,950.53	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,938,588.94	-
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	228,108.87	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		195,881,308.63	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		195,881,308.63	-

注：本基金合同于 2014 年 12 月 19 日生效，因此，无对比期间财务报表数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银优选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,837,563,753.87	18,878,643.56	1,856,442,397.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	195,881,308.63	195,881,308.63
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）	-1,419,718,680.58	-80,785,822.06	-1,500,504,502.64
其中：1.基金申购款	546,929,353.24	276,853,042.44	823,782,395.68



2014 年 12 月 19 日正式生效，首次设立募集规模为 1,837,563,753.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,065,880.04 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银优选股票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(含中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、中期票据、债券回购、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(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+中证国债指数收益率 $\times$ 15%。

#### 6.4.2 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。

#### 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于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 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及应用指南、《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。

### 6.4.4.1 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。

### 6.4.4.2 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。

### 6.4.4.3 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、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、货币市场工具和衍生工具等投资。

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

#### (2) 金融负债分类

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

### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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)”。

#### **6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 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。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红

利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，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) 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定；

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计需要披露。

### **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 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。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

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

#### **6.4.5.3 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和更正。

### **6.4.6 税项**

#### **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。

#### **2. 营业税、企业所得税**

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债

券的差价收入，免征营业税。

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。

### 3. 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

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。

## 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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	85,983,558.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	85,983,558.10

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	599,583,349.39	530,723,515.45	-68,859,833.94

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	599,583,349.39	530,723,515.45	-68,859,833.94

#### 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 2015年6月30日
应收活期存款利息	22,329.74
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	1,899.40
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	3,020.30
合计	27,249.44

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,954,432.62
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,954,432.62

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	111,940.21
预提费用	228,108.87
合计	340,049.08

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,837,563,753.87	1,837,563,753.87
本期申购	546,929,353.24	546,929,353.24
本期赎回(以“-”号填列)	-1,966,648,033.82	-1,966,648,033.82
- 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	417,845,073.29	417,845,073.29

注（1）申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于2014年12月19日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,836,497,873.83元，在募集期间产生的利息折份额金额1,065,880.04元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,837,563,753.87元，折合1,837,563,753.87份基金份额。

**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	-1,181,820.51	20,060,464.07	18,878,643.56
本期利润	284,801,606.64	-88,920,298.01	195,881,308.63
本期基金份额交易产生的变动数	-24,699,256.08	-56,086,565.98	-80,785,822.06
其中：基金申购款	174,691,633.73	102,161,408.71	276,853,042.44
基金赎回款	-199,390,889.81	-158,247,974.69	-357,638,864.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	258,920,530.05	-124,946,399.92	133,974,130.13

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	768,832.68
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	266,763.24
其他	37,245.76
合计	1,072,841.68

#### 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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	5,800,996,589.29
减：卖出股票成本总额	5,504,055,635.27
买卖股票差价收入	296,940,954.02

#### 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 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	880,757.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	880,757.08

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-88,920,298.01
——股票投资	-88,920,298.01
——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	-88,920,298.01

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	7,440,022.89
转换费收入	908,574.31
合计	8,348,597.20

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	14,938,588.94
银行间市场交易费用	-
合计	14,938,588.94

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	193,396.69
合计	228,108.87

#### 6.4.7.21 分部报告

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

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露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（“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、发起人
平安银行	基金托管人、基金销售机构

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。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于 2014 年 12 月 19 日生效，故无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 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。

**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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,753,703.37	-
其中：支付销售机构的客户维护费	2,849,439.22	-

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

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2015 年 6 月 30 日的应付基金管理费为人民币 1,053,743.44 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 906,298.71 元）。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,458,950.53	-

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2015 年 6 月 30 日的应付基金托管费为人民币为 175,623.88 元（2014 年 12 月 31 日：人

民币为 151,049.78 元。

### 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

本基金于本期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

本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
平安银行	85,983,558.10	768,832.68	-	-

注：本基金本期的活期银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期无需要说明的其他关联交易事项。

### 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

本基金于本期未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2015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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 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	期末估值单	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
------	------	------	----	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

