

# 民生加银中证内地资源主题指数型证券投资 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。

毕马威华振会计师事务所（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

<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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47

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 .....	47
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 .....	47
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
8.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4 基金投资策略的改变 .....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
11.8 其他重大事件 .....	55
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
13.1 备查文件目录 .....	58
13.2 存放地点 .....	59
13.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金
基金简称	民生加银中证内地资源主题指数
基金主代码	690008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月8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	106,191,299.73份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取全样本复制法进行被动指数化投资，力求实现跟踪偏离度与跟踪误差的最小化，获得与标的指数收益相似回报。
投资策略	本基金采取全样本复制法进行被动指数化投资，即按照中证内地资源主题指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。中证内地资源主题指数是在中证 800 指数的基础上，选择属于资源性行业中具有代表性的股票作为成分股编制而成，能够综合反映沪深证券市场中内地资源上市公司的整体表现。资源性行业包括综合性油气企业、油气的勘探与生产、煤炭与消费用燃料、铝、黄金、多种金属与采矿、贵金属与矿石等行业；成分股是在资源性行业中选择市值规模排名居前、流动性较好、符合指数跟踪的一般要求的具有相当代表性的股票。
业绩比较基准	中证内地资源主题指数×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票指数型基金，属于证券投资基金中的高风险、高收益品种，风险收益水平高于混合基金、债券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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	田青
	联系电话	0755-23999888	010-67595096

	电子邮箱	linhai@msjyfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096
传真		0755-23999800	010-66275853
注册地址		深圳市福田区莲花街道福中三路 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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjyfund.com.cn">http://www.msjyfund.com.cn</a>
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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层
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	-4,060,393.17	22,025,447.35	-26,056,460.90
本期利润	-1,344,269.19	18,807,357.59	30,614,259.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0133	0.1314	0.1482
本期加权平均净值利润率	-1.99%	16.12%	25.36%
本期基金份额净值增长率	-2.43%	-7.88%	30.09%
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	-33,548,377.92	-27,357,176.59	-58,267,470.19
期末可供分配基金份额利润	-0.3159	-0.2985	-0.2734
期末基金资产净值	72,642,921.81	64,289,695.59	162,265,650.27

期末基金份额净值	0.684	0.701	0.761
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	-31.60%	-29.90%	-23.90%

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

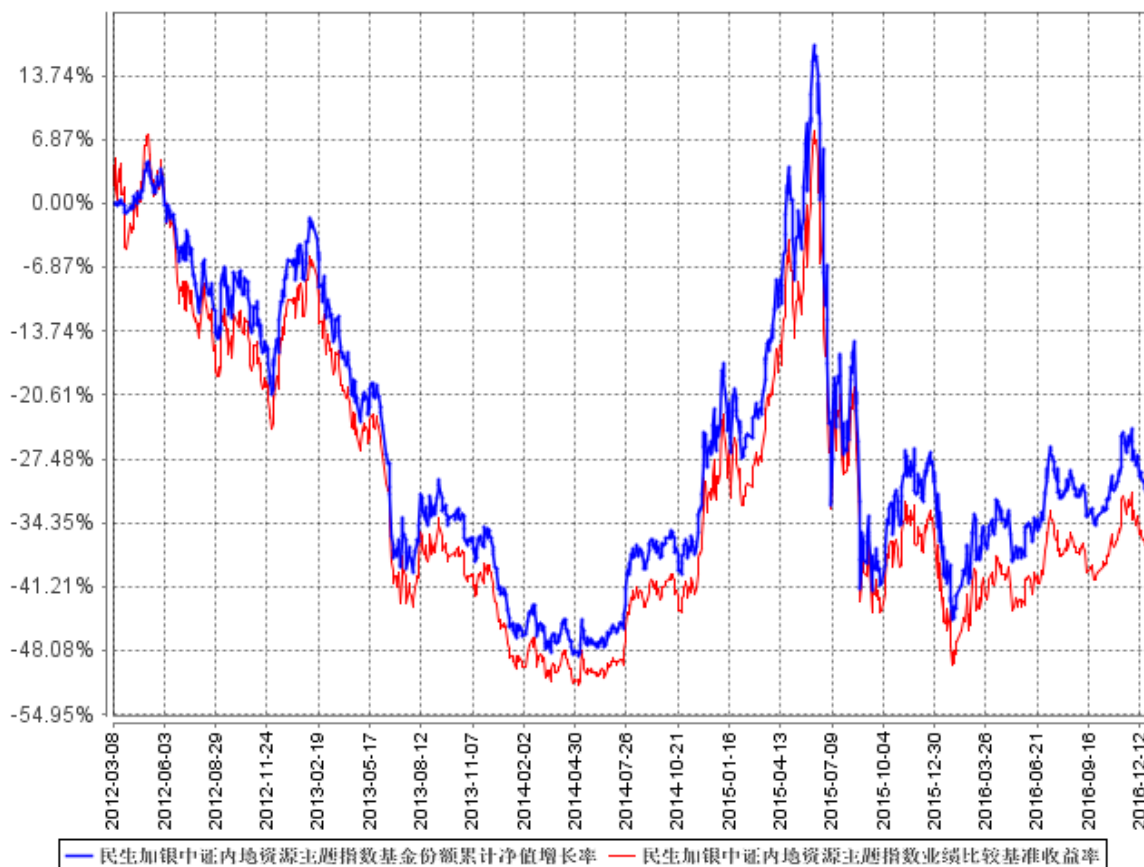
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.17%	1.10%	2.94%	1.09%	0.23%	0.01%
过去六个月	3.64%	1.14%	3.45%	1.12%	0.19%	0.02%
过去一年	-2.43%	1.79%	-3.39%	1.79%	0.96%	0.00%
过去三年	16.92%	2.12%	13.12%	2.01%	3.80%	0.11%
自基金合同生效起至今	-31.60%	1.87%	-37.87%	1.84%	6.27%	0.03%

