

# 民生加银鑫盈债券型证券投资基金 2016 年 年度报告 摘要

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

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 7 月 26 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	民生加银鑫盈债券	
基金主代码	003048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 26 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	39,839,106.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	民生加银鑫盈债券 A	民生加银鑫盈债券 C
下属分级基金的交易代码:	003048	003049
报告期末下属分级基金的份额总额	39,836,873.92 份	2,232.34 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在综合考虑基金资产收益性、安全性、流动性和严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求绝对收益，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096
传真		0755-23999800	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 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 7 月 26 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	民生加银鑫盈债券 A	民生加银鑫盈债券 C
本期已实现收益	563,527.41	227.24
本期利润	562,851.75	102.90
加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0040
本期基金份额净值增长率	0.73%	0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0073	0.0055
期末基金资产净值	40,128,581.23	2,244.69
期末基金份额净值	1.0073	1.0055

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。

④本基金合同于 2016 年 7 月 26 日生效。

### 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

民生加银鑫盈债券 A

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	0.52%	0.01%	-2.32%	0.15%	2.84%	-0.14%
自基金合同生效起至今	0.73%	0.01%	-1.87%	0.12%	2.60%	-0.11%

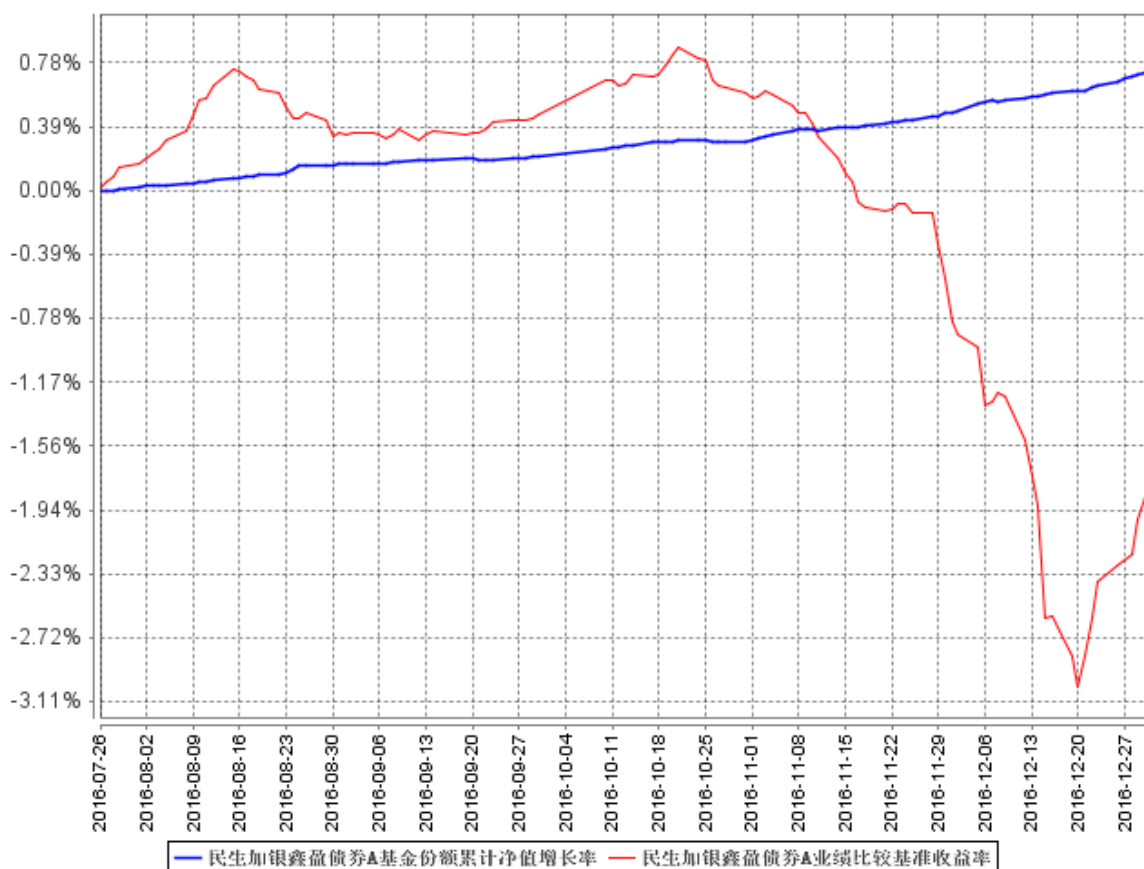
民生加银鑫盈债券 C

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	0.41%	0.01%	-2.32%	0.15%	2.73%	-0.14%
自基金合同生效起至今	0.55%	0.01%	-1.87%	0.12%	2.42%	-0.11%

