

民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	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

§8 基金份额持有人信息	43
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
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	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	民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银策略精选混合
基金主代码	000136
交易代码	000136
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 7 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	345,740,370.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	争取实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金基于宏观经济政策和资本市场长期发展趋势对大类资产进行灵活配置，采用定量与定性分析相结合的方法确定本基金的资产配置。在行业配置策略上，我们结合经济周期的波动规律、行业景气度以及行业估值水平紧密监测行业之间的轮动，动态调整行业配置比例。在股票投资方面，本基金运用主题、选股等多种策略，并深度挖掘具有估值优势和成长价值型的个股构建基金股票投资组合。在债券投资方面，结合经济周期、宏观经济政策、资金供求分析、货币政策、财政政策来对债券的收益率进行研判，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债国债总指数收益率（全价）×40%
风险收益特征	本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，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	深圳市福田区益田路西、福 中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区益田路西、福 中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518026	100033
法定代表人	万青元	王洪章

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区益田路新世界商务中 心 42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-26,747,656.73
本期利润	-19,154,711.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0595
本期加权平均净值利润率	-2.69%
本期基金份额净值增长率	-6.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	296,824,562.84
期末可供分配基金份额利润	0.8585
期末基金资产净值	829,016,732.36
期末基金份额净值	2.398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	139.80%

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

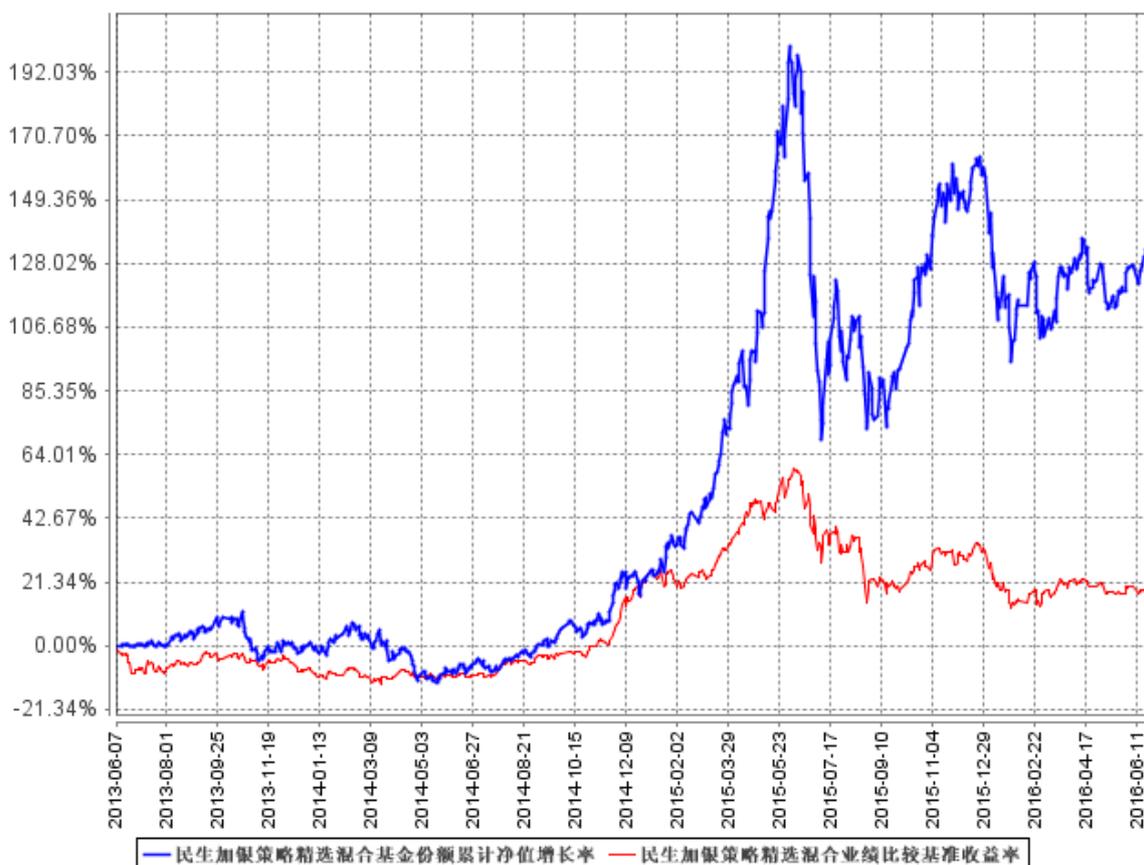
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.77%	1.00%	-0.19%	0.61%	6.96%	0.39%
过去三个月	5.69%	1.35%	-1.62%	0.61%	7.31%	0.74%
过去六个月	-6.66%	2.13%	-9.21%	1.11%	2.55%	1.02%
过去一年	7.29%	2.50%	-16.58%	1.38%	23.87%	1.12%
过去三年	139.32%	1.97%	30.11%	1.10%	109.21%	0.87%
自基金合同生效起至今	139.80%	1.95%	19.54%	1.11%	120.26%	0.84%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中债国债总指数收益率（全价）×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