注：业绩比较基准=中证内地资源主题指数×95%+活期存款利率（税后）×5%

### 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

民生加银中证内地资源主题指数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

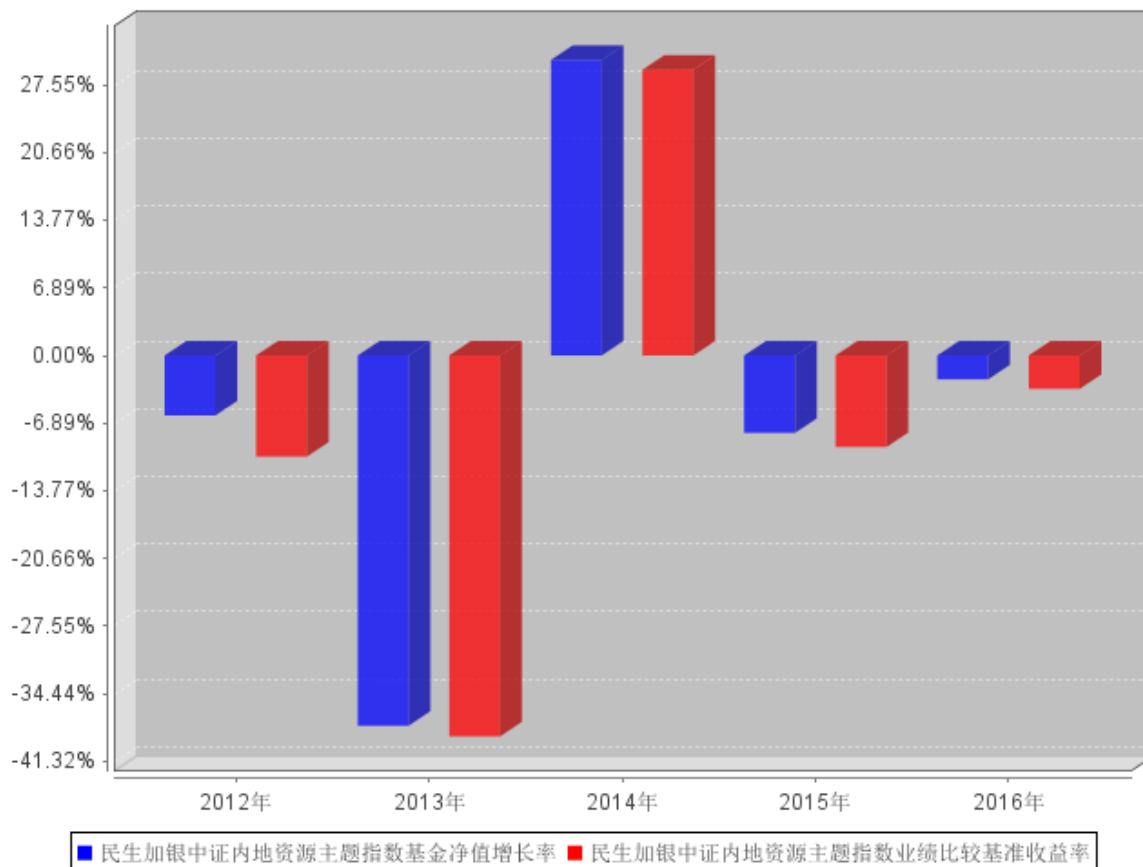


本基金合同于 2012 年 3 月 8 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。



### 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

民生加银中证内地资源主题指数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



本基金合同于 2012 年 3 月 8 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2012 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至本报告期末未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
蔡晓	民生加银中证内地资源主题指数、民生加银量化中国混合的基金经理；研究部总监助理	2016年1月4日	-	12年	中国科学院半导体研究所微电子与固体电子学硕士。曾在中信建投证券股份有限公司、新华资产管理股份有限公司研究部担任研究员，在建信基金管理有限公司研究部担任总监助理、策略组长、专户投委会成员。2014年加入民生加银基金管理有限公司，现任研究部总监助理。

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

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，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）公司管理的不同投资组合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

投资策略上我们高度关注行业基本面和外部因素对中证内地资源指数的影响。2016 年，中证内地资源指数受熔断机制影响在 1 月份显著下跌，其后呈缓慢震荡上行走势，与行业基本面和美元指数等外部影响因素的变动基本匹配，其中：美元指数随着美元加息节奏、经济政治环境变化大致呈现上半年震荡下行、下半年震荡上行的走势，而资源行业经过多年的去产能、去库存，以及国内供给侧改革的持续推进，使得资源价格处于稳步回升态势。

投资运作上我们根据成分股变动情况、申赎情况保持对中证内地资源指数进行跟踪。

### 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 0.684 元，本报告期内份额净值增长率为-2.43%，同期业绩比较基准收益率为-3.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为全球经济政治环境仍然复杂，包括美国方面以基建投资、减税为代表的特朗普新政，美联储加息的概率和节奏的变化，中国以供给侧改革、一带一路、国企改革为代表的国家战略实施，以及英国脱欧、法国大选等事件的发酵均可能对资源行业基本面和估值产生较大影响。总的来说，我们倾向于认为资源行业经过多年的去产能、去库存，基本面已确认走出底部区域，未来一年资源板块有望继续呈现回升态势。

本基金将继续保持对指数基准的跟踪。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法