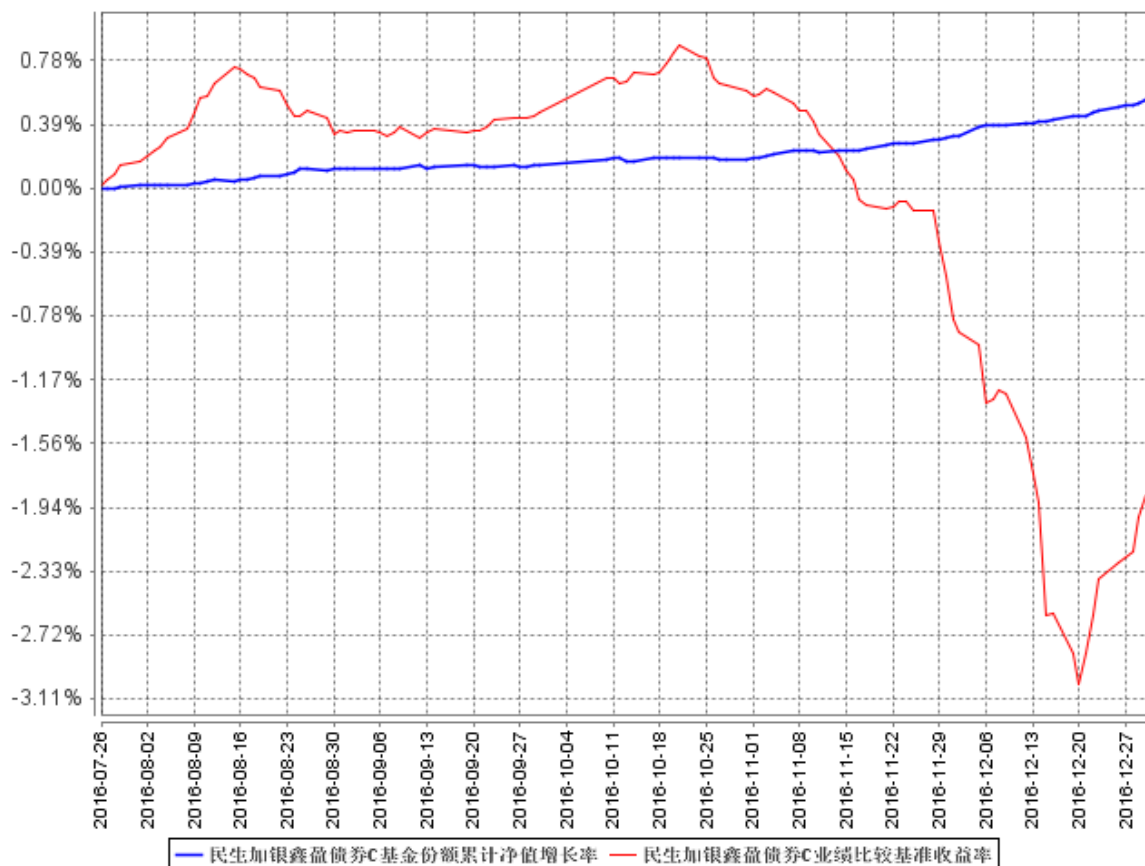
注：业绩比较基准=中国债券综合指数收益率

### 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

民生加银鑫盈债券A