

民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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
报告送出日期:2015年1月22日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。
基金管理人中国建设银行股份有限公司对本基金合同规定,于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金保本。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中所载资料截止于本报告期末。
本报告自2014年10月1日起至2014年12月31日止。

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	1,274,524.96	3.41
C	制造业	1,608,474.22	28.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,123,245.00	6.03
E	建筑业	2,607,920.00	5.10
F	批发和零售业	574,300.00	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	504.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,439,507.00	3.17
J	金融业	17,282,062.50	27.21
K	房地产业	3,429,960.00	6.60
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	教育、体育、新闻和传媒业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	44,877,137.18	86.34

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	34,000	2,545,160.00	4.39
2	600000	浦发银行	106,800	1,670,100.00	3.22
3	600016	民生银行	90,600	1,569,414.00	3.02
4	601016	兴业银行	98,800	1,564,200.00	3.01
5	601688	华泰证券	62,600	1,511,822.00	2.95
6	000735	卧龙电气	90,100	1,515,482.00	2.92
7	600023	上海电力	19,150	1,495,615.00	2.88
8	000728	三元股份	46,000	1,433,820.00	2.76
9	600848	保利地产	126,000	1,366,320.00	2.62
10	300017	网科科技	24,400	1,176,000.00	2.26

5.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资明细

序号	代码	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资明细

序号	代码	名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股指期货投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名期权投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名货币市场基金投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名其他资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外资产投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.00	3.69
2	120018	中国国债	19,360	1,819,680.00	3.50

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名境外衍生品投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110017	中国国债	10,160	1,915,680.0	