规要求履行估值及净值计算的复核责任。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括分管运营的公司领导、督察长、投资总监、运营管理部、交易部、研究部、投资部、固定收益部、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究部参加人员应包含金融工程小组及相关行业研究员。分管运营的公司领导任估值小组组长。且基金经理不参与其管理基金的相关估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，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	毕马威华振审字第 1700440 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	民生加银中证内地资源主题指数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中证内地资源主题指数型证券投资基金（以下简称“民生加银中证内地资源主题指数基金”）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、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民生加银中证内地资源主题指数基金管理人民生加银基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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民生加银基金管理有限公司管理层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，民生加银中证内地资源主题指数基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了民生加银中证内地资源主题指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果及基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	窦友明	吴钟鸣
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所	
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：民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,260,526.73	5,657,110.10
结算备付金		-	-
存出保证金		4,448.83	12,965.25
交易性金融资产	7.4.7.2	67,934,664.79	59,177,302.00
其中：股票投资		67,934,664.79	59,177,302.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,185.63	1,439.97
应收股利		-	-
应收申购款		19,082.15	306,419.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		73,219,908.13	65,155,236.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	54.96
应付赎回款		300,333.58	462,958.33
应付管理人报酬		47,747.88	41,301.57
应付托管费		12,732.75	11,013.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	35,577.89	8,495.71
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	180,594.22	341,716.74
负债合计		576,986.32	865,541.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	106,191,299.73	91,646,872.18
未分配利润	7.4.7.10	-33,548,377.92	-27,357,176.59
所有者权益合计		72,642,921.81	64,289,695.59
负债和所有者权益总计		73,219,908.13	65,155,236.65

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 106,191,299.73 份，基金份额净值人民币 0.684 元。