民生加银策略精选混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2013 年 6 月 7 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 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 29 只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	民生加银红利回报混合、民生加银策略精选混合的基金经理	2014年7月7日	-	5年	北京大学工商管理硕士。曾任国信证券股份有限公司经济研究所分析师。2012年2月加入民生加银基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理。
宋磊	民生加银红利回报混合、民生加银积极成长发起式、民生加银策略精选混合、民生加银研究精选混合的基金经理；研究部总监	2014年10月22日	-	18年	化学工程学硕士。曾任大鹏证券公司研究部研究员，申银万国证券公司研究发展部研究员，华安基金公司研究部、投资部研究总监、基金经理，华宸未来基金公司投资部投资副总监。自2014年5月加盟民生加银基金管理有限公司，任研究部总监。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在上半年运作过程中，紧密跟踪产业与政策变化趋势，结合市场流动性的变化特征，做好以下两个方面的工作：一是专注于具有长期成长潜力的战略性行业，充分挖掘其中的优秀成长性公司；二是坚持价值投资的理念，通过产业链分析、业绩与估值评测等手段把握投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 2.398 元, 本报告期内份额净值增长率为-6.66%, 同期业绩比较基准收益率为-9.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

始终坚持独立思考、精选个股、优化配置的投资理念。对未来市场, 我们认为机会主要是结构性的, 主要体现在三方面的机会:

1) 创新

例如新能源汽车、智能驾驶、云计算、高端装备制造等领域。

2) 新消费

例如文化传媒、教育、医疗、物流、旅游等。

3) 低估值偏稳健的行业

例如医药、食品饮料等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定, 本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。其中, 本基金管理人为了确保估值工作的合规开展, 建立了负责估值工作决策和执行的专门机构, 组成人员包括分管运营的公司领导、督察长、投资总监、运营管理部、交易部、研究部、投资部、固定收益部、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究部参加人员应包含金融工程小组及相关行业研究员。分管运营的公司领导任估值小组组长。且基金经理不参与其管理基金的相关估值业务。本报告期内, 参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	230,688,464.32	149,794,019.85
结算备付金		2,204,205.42	3,746,346.06
存出保证金		614,466.25	704,579.91
交易性金融资产	6.4.7.2	581,220,508.92	457,047,972.04
其中：股票投资		527,200,508.92	421,966,372.04
基金投资		-	-
债券投资		54,020,000.00	35,081,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		25,379,310.40	22,213,282.24
应收利息	6.4.7.5	1,476,316.85	1,892,268.75
应收股利		-	-
应收申购款		1,295,069.14	2,848,435.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		842,878,341.30	638,246,904.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	22,789,197.57
应付赎回款		10,266,769.67	6,074,132.86
应付管理人报酬		975,871.25	772,765.59
应付托管费		162,645.21	128,794.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,296,855.43	3,408,529.53
应交税费		40,000.00	40,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,467.38	267,493.66
负债合计		13,861,608.94	33,480,913.49
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	345,740,370.58	235,386,927.75
未分配利润	6.4.7.10	483,276,361.78	369,379,062.92
所有者权益合计		829,016,732.36	604,765,990.67
负债和所有者权益总计		842,878,341.30	638,246,904.16