			原因	价						
000066	长城 电脑	2015 年6月 18日	重大 事项	16.84	-	-	2,276,146	46,775,381.95	38,330,298.64	-
300431	暴风 科技	2015 年6月 11日	重大 事项	211.45	2015 年7月 13日	276.80	130,253	27,890,643.04	27,541,996.85	-
300353	东土 科技	2015 年6月 3日	重大 事项	57.79	-	-	257,302	17,456,375.55	14,869,482.58	-
000630	铜陵 有色	2015 年3月 9日	重大 事项	10.32	-	-	1,218,130	8,880,322.39	12,571,101.60	-
300419	浩丰 科技	2015 年4月 24日	重大 事项	228.44	2015 年8月 14日	216.41	47,946	8,023,627.00	10,952,784.24	-
600806	昆明 机床	2015 年3月 3日	重大 事项	11.96	-	-	885,565	6,673,210.08	10,591,357.40	-
600335	国机 汽车	2015 年6月 15日	重大 事项	27.62	2015 年7月 21日	34.14	321,100	12,141,479.00	8,868,782.00	-
002739	万达 院线	2015 年5月 14日	重大 事项	221.86	2015 年7月 3日	219.68	500	10,675.00	110,930.00	-
300427	红相 电力	2015 年6月 30日	重大 事项	64.64	-	-	500	5,230.00	32,320.00	-

### 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

截至本报告期末 2015 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 2015 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。

### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

于 2015 年 6 月 30 日及 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。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发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过相关部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除批注 6.4.12.2 中所示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	85,983,558.10	-	-	-	-	-	85,983,558.10

结算备付金	4,220,920.09	-	-	-	-	-	4,220,920.09
存出保证金	6,711,854.42	-	-	-	-	-	6,711,854.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	530,723,515.45	530,723,515.45
应收利息	-	-	-	-	-	27,249.44	27,249.44
应收申购款	-	-	-	-	-	2,106,958.43	2,106,958.43
资产总计	96,916,332.61	-	-	-	-	532,857,723.32	629,774,055.93
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	74,431,003.49	74,431,003.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,053,743.44	1,053,743.44
应付托管费	-	-	-	-	-	175,623.88	175,623.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,954,432.62	1,954,432.62
其他负债	-	-	-	-	-	340,049.08	340,049.08
负债总计	-	-	-	-	-	77,954,852.51	77,954,852.51
利率敏感度缺口	96,916,332.61	-	-	-	-	-454,902,870.81	551,819,203.42
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	109,471,512.99	-	-	-	-	-	109,471,512.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	743,216,597.12	743,216,597.12
买入返售金融资产	916,600,000.00	-	-	-	-	-	916,600,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	122,256,082.65	122,256,082.65
应收利息	-	-	-	-	-	707,291.30	707,291.30
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,026,071,512.99	-	-	-	-	866,179,971.07	1,892,251,484.06
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	34,102,393.06	34,102,393.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	906,298.71	906,298.71
应付托管费	-	-	-	-	-	151,049.78	151,049.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	649,345.08	649,345.08
负债总计	-	-	-	-	-	35,809,086.63	35,809,086.63
利率敏感度缺口	1,026,071,512.99	-	-	-	-	-830,370,884.44	1,856,442,397.43

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日及 2014 年 12 月 31 日，本基金均未持有交易性债券投资，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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。

##### 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 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	530,723,515.45	96.18	743,216,597.12	40.03
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	530,723,515.45	96.18	743,216,597.12	40.03

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	24,001,738.88	-
业绩比较基准下降5%	-24,001,738.88	-	

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×85%+中证国债指数收益率×15%

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 其他事项

##### (1) 公允价值

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

##### 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 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 406,854,462.14 元，划分为第二层次的余额为人民币 123,869,053.31 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(包括涨跌停时的交易不活跃)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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 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	530,723,515.45	84.27
	其中：股票	530,723,515.45	84.27
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	90,204,478.19	14.32
7	其他各项资产	8,846,062.29	1.40
8	合计	629,774,055.93	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,538,910.34	2.27
C	制造业	238,387,485.13	43.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	235,260.00	0.04
E	建筑业	4,428,880.00	0.80
F	批发和零售业	8,868,782.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	148,977,219.85	27.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,790,781.80	15.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,507,998.86	1.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,877,267.47	5.05
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	110,930.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	530,723,515.45	96.18