## 7.2 利润表

会计主体：民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-285,165.72	20,656,804.32
1.利息收入		34,982.63	74,565.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	34,982.63	74,565.23
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,117,743.55	23,461,448.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,536,793.83	22,637,554.29



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	419,050.28	823,894.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,716,123.98	-3,218,089.76
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	81,471.22	338,880.31
<b>减：二、费用</b>		1,059,103.47	1,849,446.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	506,035.45	878,347.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	134,942.82	234,226.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	78,816.17	372,931.59
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	339,309.03	363,941.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,344,269.19	18,807,357.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,344,269.19	18,807,357.59

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

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）	91,646,872.18	-27,357,176.59	64,289,695.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,344,269.19	-1,344,269.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	14,544,427.55	-4,846,932.14	9,697,495.41

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	118,012,684.95	-38,919,156.06	79,093,528.89
2. 基金赎回款	-103,468,257.40	34,072,223.92	-69,396,033.48
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)	106,191,299.73	-33,548,377.92	72,642,921.81
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)	213,093,949.25	-50,828,298.98	162,265,650.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,807,357.59	18,807,357.59
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)	-121,447,077.07	4,663,764.80	-116,783,312.27
其中：1. 基金申购款	282,040,580.80	-36,508,916.93	245,531,663.87
2. 基金赎回款	-403,487,657.87	41,172,681.73	-362,314,976.14
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)	91,646,872.18	-27,357,176.59	64,289,695.59

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

民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准民生加银中证内地资源主题指数型证券投资

基金募集的批复》（证监许可〔2011〕1540 号文）批准，由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2012 年 3 月 8 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 682,579,362.28 份基金份额。本基金的基金管理人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《民生加银中证内地资源主题指数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（包含中小板、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、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的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于中证内地资源主题指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；权证投资比例占基金资产净值的比例不高于 3%；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。本基金业绩比较基准为：中证内地资源主题指数  $\times$  95% + 活期存款利率（税后） $\times$  5%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债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。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。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。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，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

股票投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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。

股利收益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确认。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代

缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金收益分配应遵循下列原则:

(a) 本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(b) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份

额，具体业务规则，请见招募说明书等相关公告；

(c) 本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

(d) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(e) 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；

(f) 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；

(g) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股



票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，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。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(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。

## 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	5,260,526.73	5,657,110.10
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,260,526.73	5,657,110.10

### 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		76,119,008.34	67,934,664.79	-8,184,343.55
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		76,119,008.34	67,934,664.79	-8,184,343.55
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		70,077,769.53	59,177,302.00	-10,900,467.53
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		70,077,769.53	59,177,302.00	-10,900,467.53

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产 / 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

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末无从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	1,183.43	1,433.59
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	-	-
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	2.20	6.38
合计	1,185.63	1,439.97

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 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	35,577.89	8,495.71
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	35,577.89	8,495.71

#### 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	594.22	1,716.74
预提信息披露费	100,000.00	200,000.00
预提审计费用	30,000.00	40,000.00
应付指数使用费	50,000.00	100,000.00
合计	180,594.22	341,716.74

#### 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	91,646,872.18	91,646,872.18
本期申购	118,012,684.95	118,012,684.95
本期赎回(以“-”号填列)	-103,468,257.40	-103,468,257.40
- 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	106,191,299.73	106,191,299.73

此处申购含红利再投资、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	-11,331,210.15	-16,025,966.44	-27,357,176.59
本期利润	-4,060,393.17	2,716,123.98	-1,344,269.19
本期基金份额交易产生的变动数	-2,102,237.23	-2,744,694.91	-4,846,932.14
其中：基金申购款	-17,359,661.36	-21,559,494.70	-38,919,156.06
基金赎回款	15,257,424.13	18,814,799.79	34,072,223.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,493,840.55	-16,054,537.37	-33,548,377.92

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
活期存款利息收入	34,446.38	73,115.60
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	425.22	941.15
其他	111.03	508.48
合计	34,982.63	74,565.23

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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

卖出股票成交总额	22,768,405.80	159,106,746.17
减：卖出股票成本总额	26,305,199.63	136,469,191.88
买卖股票差价收入	-3,536,793.83	22,637,554.29

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 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	419,050.28	823,894.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	419,050.28	823,894.25

#### 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	2,716,123.98	-3,218,089.76
——股票投资	2,716,123.98	-3,218,089.76
——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	2,716,123.98	-3,218,089.76