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.398 元，基金份额总额 345,740,370.58 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银策略精选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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-6,133,476.66	38,684,083.37
1.利息收入		1,893,422.86	247,176.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	703,502.86	76,723.79

债券利息收入		1,189,920.00	170,452.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,089,842.74	66,546,493.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-17,752,627.54	66,267,348.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	396.04
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	1,662,784.80	278,749.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,592,945.08	-28,789,595.23
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	469,998.14	680,008.20
减：二、费用		13,021,234.99	5,084,170.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,273,663.09	1,318,927.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	878,943.85	219,821.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,783,926.11	3,469,427.66
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	84,701.94	75,993.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,154,711.65	33,599,912.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,154,711.65	33,599,912.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银策略精选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6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	235,386,927.75	369,379,062.92	604,765,990.67
二、本期经营活动产生	-	-19,154,711.65	-19,154,711.65

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	110,353,442.83	133,052,010.51	243,405,453.34
其中：1.基金申购款	253,066,439.59	306,832,747.15	559,899,186.74
2.基金赎回款	-142,712,996.76	-173,780,736.64	-316,493,733.40
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）	345,740,370.58	483,276,361.78	829,016,732.36
项目	上年度可比期间 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）	42,234,980.22	9,744,583.44	51,979,563.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,599,912.71	33,599,912.71
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）	85,001,327.12	113,854,610.72	198,855,937.84
其中：1.基金申购款	295,416,657.35	377,968,887.99	673,385,545.34
2.基金赎回款	-210,415,330.23	-264,114,277.27	-474,529,607.50
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）	127,236,307.34	157,199,106.87	284,435,414.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吴剑飞

基金管理人负责人

周吉人

主管会计工作负责人

洪锐珠

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银策略精选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[2012]1687号《关于核准民生加银策略精选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募集,基金合同于2013年6月7日正式生效,首次设立募集规模为414,799,211.05份基金份额,其中认购资金利息折合125,563.10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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

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、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、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、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的5%-100%。其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 60%+中债国债总指数收益率(全价) \times 40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期末未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期末未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期末未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 主要税项说明

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

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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

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

缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

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

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	230,688,464.32
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	230,688,464.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	478,749,837.99	527,200,508.92	48,450,670.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	54,020,000.00	-585,410.52
	银行间市场	-	-
	合计	54,020,000.00	-585,410.52
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	533,355,248.51	581,220,508.92	47,865,260.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	43,048.45
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	991.90
应收债券利息	1,432,000.00
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	276.50
合计	1,476,316.85

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,296,855.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,296,855.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	44,878.32
预提审计费用	24,863.02
预提信息披露费	49,726.04
合计	119,467.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,386,927.75	235,386,927.75
本期申购	253,066,439.59	253,066,439.59
本期赎回(以“-”号填列)	-142,712,996.76	-142,712,996.76
- 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	345,740,370.58	345,740,370.58

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	229,650,319.51	139,728,743.41	369,379,062.92
本期利润	-26,747,656.73	7,592,945.08	-19,154,711.65
本期基金份额交易产生的变动数	93,921,900.06	39,130,110.45	133,052,010.51
其中：基金申购款	213,528,893.30	93,303,853.85	306,832,747.15
基金赎回款	-119,606,993.24	-54,173,743.40	-173,780,736.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	296,824,562.84	186,451,798.94	483,276,361.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,365.68
其他	5,065.36
合计	703,502.86

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	2,284,611,419.38
减：卖出股票成本总额	2,302,364,046.92
买卖股票差价收入	-17,752,627.54

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工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,662,784.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,662,784.80

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	7,592,945.08
——股票投资	8,310,927.98
——债券投资	-717,982.90
——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	7,592,945.08
----	--------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	428,258.15
转换费收入	41,739.99
合计	469,998.14

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	6,783,926.11
银行间市场交易费用	-
合计	6,783,926.11

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	49,726.04
银行费用	10,112.88
合计	84,701.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司(“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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本年度及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