## 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	300131	英唐智控	1,796,764	51,135,903.44	9.27

2	300240	飞力达	2,103,759	40,644,623.88	7.37
3	000066	长城电脑	2,276,146	38,330,298.64	6.95
4	600787	中储股份	2,302,900	37,076,690.00	6.72
5	000099	中信海直	1,675,901	29,797,519.78	5.40
6	300379	东方通	351,883	28,280,836.71	5.13
7	300404	博济医药	268,593	27,877,267.47	5.05
8	300431	暴风科技	130,253	27,541,996.85	4.99
9	002747	埃斯顿	419,639	27,180,018.03	4.93
10	300286	安科瑞	900,196	26,906,858.44	4.88
11	300013	新宁物流	1,034,909	26,814,492.19	4.86
12	300353	东土科技	257,302	14,869,482.58	2.69
13	600741	华域汽车	638,800	13,638,380.00	2.47
14	000630	铜陵有色	1,218,130	12,571,101.60	2.28
15	300419	浩丰科技	47,946	10,952,784.24	1.98
16	600806	昆明机床	885,565	10,591,357.40	1.92
17	300452	山河药辅	103,800	9,103,260.00	1.65
18	600268	国电南自	613,100	8,994,177.00	1.63
19	002756	永兴特钢	167,350	8,884,611.50	1.61
20	600335	国机汽车	321,100	8,868,782.00	1.61
21	601006	大秦铁路	535,000	7,511,400.00	1.36
22	601333	广深铁路	867,700	7,132,494.00	1.29
23	601088	中国神华	330,700	6,895,095.00	1.25
24	300217	东方电热	445,100	6,783,324.00	1.23
25	300182	捷成股份	113,200	5,829,800.00	1.06
26	601898	中煤能源	490,600	5,602,652.00	1.02
27	300333	兆日科技	51,970	5,602,366.00	1.02
28	300451	创业软件	29,100	5,528,418.00	1.00
29	002113	天润控股	200,802	5,507,998.86	1.00
30	600986	科达股份	184,000	4,428,880.00	0.80
31	300086	康芝药业	153,288	4,138,776.00	0.75
32	002751	易尚展示	31,500	3,740,310.00	0.68
33	300442	普丽盛	17,500	1,161,825.00	0.21
34	601985	中国核电	18,000	235,260.00	0.04
35	002739	万达院线	500	110,930.00	0.02
36	300456	耐威科技	500	57,220.00	0.01
37	600959	江苏有线	2,000	54,580.00	0.01
38	603969	银龙股份	2,000	40,880.00	0.01
39	002096	南岭民爆	1,000	32,900.00	0.01
40	300427	红相电力	500	32,320.00	0.01

41	603618	杭电股份	1,000	31,940.00	0.01
42	601689	拓普集团	1,000	25,180.00	0.00
43	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00
44	002745	木林森	500	21,370.00	0.00
45	300477	合纵科技	500	19,785.00	0.00
46	002748	世龙实业	500	18,030.00	0.00
47	603566	普莱柯	390	17,491.50	0.00
48	002766	索菱股份	500	17,005.00	0.00
49	002752	昇兴股份	500	16,720.00	0.00
50	601069	西部黄金	893	16,413.34	0.00
51	601968	宝钢包装	1,000	13,950.00	0.00
52	300481	濮阳惠成	500	6,575.00	0.00
53	300486	东杰智能	500	6,435.00	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	601600	中国铝业	131,828,101.33	7.10
2	601088	中国神华	126,185,580.45	6.80
3	600028	中国石化	111,122,019.29	5.99
4	601398	工商银行	108,149,323.56	5.83
5	600000	浦发银行	103,945,968.57	5.60
6	600030	中信证券	92,788,310.42	5.00
7	601857	中国石油	91,525,627.84	4.93
8	600048	保利地产	88,373,252.32	4.76
9	601688	华泰证券	71,871,250.03	3.87
10	601328	交通银行	70,401,629.76	3.79
11	601166	兴业银行	68,608,151.97	3.70
12	000100	TCL 集团	64,767,756.40	3.49
13	601939	建设银行	63,348,627.85	3.41
14	601628	中国人寿	62,265,655.02	3.35
15	601186	中国铁建	62,022,330.44	3.34
16	600015	华夏银行	61,546,398.57	3.32
17	601668	中国建筑	59,337,956.89	3.20