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



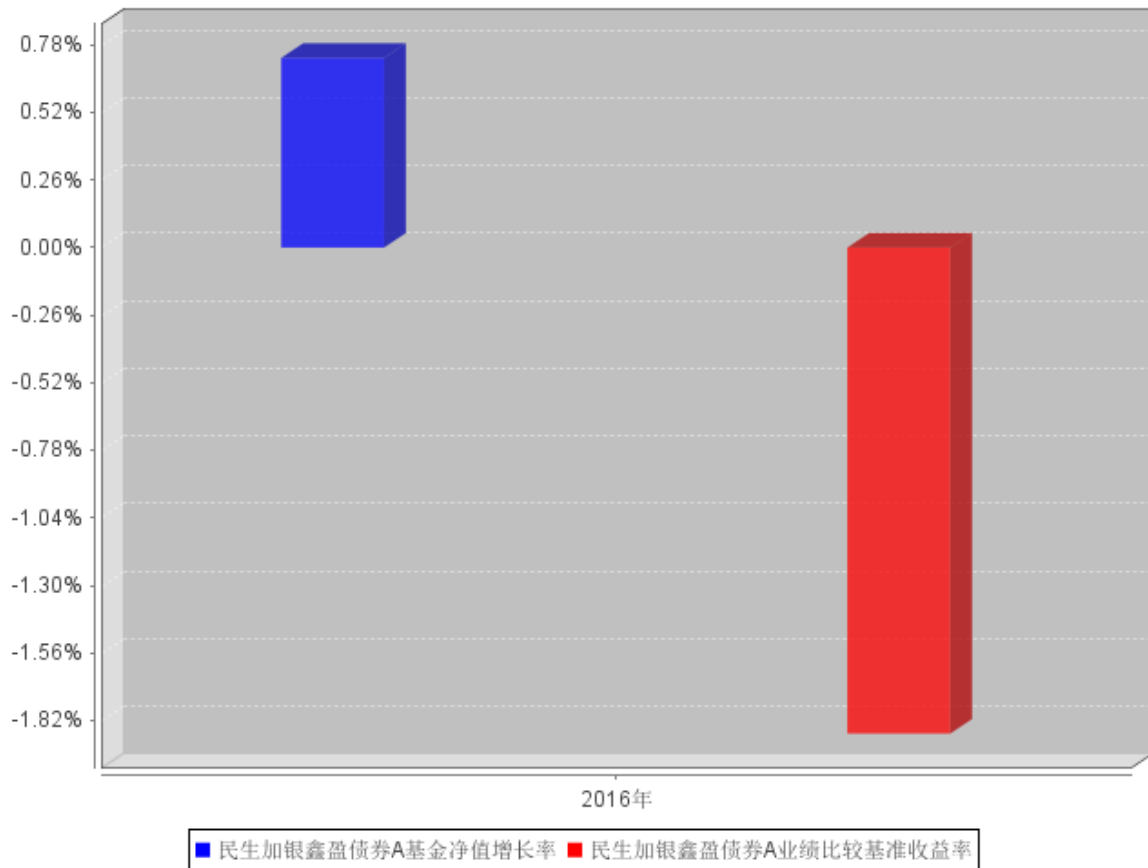
民生加银鑫盈债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