6.4.10.1.1 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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,273,663.09	1,318,927.75
其中：支付销售机构的客户维护费	893,423.89	236,889.52

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	878,943.85	219,821.31

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日（2013年6月7日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,697,435.90	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,697,435.90	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.65%	-

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	230,688,464.32	670,071.82	106,058,367.15	65,079.86

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2016年6月30日的相关余额为人民币2,204,205.42元。（2015年12月31日：人民币3,746,346.06元）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

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
601599	鹿港文化	2016年4月11日	重大事项	10.94	2016年7月6日	10.21	3,720,000	36,909,147.67	40,696,800.00	-
002065	东华软件	2015年12月21日	重大事项	18.72	2016年7月4日	22.59	800,000	18,878,415.33	14,976,000.00	-
002567	唐人神	2016年5月16日	重大事项	13.98	2016年7月29日	13.23	700,017	9,351,690.40	9,786,237.66	-

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 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

于 2016 年 6 月 30 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例分别为 6.52%和 5.80%。因此，本基金无重大的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统

性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 13 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有人的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	230,688,464.32	-	-	-	-	-	-230,688,464.32
结算备付金	2,204,205.42	-	-	-	-	-	2,204,205.42
存出保证金	614,466.25	-	-	-	-	-	614,466.25
交易性金融资产	-	-	-	54,020,000.00	-	527,200,508.92	581,220,508.92
应收证券清算款	-	-	-	-	-	25,379,310.40	25,379,310.40
应收利息	-	-	-	-	-	1,476,316.85	1,476,316.85
应收申购款	-	-	-	-	-	1,295,069.14	1,295,069.14
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	233,507,135.99	-	-	54,020,000.00	-	555,351,205.31	842,878,341.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,266,769.67	10,266,769.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	975,871.25	975,871.25
应付托管费	-	-	-	-	-	162,645.21	162,645.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,296,855.43	2,296,855.43
应交税费	-	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
其他负债	-	-	-	-	-	119,467.38	119,467.38
负债总计	-	-	-	-	-	13,861,608.94	13,861,608.94
利率敏感度缺口	233,507,135.99	-	-	54,020,000.00	-	541,489,596.37	829,016,732.36
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	149,794,019.85	-	-	-	-	-	-149,794,019.85
结算备付金	3,746,346.06	-	-	-	-	-	3,746,346.06
存出保证金	704,579.91	-	-	-	-	-	704,579.91
交易性金融资产	-	-	-	35,081,600.00	-	421,966,372.04	457,047,972.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,213,282.24	22,213,282.24
应收利息	-	-	-	-	-	1,892,268.75	1,892,268.75
应收申购款	-	-	-	-	-	2,848,435.31	2,848,435.31
资产总计	154,244,945.82	-	-	35,081,600.00	-	448,920,358.34	638,246,904.16
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,789,197.57	22,789,197.57
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,074,132.86	6,074,132.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	772,765.59	772,765.59
应付托管费	-	-	-	-	-	128,794.28	128,794.28

应付交易费用	-	-	-	-	3,408,529.53	3,408,529.53
应交税费	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
其他负债	-	-	-	-	267,493.66	267,493.66
负债总计	-	-	-	-	33,480,913.49	33,480,913.49
利率敏感度缺口	154,244,945.82	-	-35,081,600.00	-	-415,439,444.85	604,765,990.67

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.52% (2015 年 12 月 31 日：5.8%)，因此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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	527,200,508.92	63.59	421,966,372.04	69.77
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	527,200,508.92	63.59	421,966,372.04	69.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1、本基金业绩比较基准上涨5%	70,259,014.06	40,258,486.55
	2、本基金业绩比较基准下降5%	-70,259,014.06	-40,258,486.55

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

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

各层次金融工具公允价值

于2016年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币461,741,471.26元，划分为第二层次的余额为人民币119,479,037.66元，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(b) 第二层次的公允价值计量