18	600887	伊利股份	55,973,892.00	3.02
19	000651	格力电器	53,455,483.06	2.88
20	000023	深天地A	53,160,596.45	2.86
21	601988	中国银行	52,426,377.08	2.82
22	000099	中信海直	51,575,139.10	2.78
23	601169	北京银行	51,337,416.28	2.77
24	600739	辽宁成大	47,615,151.94	2.56
25	002432	九安医疗	47,366,888.26	2.55
26	000895	双汇发展	46,945,780.47	2.53
27	000066	长城电脑	46,775,381.95	2.52
28	300131	英唐智控	45,092,229.40	2.43
29	600050	中国联通	44,562,686.70	2.40
30	601288	农业银行	44,554,655.00	2.40
31	000063	中兴通讯	44,543,522.45	2.40
32	002747	埃斯顿	43,827,826.12	2.36
33	300086	康芝药业	42,433,636.68	2.29
34	600010	包钢股份	41,974,151.96	2.26
35	601788	光大证券	41,465,274.16	2.23
36	300286	安科瑞	40,871,046.90	2.20
37	300013	新宁物流	40,163,663.13	2.16
38	600787	中储股份	39,425,210.70	2.12
39	600418	江淮汽车	39,419,153.19	2.12
40	300243	瑞丰高材	39,189,434.96	2.11
41	300240	飞力达	38,996,792.86	2.10
42	300016	北陆药业	38,271,266.90	2.06
43	000693	华泽钴镍	37,142,241.35	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。

#### 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	601857	中国石油	133,368,591.78	7.18
2	600028	中国石化	128,327,580.59	6.91
3	601600	中国铝业	125,200,782.40	6.74

4	600000	浦发银行	125,185,601.21	6.74
5	601088	中国神华	123,698,052.28	6.66
6	601328	交通银行	121,385,645.39	6.54
7	601988	中国银行	112,728,113.22	6.07
8	601688	华泰证券	110,547,934.15	5.95
9	600030	中信证券	106,867,494.65	5.76
10	601398	工商银行	106,181,439.17	5.72
11	300248	新开普	95,384,052.19	5.14
12	601166	兴业银行	94,254,600.46	5.08
13	601628	中国人寿	94,250,381.24	5.08
14	601939	建设银行	86,628,317.76	4.67
15	601668	中国建筑	86,126,404.74	4.64
16	600048	保利地产	84,087,010.70	4.53
17	601288	农业银行	81,644,665.36	4.40
18	600015	华夏银行	80,970,674.61	4.36
19	600358	国旅联合	73,483,794.27	3.96
20	601818	光大银行	69,492,732.69	3.74
21	000100	TCL 集团	63,850,434.88	3.44
22	000023	深天地A	63,557,397.76	3.42
23	601998	中信银行	59,745,052.00	3.22
24	601186	中国铁建	59,441,512.13	3.20
25	601169	北京银行	54,732,188.33	2.95
26	002432	九安医疗	51,839,380.03	2.79
27	600887	伊利股份	51,540,947.53	2.78
28	000651	格力电器	51,376,371.63	2.77
29	600036	招商银行	50,278,588.12	2.71
30	000402	金融街	49,906,791.61	2.69
31	300243	瑞丰高材	49,738,685.39	2.68
32	000503	海虹控股	49,232,177.68	2.65
33	300086	康芝药业	47,333,816.57	2.55
34	600739	辽宁成大	47,203,168.76	2.54
35	600661	新南洋	46,949,070.97	2.53
36	600010	包钢股份	46,368,321.55	2.50
37	000895	双汇发展	45,330,863.60	2.44
38	000693	华泽钴镍	44,654,772.76	2.41
39	600050	中国联通	43,875,867.66	2.36
40	000063	中兴通讯	43,552,011.37	2.35
41	300130	新国都	43,434,890.39	2.34

42	601800	中国交建	43,294,036.42	2.33
43	600320	振华重工	42,121,956.16	2.27
44	300028	金亚科技	40,784,543.95	2.20
45	600961	株冶集团	39,799,737.53	2.14
46	300016	北陆药业	39,634,803.67	2.13
47	300166	东方国信	38,889,141.11	2.09
48	600418	江淮汽车	38,737,301.05	2.09