**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	78,285.25	292,767.53
转换费收入	3,185.97	46,112.78
合计	81,471.22	338,880.31

**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	78,816.17	372,931.59
银行间市场交易费用	-	-
合计	78,816.17	372,931.59

**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	30,000.00	40,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	3,309.03	5,941.87
债券帐户维护费	6,000.00	18,000.00
合计	339,309.03	363,941.87

**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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**7.4.8.2 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。



### 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金管理人的中方投资者、基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的外方投资者
三峡财务有限责任公司	基金管理人的中方投资者
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 7.4.10.1 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末及上年度末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 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
当期发生的基金应支付的管理费	506,035.45	878,347.25
其中：支付销售机构的客户维护费	130,257.56	204,101.06

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 0.75%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×0.75%/当年天数

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 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	134,942.82	234,226.02

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 0.20%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×0.20%/当年天数

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	5,260,526.73	34,446.38	5,657,110.10	73,115.60

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无存放于中国建设银行的结算备付金。（2015 年 12 月 31 日：无）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 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

本基金在本报告期内未进行利润分配。

#### 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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项	7.29	-	-	190,631	1,373,251.31	1,389,699.99	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项	7.83	-	-	187,558	1,474,969.79	1,468,579.14	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	25,375	618,399.43	317,187.50	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大事项	23.51	-	-	41,101	934,326.20	966,284.51	-

### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险,主要包括:

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

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

#### **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同责任，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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时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。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注期末本基金持有的流通受限证券中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

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

#### 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。

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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 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	5,260,526.73	-	-	-	-	-	5,260,526.73
存出保证金	4,448.83	-	-	-	-	-	4,448.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-67,934,664.79	67,934,664.79
应收利息	-	-	-	-	-	1,185.63	1,185.63
应收申购款	-	-	-	-	-	19,082.15	19,082.15
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,264,975.56	-	-	-	-	-67,954,932.57	73,219,908.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	300,333.58	300,333.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,747.88	47,747.88
应付托管费	-	-	-	-	-	12,732.75	12,732.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	35,577.89	35,577.89
其他负债	-	-	-	-	-	180,594.22	180,594.22
负债总计	-	-	-	-	-	576,986.32	576,986.32
利率敏感度缺口	5,264,975.56	-	-	-	-	-67,377,946.25	72,642,921.81
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	5,657,110.10	-	-	-	-	-	5,657,110.10
存出保证金	12,965.25	-	-	-	-	-	12,965.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-59,177,302.00	59,177,302.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,439.97	1,439.97
应收申购款	-	-	-	-	-	306,419.33	306,419.33
资产总计	5,670,075.35	-	-	-	-	-59,485,161.30	65,155,236.65
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	54.96	54.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	462,958.33	462,958.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,301.57	41,301.57
应付托管费	-	-	-	-	-	11,013.75	11,013.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,495.71	8,495.71
其他负债	-	-	-	-	-	341,716.74	341,716.74
负债总计	-	-	-	-	-	865,541.06	865,541.06
利率敏感度缺口	5,670,075.35	-	-	-	-	-58,619,620.24	64,289,695.59

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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。

##### 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	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	67,934,664.79	93.52	59,177,302.00	92.05
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	67,934,664.79	93.52	59,177,302.00	92.05

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变 本基金持有的股票的涨跌幅与业绩比较基准中的股票指数的涨跌幅呈线性关系		
	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）	
分析		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%	3,611,402.72	3,493,579.15
	2、本基金业绩比较基准下降5%	-3,611,402.72	-3,493,579.15

#### 7.4.14 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

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。



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 63,792,913.65 元(2015 年 12 月 31 日: 人民币 56,533,019.62 元), 划分为第二层次的余额为人民币 4,141,751.14 元(2015 年 12 月 31 日: 人民币 2,644,282.38 元), 无划分为第三层次余额(2015 年 12 月 31 日: 无)。

#### (b) 公允价值所属层次间的重大变动

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)、或属于非公开发行等情况时, 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。

2016 年, 本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

#### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2015 年 12 月 31 日: 无)。

#### (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。

## § 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	67,934,664.79	92.78
	其中：股票	67,934,664.79	92.78
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	5,260,526.73	7.18
7	其他各项资产	24,716.61	0.03
8	合计	73,219,908.13	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	40,964,391.24	56.39
C	制造业	22,793,293.20	31.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	606,929.40	0.84
	合计	64,364,613.84	88.60