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

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	527,200,508.92	62.55
	其中：股票	527,200,508.92	62.55
2	固定收益投资	54,020,000.00	6.41
	其中：债券	54,020,000.00	6.41
	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	232,892,669.74	27.63
7	其他各项资产	28,765,162.64	3.41
8	合计	842,878,341.30	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	175,951,363.91	21.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,305,000.00	4.74
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,543,141.30	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,675,452.10	11.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,211,725.50	1.71
M	科学研究和技术服务业	39,960,000.00	4.82
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	29,224,292.24	3.53
R	文化、体育和娱乐业	80,327,643.87	9.69
S	综合	36,001,890.00	4.34
	合计	527,200,508.92	63.59

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	601599	鹿港文化	3,720,000	40,696,800.00	4.91
2	300008	天海防务	1,200,000	39,960,000.00	4.82
3	002479	富春环保	3,500,000	39,305,000.00	4.74
4	000034	神州数码	1,600,084	36,001,890.00	4.34

5	300336	新文化	1,300,012	32,474,299.76	3.92
6	300002	神州泰岳	3,000,000	31,920,000.00	3.85
7	600551	时代出版	1,500,065	29,941,297.40	3.61
8	300015	爱尔眼科	800,008	29,224,292.24	3.53
9	000423	东阿阿胶	500,057	26,418,011.31	3.19
10	002405	四维图新	1,030,057	25,339,402.20	3.06
11	300033	同花顺	300,062	24,440,049.90	2.95
12	601028	玉龙股份	3,000,017	21,420,121.38	2.58
13	002329	皇氏集团	1,200,000	17,988,000.00	2.17
14	300202	聚龙股份	700,000	16,947,000.00	2.04
15	001696	宗申动力	1,500,000	16,380,000.00	1.98
16	600730	中国高科	1,100,010	15,543,141.30	1.87
17	002065	东华软件	800,000	14,976,000.00	1.81
18	600519	贵州茅台	50,048	14,610,012.16	1.76
19	002707	众信旅游	700,085	14,211,725.50	1.71
20	300133	华策影视	800,003	12,456,046.71	1.50
21	002551	尚荣医疗	500,030	11,690,701.40	1.41
22	002567	唐人神	700,017	9,786,237.66	1.18
23	300426	唐德影视	80,000	5,456,000.00	0.66
24	601313	江南嘉捷	1,000	14,480.00	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	600730	中国高科	71,684,313.59	11.85
2	300133	华策影视	66,075,192.49	10.93
3	300336	新文化	62,389,888.56	10.32
4	002551	尚荣医疗	52,867,773.21	8.74
5	300202	聚龙股份	52,191,644.94	8.63
6	600551	时代出版	52,105,691.63	8.62
7	300383	光环新网	47,584,977.34	7.87
8	300263	隆华节能	47,488,635.60	7.85
9	300033	同花顺	46,599,187.09	7.71
10	300002	神州泰岳	45,036,435.28	7.45

11	002479	富春环保	36,791,106.16	6.08
12	002425	凯撒股份	35,765,494.26	5.91
13	002094	青岛金王	34,838,919.60	5.76
14	002468	艾迪西	34,203,618.76	5.66
15	300166	东方国信	30,403,962.09	5.03
16	000034	神州数码	29,710,104.49	4.91
17	300027	华谊兄弟	29,227,538.61	4.83
18	601777	力帆股份	29,194,794.94	4.83
19	300496	中科创达	28,980,160.27	4.79
20	601028	玉龙股份	27,635,981.21	4.57
21	600485	信威集团	27,353,072.49	4.52
22	300075	数字政通	26,351,984.92	4.36
23	002707	众信旅游	25,717,920.35	4.25
24	300271	华宇软件	25,082,469.13	4.15
25	000423	东阿阿胶	24,838,148.96	4.11
26	300098	高新兴	24,269,402.30	4.01
27	600266	北京城建	23,603,618.67	3.90
28	300015	爱尔眼科	23,284,682.98	3.85
29	002405	四维图新	23,190,809.18	3.83
30	000530	大冷股份	23,162,473.63	3.83
31	002108	沧州明珠	22,974,393.50	3.80
32	600386	北巴传媒	22,775,145.40	3.77
33	000670	*ST 盈方	21,721,146.10	3.59
34	300113	顺网科技	21,577,922.58	3.57
35	002396	星网锐捷	21,444,110.58	3.55
36	601599	鹿港文化	21,383,108.19	3.54
37	603686	龙马环卫	21,271,997.64	3.52
38	600115	东方航空	21,196,411.28	3.50
39	300014	亿纬锂能	20,634,527.95	3.41
40	300310	宜通世纪	20,075,333.10	3.32
41	300021	大禹节水	19,991,758.36	3.31
42	002667	鞍重股份	18,525,824.90	3.06
43	300467	迅游科技	18,295,273.73	3.03
44	002153	石基信息	18,005,576.15	2.98
45	600699	均胜电子	17,605,533.18	2.91
46	600075	新疆天业	17,325,194.45	2.86