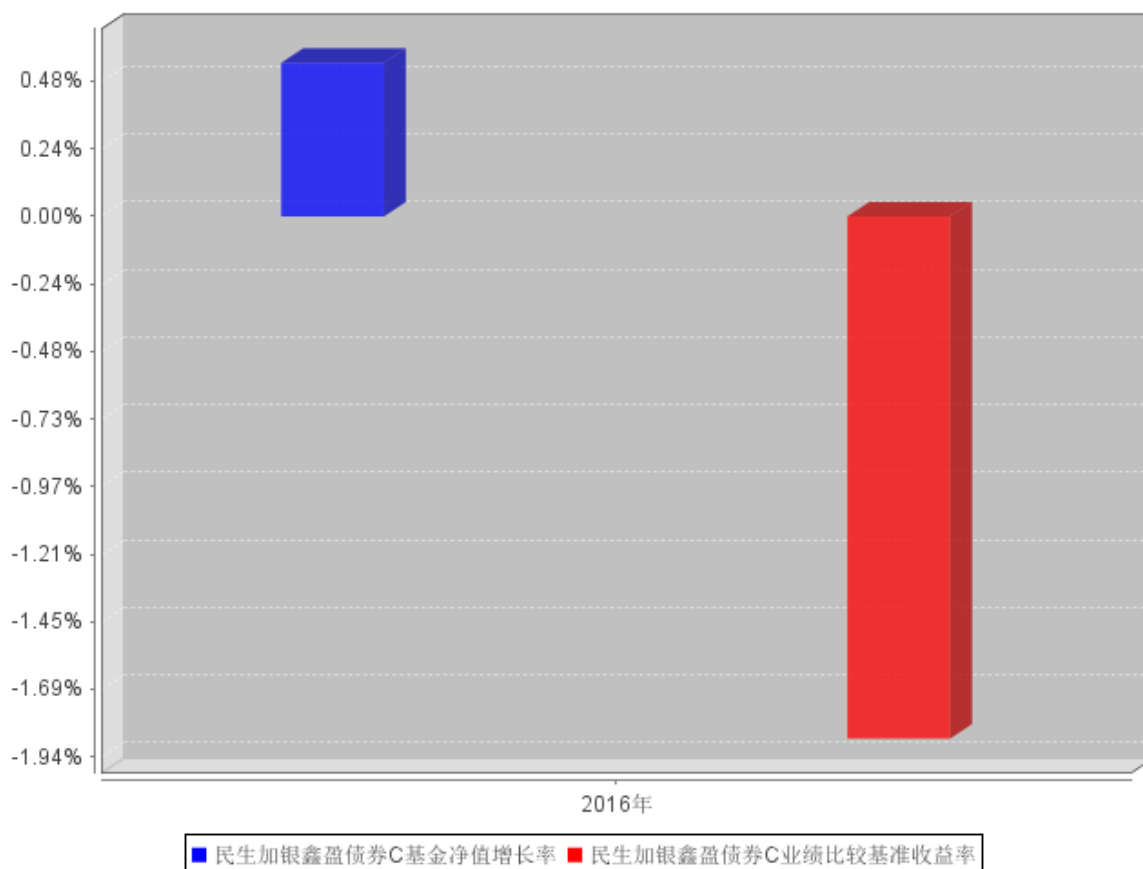
注：本基金合同于 2016 年 7 月 26 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

### 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

民生加银鑫盈债券A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



民生加银鑫盈债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2016 年 7 月 26 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 2016 年 7 月 26 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		
李慧鹏	民生加银平稳增利、民生加银家盈理财 7 天、民生加银岁岁增利债券、民生加银平稳添利债券、民生加银新收益债券、民生加银鑫瑞债券、民生加银鑫盈债券、民	2016 年 7 月 26 日	-	6 年	首都经济贸易大学产业经济学硕士，曾在联合资信评估有限公司担任高级分析师，在银华基金管理有限公司担任研究员，泰达宏利基金管理有限公司担任基金经理的职务。2015 年 6 月加入民生加银基金管理有限公司，担任基金经理的职务。

	生加银鑫安纯债债券、民生加银鑫享债券的基金经理。				
李文君	民生加银现金增利货币、民生加银家盈理财 7 天、民生加银家盈理财月度、民生加银和鑫债券、民生加银现金添利货币、民生加银鑫盈债券、民生加银腾元宝货币的基金经理	2016 年 7 月 26 日	-	9 年	自 2007 年至 2011 年在东方基金管理有限公司交易部担任交易员职务，自 2011 年 5 月至 2013 年 8 月在方正富邦基金管理有限公司交易部担任交易员职务，自 2013 年 8 月至 2014 年 3 月在方正富邦基金管理有限公司投资部担任基金经理助理一职，自 2014 年 3 月至 2016 年 1 月在方正富邦基金管理有限公司担任基金经理一职。2016 年 1 月加入民生加银基金管理有限公司。