### 8.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采矿业	3,023,735.95	4.16
C	制造业	546,315.00	0.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,570,050.95	4.91

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	600028	中国石化	970,688	5,251,422.08	7.23
2	600547	山东黄金	93,288	3,405,944.88	4.69
3	601088	中国神华	206,657	3,343,710.26	4.60
4	601857	中国石油	420,006	3,339,047.70	4.60
5	601899	紫金矿业	981,683	3,278,821.22	4.51
6	600111	北方稀土	236,718	2,904,529.86	4.00
7	601600	中国铝业	507,025	2,139,645.50	2.95
8	600489	中金黄金	176,181	2,130,028.29	2.93
9	000630	铜陵有色	660,317	2,033,776.36	2.80
10	002466	天齐锂业	59,100	1,917,795.00	2.64
11	600219	南山铝业	611,315	1,888,963.35	2.60
12	000060	中金岭南	165,382	1,844,009.30	2.54
13	600256	广汇能源	342,131	1,597,751.77	2.20
14	600157	永泰能源	369,297	1,480,880.97	2.04
15	601168	西部矿业	187,558	1,468,579.14	2.02
16	600362	江西铜业	86,512	1,447,345.76	1.99
17	600497	驰宏锌锗	202,800	1,425,684.00	1.96
18	000983	西山煤电	167,078	1,413,479.88	1.95
19	002340	格林美	215,716	1,412,939.80	1.95
20	600673	东阳光科	190,631	1,389,699.99	1.91
21	603993	洛阳钼业	365,760	1,360,627.20	1.87
22	600614	鹏起科技	107,200	1,254,240.00	1.73
23	000878	云南铜业	106,000	1,251,860.00	1.72
24	000975	银泰资源	74,723	1,168,667.72	1.61
25	600516	方大炭素	121,334	1,123,552.84	1.55
26	601225	陕西煤业	220,540	1,069,619.00	1.47
27	002128	露天煤业	120,040	1,032,344.00	1.42
28	601699	潞安环能	120,356	968,865.80	1.33
29	000697	炼石有色	41,101	966,284.51	1.33
30	000758	中色股份	119,810	957,281.90	1.32
31	600348	阳泉煤业	127,707	859,468.11	1.18

32	002155	湖南黄金	69,671	797,732.95	1.10
33	000937	冀中能源	113,181	762,839.94	1.05
34	601958	金钼股份	99,713	762,804.45	1.05
35	600392	盛和资源	51,340	684,362.20	0.94
36	600259	广晟有色	14,616	621,033.84	0.85
37	600175	美都能源	122,612	606,929.40	0.84
38	000762	西藏矿业	35,300	601,159.00	0.83
39	002428	云南锗业	45,562	577,270.54	0.79
40	000519	中兵红箭	38,623	575,482.70	0.79
41	600395	盘江股份	56,115	452,848.05	0.62
42	600188	兖州煤业	41,203	447,464.58	0.62
43	000969	安泰科技	33,000	347,820.00	0.48

### 8.3.2 期末积极投资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	601898	中煤能源	174,924	1,016,308.44	1.40
2	000612	焦作万方	47,300	546,315.00	0.75
3	601666	平煤股份	104,585	509,328.95	0.70
4	601001	大同煤业	81,146	495,802.06	0.68
5	000552	靖远煤电	125,900	477,161.00	0.66
6	000693	ST 华泽	25,375	317,187.50	0.44
7	600397	安源煤业	40,300	207,948.00	0.29

## 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	002466	天齐锂业	2,628,095.20	4.09
2	601600	中国铝业	2,496,169.00	3.88
3	601899	紫金矿业	1,837,910.00	2.86
4	600219	南山铝业	1,832,637.00	2.85
5	601857	中国石油	1,741,045.00	2.71

6	600028	中国石化	1,700,389.00	2.64
7	600547	山东黄金	1,537,115.00	2.39
8	603993	洛阳钼业	1,403,947.00	2.18
9	600673	东阳光科	1,199,695.00	1.87
10	000878	云南铜业	1,080,398.00	1.68
11	600489	中金黄金	942,680.50	1.47
12	000762	西藏矿业	896,587.00	1.39
13	600111	北方稀土	871,033.00	1.35
14	601088	中国神华	841,107.06	1.31
15	600614	鼎立股份	808,300.00	1.26
16	000060	中金岭南	769,447.00	1.20
17	601225	陕西煤业	765,154.00	1.19
18	002128	露天煤业	748,709.00	1.16
19	000612	焦作万方	746,994.96	1.16
20	600497	驰宏锌锗	708,920.99	1.10