47	300367	东方网力	17,315,626.45	2.86
48	600525	长园集团	17,189,360.00	2.84
49	002329	皇氏集团	16,993,300.60	2.81
50	002739	万达院线	16,922,345.98	2.80
51	002458	益生股份	16,860,849.74	2.79
52	600661	新南洋	16,638,173.25	2.75
53	002537	海立美达	16,117,415.41	2.67
54	600731	湖南海利	16,109,717.54	2.66
55	300008	天海防务	15,936,417.52	2.64
56	001696	宗申动力	15,809,680.58	2.61
57	000860	顺鑫农业	15,728,843.42	2.60
58	002007	华兰生物	15,331,158.83	2.54
59	300022	吉峰农机	15,226,588.35	2.52
60	002019	亿帆鑫富	15,215,943.00	2.52
61	002085	万丰奥威	15,112,725.48	2.50
62	000089	深圳机场	15,104,555.00	2.50
63	002366	台海核电	15,067,326.12	2.49
64	000021	深科技	14,849,784.82	2.46
65	002009	天奇股份	14,686,063.12	2.43
66	000607	华媒控股	14,519,639.67	2.40
67	002638	勤上光电	14,376,514.98	2.38
68	600029	南方航空	14,310,015.76	2.37
69	000671	阳光城	14,218,470.03	2.35
70	000606	*ST 易桥	14,208,663.50	2.35
71	000802	北京文化	13,891,651.23	2.30
72	002462	嘉事堂	13,839,202.64	2.29
73	600519	贵州茅台	13,813,675.97	2.28
74	600037	歌华有线	13,601,041.08	2.25
75	300144	宋城演艺	13,578,004.80	2.25
76	002345	潮宏基	13,567,846.56	2.24
77	600006	东风汽车	13,538,468.47	2.24
78	002368	太极股份	13,522,662.80	2.24
79	000593	大通燃气	12,581,706.75	2.08
80	002148	北纬通信	12,393,962.86	2.05
81	002547	春兴精工	12,389,637.58	2.05
82	600136	当代明诚	12,311,314.50	2.04

83	300431	暴风集团	12,205,401.00	2.02
84	300210	森远股份	12,193,667.92	2.02

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	300133	华策影视	55,368,941.21	9.16
2	600730	中国高科	54,717,444.85	9.05
3	300383	光环新网	49,401,496.38	8.17
4	600485	信威集团	49,192,239.69	8.13
5	300263	隆华节能	45,384,358.07	7.50
6	002094	青岛金王	41,675,600.24	6.89
7	002551	尚荣医疗	39,681,263.10	6.56
8	300017	网宿科技	37,794,600.13	6.25
9	002517	恺英网络	35,929,520.43	5.94
10	300202	聚龙股份	34,450,727.68	5.70
11	600551	时代出版	33,089,954.51	5.47
12	300166	东方国信	32,046,987.54	5.30
13	300075	数字政通	31,604,418.02	5.23
14	300027	华谊兄弟	31,304,757.17	5.18
15	002468	艾迪西	30,917,010.91	5.11
16	002085	万丰奥威	30,522,177.90	5.05
17	300496	中科创达	29,750,661.05	4.92
18	002108	沧州明珠	29,568,150.85	4.89
19	300098	高新兴	29,224,208.99	4.83
20	300242	明家联合	28,728,508.52	4.75
21	002425	凯撒股份	28,526,350.63	4.72
22	300336	新文化	28,024,186.07	4.63
23	300007	汉威电子	27,450,865.48	4.54
24	300271	华宇软件	27,174,907.87	4.49
25	002462	嘉事堂	26,197,032.22	4.33
26	601777	力帆股份	26,126,785.00	4.32
27	300043	互动娱乐	25,596,000.00	4.23
28	002599	盛通股份	24,811,330.30	4.10
29	300014	亿纬锂能	24,116,827.33	3.99