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	5,380,482,851.61
卖出股票收入（成交）总额	5,800,996,589.29

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。

### 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	6,711,854.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,249.44
5	应收申购款	2,106,958.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,846,062.29

#### 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	000066	长城电脑	38,330,298.64	6.95	重大事项
2	300431	暴风科技	27,541,996.85	4.99	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
18,516	22,566.70	1,433,086.89	0.34%	416,411,986.40	99.66%

**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	1,320,927.27	0.3161%

**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	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年12月19日）基金份额总额	1,837,563,753.87
本报告期期初基金份额总额	1,837,563,753.87
本报告期基金总申购份额	546,929,353.24
减：本报告期基金总赎回份额	1,966,648,033.82
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	417,845,073.29

## § 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

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

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

2015年6月18日，本基金管理人发布公告，解聘吴剑飞先生副总经理职务。

### 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	
广发证券股份有限公司	2	3,993,729,828.31	35.73%	2,797,304.14	35.77%	-
中信证券股份有限公司	2	3,306,629,298.75	29.58%	2,335,826.34	29.87%	-
光大证券股份有限公司	2	1,053,989,370.76	9.43%	721,878.32	9.23%	-
方正证券股份有限公司	2	1,034,963,511.10	9.26%	713,020.87	9.12%	-
国金证券股份有限公司	1	918,524,276.89	8.22%	652,514.95	8.34%	-
招商证券股份有限公司	2	732,008,082.29	6.55%	501,354.07	6.41%	-
海通证券股份有限公司	1	139,110,253.54	1.24%	98,823.46	1.26%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	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
广发证券股份有限公司	-	-	5,679,000,000.00	27.06%	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	6,305,000,000.00	30.05%	-	-

光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-3,461,000,000.00	16.49%	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-5,540,000,000.00	26.40%	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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本基金合同于 2014 年 12 月 19 日生效，根据心上标准，分别选择了广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司的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 2014 年 12 月 31 日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
2	民生加银优选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 15 日
3	民生加银基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上直销申购费率优惠期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 16 日
4	民生加银基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 23 日
5	民生加银基金管理有限公司关于资产支持证券投资方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 30 日
6	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加英大证	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 2 月 3 日

	券有限责任公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	券日报、公司网站	
7	民生加银优选股票证券投资基金参与部分销售机构基金定期定额申购费率优惠活动或网上交易等电子渠道申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 3 日
8	民生加银优选股票型证券投资基金开放基金转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 5 日
9	民生加银基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 7 日
10	民生加银基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 17 日
11	民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 2 月 27 日
12	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“大北农”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 6 日
13	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“华泽钴镍”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 24 日
14	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2015 年 3 月 25 日

	旗下基金持有的股票“海虹控股”停牌后估值方法变更的提示性公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站	
15	民生加银基金管理有限公司关于旗下证券投资基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 3 月 31 日
16	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“新国都”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 2 日
17	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“铜陵有色”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 3 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日发资产管理(上海)有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 8 日
19	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“昆明机床”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 14 日
20	民生加银优选股票型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 21 日
21	民生加银基金管理有限公司关于开展直销网上交易系统基金转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 4 月 23 日

22	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“新开普”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年4月30日
23	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“飞力达”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年5月6日
24	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“浩丰科技”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年5月12日
25	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“长百集团”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年5月14日
26	关于公司网站进行系统维护及网上直销、网上查询和网上交易系统暂停服务的公告	公司网站	2015年5月15日
27	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“万达院线”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年6月15日
28	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“暴风科技”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015年6月17日
29	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“英唐智	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015年6月17日

	控”停牌后估值方法变更的提示性公告	券日报、公司网站	
30	民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 6 月 18 日
31	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“国机汽车”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 6 月 19 日
32	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票“长城电脑”停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 6 月 23 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

- 9.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 9.1.2 《民生加银优选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 9.1.3 《民生加银优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 9.1.4 《民生加银优选股票型证券投资基金托管协议》；
- 9.1.5 法律意见书；
- 9.1.6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。
- 9.1.7 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、基金托管人的住所或基金管理人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  
2015 年 8 月 25 日