## 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同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，中国经济整体表现平稳，供给侧改革取得成效，债券市场波动较大。上半年，债券市场面临无序违约和地产市场回暖的双重冲击，下半年又遭遇到货币政策收紧带来的流动性压力。纵观全年，市场仅有短暂的交易窗口，债券基金整体表现不佳。

本基金三季度成立以来一直以现金管理为主，保持了较低的仓位和极短的久期，有效地避免了本轮市场的急速调整，并在 11 月、12 月流动性紧张的时期通过融出资金获得了良好的回报。

#### 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 A 份额净值为 1.0073 元，本报告期内 A 份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%。本基金 C 份额净值为 1.0055 元，C 份额净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们认为，央行偏紧的货币政策将导致金融机构的负债端持续承压，同时上半年的基建投资和补库存需求将带动经济持续回暖，债券市场短期内没有趋势性机会。但目前部分短久期债券以具备配置价值，本基金将积极参与。此外，波动较大的市场往往会出现超调的机会，带来长端债券交易波段的可能，本基金业也将密切关注。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，没有出现持有人数低于二百人的情形。

### § 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合规守信、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	安永华明(2017)审字第 60950520_H20 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	民生加银鑫盈债券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鑫盈债券型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人民生加银基金管理有限责任公司的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了民生加银鑫盈债券型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	乌爱莉
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：民生加银鑫盈债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款		35,826,670.79
结算备付金		241,213.52
存出保证金		272.77
交易性金融资产		4,000,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		4,000,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-

应收证券清算款		-
应收利息		136,980.35
应收股利		-
应收申购款		13,379.28
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		40,218,516.71
<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>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		12,461.51
应付托管费		3,115.40
应付销售服务费		0.62
应付交易费用		2,113.26
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		70,000.00
负债合计		87,690.79
<b>所有者权益:</b>		
实收基金		39,839,106.26
未分配利润		291,719.66
所有者权益合计		40,130,825.92
负债和所有者权益总计		40,218,516.71

注：1) 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 39,839,106.26 份，其中民生加银鑫盈债券型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0073 元，份额总额 39,836,873.92 份；民生加银鑫盈债券型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.0055 元，份额总额 2,232.34 份。

2) 本基金基金合同于 2016 年 7 月 26 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止。因此，无对比期间财务报表数据。

## 7.2 利润表

会计主体：民生加银鑫盈债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 7 月 26 日(基金合同生 效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		839,702.30
1.利息收入		1,114,614.92
其中：存款利息收入		133,611.09
债券利息收入		584,636.55
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		396,367.28
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-278,114.41
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		-278,114.41
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-800.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		4,001.79
<b>减：二、费用</b>		276,747.65
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	150,765.45
2. 托管费	7.4.8.2.2	37,691.31
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	46.88
4. 交易费用		1,104.24
5. 利息支出		9,597.50
其中：卖出回购金融资产支出		9,597.50
6. 其他费用		77,542.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		562,954.65
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		562,954.65

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银鑫盈债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元



项目	本期 2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)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)	200,089,604.08	-	200,089,604.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	562,954.65	562,954.65
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)	-160,250,497.82	-271,234.99	-160,521,732.81
其中：1. 基金申购款	39,815,396.94	242,916.31	40,058,313.25
2. 基金赎回款	-200,065,894.76	-514,151.30	-200,580,046.06
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)	39,839,106.26	291,719.66	40,130,825.92