30	002396	星网锐捷	23,836,292.54	3.94
31	600386	北巴传媒	23,537,694.08	3.89
32	300033	同花顺	23,395,083.73	3.87
33	300113	顺网科技	23,100,283.54	3.82
34	603686	龙马环卫	22,609,888.91	3.74
35	002368	太极股份	22,476,993.42	3.72
36	600266	北京城建	22,087,158.55	3.65
37	000530	大冷股份	22,085,026.22	3.65
38	000670	*ST 盈方	21,883,941.64	3.62
39	300021	大禹节水	20,801,256.31	3.44
40	600115	东方航空	20,072,327.00	3.32
41	002537	海立美达	19,681,673.50	3.25
42	300467	迅游科技	19,387,420.20	3.21
43	300310	宜通世纪	19,241,005.24	3.18
44	002667	鞍重股份	18,202,723.00	3.01
45	300367	东方网力	17,622,936.15	2.91
46	300002	神州泰岳	17,362,251.27	2.87
47	600525	长园集团	16,965,705.72	2.81
48	002153	石基信息	16,819,594.37	2.78
49	601336	新华保险	16,735,191.87	2.77
50	600075	新疆天业	16,698,930.65	2.76
51	600685	中船防务	16,395,388.00	2.71
52	002739	万达院线	16,340,937.28	2.70
53	300008	天海防务	16,334,817.32	2.70
54	000089	深圳机场	16,251,065.22	2.69
55	600731	湖南海利	16,151,067.08	2.67
56	002366	台海核电	15,871,588.68	2.62
57	002458	益生股份	15,642,040.68	2.59
58	600699	均胜电子	15,583,822.67	2.58
59	600661	新南洋	15,523,223.00	2.57
60	600422	昆药集团	15,188,104.55	2.51
61	000860	顺鑫农业	15,167,279.21	2.51
62	000021	深科技	15,108,110.10	2.50
63	002019	亿帆鑫富	14,947,656.00	2.47
64	300022	吉峰农机	14,818,310.76	2.45
65	002007	华兰生物	14,756,312.32	2.44
66	300210	森远股份	14,435,123.65	2.39
67	000687	华讯方舟	14,334,878.50	2.37

68	601028	玉龙股份	14,327,872.54	2.37
69	000671	阳光城	14,190,059.20	2.35
70	600029	南方航空	14,037,418.00	2.32
71	000607	华媒控股	14,020,530.70	2.32
72	002638	勤上光电	13,808,492.47	2.28
73	600093	禾嘉股份	13,791,725.37	2.28
74	300144	宋城演艺	13,442,362.40	2.22
75	600037	歌华有线	13,381,547.61	2.21
76	002345	潮宏基	13,227,037.04	2.19
77	600006	东风汽车	13,151,176.50	2.17
78	002103	广博股份	13,019,827.83	2.15
79	002547	春兴精工	12,750,607.05	2.11
80	000593	大通燃气	12,580,312.83	2.08
81	000606	*ST 易桥	12,552,720.55	2.08
82	002707	众信旅游	12,484,063.62	2.06
83	600073	上海梅林	12,403,566.40	2.05
84	600110	诺德股份	12,188,769.00	2.02
85	600136	当代明诚	12,122,569.05	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。

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	2,399,287,255.82
卖出股票收入（成交）总额	2,284,611,419.38

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	54,020,000.00	6.52
	其中：政策性金融债	54,020,000.00	6.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	54,020,000.00	6.52

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开 1302	500,000	54,020,000.00	6.52

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。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。本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

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。

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	614,466.25
2	应收证券清算款	25,379,310.40
3	应收股利	-
4	应收利息	1,476,316.85
5	应收申购款	1,295,069.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,765,162.64