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601600	中国铝业	2,196,472.00	3.42
2	002203	海亮股份	2,014,449.13	3.13
3	601899	紫金矿业	1,969,410.00	3.06
4	000630	铜陵有色	1,649,664.64	2.57
5	601857	中国石油	1,527,875.00	2.38
6	600028	中国石化	1,522,980.00	2.37
7	600219	南山铝业	1,475,302.00	2.29
8	600549	厦门钨业	1,290,392.55	2.01
9	000831	*ST 五稀	885,501.43	1.38
10	000612	焦作万方	849,381.00	1.32
11	600547	山东黄金	677,155.00	1.05
12	600489	中金黄金	667,184.00	1.04
13	601666	平煤股份	663,456.00	1.03
14	601898	中煤能源	653,716.00	1.02
15	600497	驰宏锌锗	653,580.00	1.02

16	600111	北方稀土	650,028.09	1.01
17	601001	大同煤业	631,743.00	0.98
18	601088	中国神华	629,257.00	0.98
19	000697	炼石有色	597,236.00	0.93
20	000933	*ST 神火	512,349.75	0.80

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	32346438.44
卖出股票收入（成交）总额	22,768,405.80

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,448.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,185.63
5	应收申购款	19,082.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,716.61

### 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****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五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
6,751	15,729.71	9,901.54	0.01%	106,181,398.19	99.99%

**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	63,883.23	0.0602%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年3月8日）基金份额总额	682,681,274.40
本报告期期初基金份额总额	91,646,872.18
本报告期基金总申购份额	118,012,684.95
减:本报告期基金总赎回份额	103,468,257.40
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	106,191,299.73

## § 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

本报告期支付给毕马威华振会计师事务所的报酬为 30,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 1 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	
国金证券股份有限公司	2	15,795,523.70	28.75%	14,710.29	28.75%	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	13,672,745.67	24.88%	12,733.42	24.88%	-
中泰证券股份有限公司	1	9,922,136.44	18.06%	9,240.31	18.06%	-
中国银河证券股份有限公司	2	6,104,371.99	11.11%	5,684.92	11.11%	-
中信建投证券股份有限公司	2	5,098,950.00	9.28%	4,748.66	9.28%	-
安信证券股份有限公司	2	3,504,572.94	6.38%	3,263.62	6.38%	-
长江证券股份有限公司	1	849,381.00	1.55%	791.03	1.55%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本报告期新 增深圳交易 单元
东吴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	本报告期新 增深圳交易 单元
川财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	本报告期新 增深圳交易 单元
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	本报告期新 增深圳交易 单元
英大证券有限 责任公司	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
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-

招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限 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本基金本期新增国金证券股份有限公司深圳交易单元、东北证券股份有限公司深圳交易单元、天风证券股份有限公司上海及深圳交易单元、川财证券有限责任公司深圳交易单元、华创证券有限责任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基金经理变更公告	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	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 12 日
6	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
7	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
8	民生加银基金管理有限公司关于	证券时报、公司网站	2016 年 3 月 8 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
9	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
10	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
11	民生加银基金管理有限公司关于调整通过招行银行借记卡在網上直销系统中办理业务的费率优惠公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 6 日
12	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
13	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2016 年 4 月 20 日
14	民生加银基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 25 日
15	民生加银基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 25 日
16	民生加银基金管理有限公司关于旗下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调整旗下部分基金申购最低金额和赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 6 日
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	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



	的公告		
20	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型的公告	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
24	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	证券时报、公司网站	2016 年 7 月 21 日
25	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
26	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
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
28	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金 2016 年半年度报告正文及摘要	证券时报、公司网站	2016 年 8 月 29 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上海基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
30	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 9 月 6 日

	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	券报、证券时报、证券日报、公司网站	
31	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2016 年第 2 号）	证券时报、公司网站	2016 年 10 月 21 日
32	民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	证券时报、公司网站	2016 年 10 月 25 日
33	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
34	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
35	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

## § 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 《民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金招募说明书》；
- 13.1.3 《民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金合同》；
- 13.1.4 《民生加银中证内地资源主题指数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