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

民生加银鑫盈债券型证券投资基金(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[2016]1604 号文“关于准予民生加银鑫盈债券型证券投资基金注册的批复”的核准,由民生加银基金管理有限公司自 2016 年 7 月 20 日至 2016 年 7 月 22 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 60950520\_H09 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 7 月 26 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 200,074,599.50 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 15,004.58 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 200,089,604.08 元,折合 200,089,604.08 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，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(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《民生加银鑫盈债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金根据认购费用、申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银鑫盈债券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，包括国债、金融债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、中小企业私募债券、短期融资券及超级短期融资券、次级债、政府机构债、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、现金等金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产。因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可上市交易后不超过 10 个交易日的时间内卖出。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：本基金投资于债券占基金资产比例不低于 80%，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：中国债券综合指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金

信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

#### **7.4.6.1 印花税**

证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式和买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

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

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含

1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25%计入应纳税所得额; 上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。自 2015 年 9 月 8 日起, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司(“民生加银基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	基金管理人的股东
加拿大皇家银行	基金管理人的股东
三峡财务有限责任公司	基金管理人的股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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。

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期末无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	150,765.45
其中：支付销售机构的客户维护费	0.40

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 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2016 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 12,461.51 元。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,691.31

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 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2016 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 3,115.40 元。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银鑫盈债券 A	民生加银鑫盈债券 C	合计

民生加银基金公司	-	46.88	46.88
合计	-	46.88	46.88

注：1) 民生加银鑫盈债券型证券投资基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

2) 本基金于本期末未支付关联方的销售服务费余额为人民币 0.62 元；其中，应支付民生加银基金公司人民币 0.62 元。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本期末运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金于本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	826,670.79	48,831.38

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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/增发而于期末持有的流通受限证券。

#### **7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金期末无持有的暂时停牌等流通受限股票。

#### **7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 0.00 元, 无质押债券。

##### **7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 0.00 元, 无质押债券。

#### **7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无划分为第一层次的余额, 划分为第二层次的余额为人民币 4,000,000.00 元, 无划分为第三层次的余额。

###### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况, 本基金不会



于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2)截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 40,130,825.92 元，已连续超过 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。

(3)除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	4,000,000.00	9.95
	其中：债券	4,000,000.00	9.95
	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	36,067,884.31	89.68
7	其他各项资产	150,632.40	0.37
8	合计	40,218,516.71	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.5 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	4,000,000.00	9.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	4,000,000.00	9.97

**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**

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	019533	16 国债 05	40,000	4,000,000.00	9.97

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

注：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国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1 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**

**8.11.2 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**

### 8.11.3 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	272.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	136,980.35
5	应收申购款	13,379.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,632.40

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.6 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

份额级别	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
民生加银鑫盈债券 A	219	181,903.53	39,756,982.41	99.80%	79,891.51	0.20%
民生加银鑫盈债券 C	21	106.30	-	-	2,232.34	100.00%
合计	240	165,996.28	39,756,982.41	99.79%	82,123.85	0.21%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	民生加银鑫盈债券 A	33,291.23	0.0836%
	民生加银鑫盈债券 C	1,411.26	63.2189%
	合计	34,702.49	0.0871%

### 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	份额级别	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	民生加银鑫盈债券 A	0
	民生加银鑫盈债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	民生加银鑫盈债券 A	0~10

开放式基金	民生加银鑫盈债券 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银鑫盈债券 A	民生加银鑫盈债券 C
基金合同生效日（2016 年 7 月 26 日）基金份额总额	200,037,001.60	52,602.48
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	39,815,367.00	29.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	200,015,494.68	50,400.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,836,873.92	2,232.34

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期支付给安永华明会计师事务所的报酬为 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	
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	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	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
中国国际金融 股份有限公司	4,180,965.59	100.00%	3,704,000,000.00	100.00%	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 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	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 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本基金合同于 2016 年 7 月 26 日生效，根据以上标准，本期选择了国泰君安证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、平安证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、英大证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券股份有限公司的交易单元作为本基金交易单元。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

民生加银基金管理有限公司  
2017 年 3 月 30 日