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	601599	鹿港文化	40,696,800.00	4.91	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
111,837	3,091.47	136,770,501.98	39.56%	208,969,868.60	60.44%

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	215,355.29	0.0623%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年6月7日）基金份额总额	414,799,211.05
本报告期期初基金份额总额	235,386,927.75

本报告期基金总申购份额	253,066,439.59
减:本报告期基金总赎回份额	142,712,996.76
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	345,740,370.58

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016年3月16日,本基金管理人发布公告,解聘张力女士副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国泰君安证券股份有限公司	1	639,584,560.62	13.66%	595,645.93	14.59%	-
中信建投证券股份有限公司	2	586,154,926.35	12.52%	416,932.37	10.21%	-
国金证券股份有限公司	1	498,872,598.54	10.65%	464,599.81	11.38%	-
国信证券股份有限公司	1	470,206,889.48	10.04%	437,904.89	10.72%	-
安信证券股份有限公司	2	438,315,098.61	9.36%	408,203.92	10.00%	-
华泰证券股份有限公司	2	352,727,681.43	7.53%	259,232.32	6.35%	-
中国国际金融股份有限公司	2	330,043,424.76	7.05%	307,370.95	7.53%	-
中国银河证券股份有限公司	2	315,521,920.18	6.74%	260,641.19	6.38%	-
招商证券股份有限公司	1	259,562,139.36	5.54%	241,730.53	5.92%	-
申万宏源证券有限公司	2	211,785,266.21	4.52%	150,641.76	3.69%	-
民生证券股份有限公司	1	180,455,320.12	3.85%	168,058.74	4.12%	-
中信证券股份有限公司	1	154,025,774.21	3.29%	143,443.85	3.51%	-
长江证券股份有限公司	1	144,215,119.63	3.08%	134,307.32	3.29%	-
中银国际证券有限责任公司	2	91,169,374.67	1.95%	84,906.09	2.08%	-
兴业证券股份有限公司	1	10,947,989.56	0.23%	10,196.02	0.25%	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	9,817,182.90	49.94%	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	4,379,200.00	22.28%	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	5,460,000.00	27.78%	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

有限责任公司						
兴业证券股份 有限公司						
中泰证券股份 有限公司						
东方证券股份 有限公司						
平安证券有限 责任公司						
英大证券有限 责任公司						
广发证券股份 有限公司						
海通证券股份 有限公司						
中国中投证券 有限责任公司						
东兴证券股份 有限公司						
方正证券股份 有限公司						
光大证券股份 有限公司						
国联证券股份 有限公司						

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；
- iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- iv 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- v 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 投研能力打分：由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分，填写《券商

评价表》；

- ii 指定租用方案：由交易部根据评价结果，结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案；
- iii 公司领导审批：公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见；
- iv 交易部洽谈：交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈，并起草相关书面协议；
- v 律师审议：席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计；
- vi 交易部经办：席位租用协议生效后，由交易部专人与券商进行联系，具体办理租用手续；
- vii 连通测试：信息技术部接到交易部通知后，将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试；
- viii 通知托管行：信息技术部测试通过后，应及时通知投资部、交易部及运营部，由运营部通知托管行有关席位的具体信息；
- ix 席位启用：交易席位正式使用，投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金本期取消东海证券股份有限公司交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	民生加银基金管理有限公司由于交易所发生不可恢复熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016 年 1 月 5 日
3	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、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 6 日
5	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 1 月 8 日

	在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站	
6	民生加银策略精选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
7	民生加银策略精选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
8	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 27 日
9	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
10	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 17 日
11	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 23 日
12	民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 3 月 16 日
13	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	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

	的公告		
14	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
15	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	上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 15 日
16	民生加银策略精选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
17	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
18	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
19	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机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 4 月 26 日
20	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
21	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 5 月 31 日

	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	券报、证券时报、证券日报、公司网站	
22	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京广源达信投资管理有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 15 日
23	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
24	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 2 《民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3 《民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4 《民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5 法律意见书；

6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

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

2016 年 8 月 29 日