民生加银现金宝货币市场基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2015年8月25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2015年8月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	民生加银现金宝货币
基金主代码	000371
交易代码	000371
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月18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	19,233,532,295.16份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在充分控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的投资将以保证资产的安全性和流动性为基本原则，力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上，科学预计未来利率走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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@msjyfund.com.cn	tianqing1.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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	409,296,294.13
本期利润	409,296,294.13
本期净值收益率	2.1659%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	–
期末基金资产净值	19,233,532,295.16
期末基金份额净值	1.0000

注：①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。

②本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

④本基金按日结转份额。

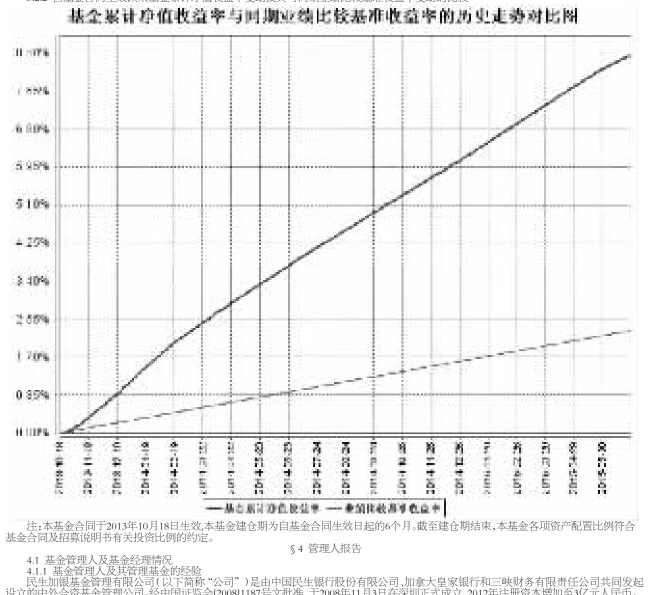
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2995%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.1885%	0.0017%
过去三个月	1.0315%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.6949%	0.0020%
过去六个月	2.1659%	0.0018%	0.6695%	0.0000%	1.4964%	0.0018%
过去一年	4.4568%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	3.1068%	0.0015%
自基金合同生效起至今	8.4611%	0.0028%	2.2968%	0.0000%	6.1643%	0.0028%

注：业绩比较基准=七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同于2013年10月18日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2015年6月30日，公司共管理24只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选股票型证券投资基金、民生加银稳健成长股票型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、民生加银景气行业股票型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银家盈理财7天债券型证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银家盈理财月度债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置定期开放混合型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨林耘	民生加银增强收益债券、民生加银信用双利债券、民生加银平稳增利、民生加银现金增利货币、民生加银家盈理财7天、民生加银转债优选、民生加银家盈理财月度、民生加银岁岁增利债券、民生加银平稳添利债券、民生加银现金宝货币、民生加银新动力定开混合、民生加银新战略混合的基金经理	2014年4月3日	–	21年	曾任东方基金基金经理(2008年–2013年)，中国外贸信托高级投资经理，部门副总经理，泰康人寿投资部高级投资经理，武汉融利期货首席交易员、研究部副经理。自2013年10月加盟民生加银基金管理有限公司。
曹晋文	本基金的基金经理	2015年2月10日	–	10年	人民大学统计学硕士，获得注册会计师资格证书，曾就职于信诚人寿保险有限公司，担任投资经理一职。2014年3月加入民生加银基金管理有限公司，任基金经理助理一职。
乐瑞祺	民生加银新战略混合的基金经理	2013年10月18日	2015年2月10日	11年	复旦大学数量经济学硕士。自2002年起任衡泰软件定量研究部定量分析师，从事固定收益产品定价及风险管理系统开发工作；2004年加入博时基金管理有限公司，任固定收益部基金经理助理，从事固定收益投资及研究业务；2009年加入本公司，曾任基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年，宏观经济弱势企稳。

1季度，宏观经济较弱。工业增加值仍然弱势下滑，工业品价格指数PPI重心继续下行，房地产销售面积和固定资产投资仍然没有明显企稳。但是经济运行中出现了一些积极迹象，中采PMI指数连续2个月反弹，3月份重新站上50.1；货币供应量M2增速2月份结束下滑态势，反弹至12.5%；人民币新增贷款规模1-2月份同比环比均大幅增加。

2季度，经济有所企稳。工业增加值同比小幅改善，但工业品价格指数PPI和消费品价格指数环比均小幅下行；房地产销售面积同比降幅收窄，但固定资产投资同比增速仍然持续下降。中采PMI指数连续3个月位于50以上，货币供应量M2增速震荡企稳，人民币新增贷款规模同比略有改善。

货币政策上半年延续了宽松的态度。央行连续降准降息，公开市场逆回购利率稳步下调，引导货币市场利率下行，均表明央行层面细心呵护资金面的宽松，持续关注经济增长。房地产销售在货币政策放松的支持下，上半年处于持续恢复的态势。

债券市场上半年整体表现为陡峭化下行。利率债短端收益率在资金极度宽松的带动下持续大幅下行；长端利率1季度先下后上，2季度震荡下行，上半年整体走势持平。信用债相比利率债走势略强，收益率曲线震荡下行。

民生加银现金宝货币上半年根据对IPO等影响资金价格关键因素的预判，灵活配置不同期限资产，成功管理流动性风险；加大配置同业存款，提高基金静态收益；积极利用债券市场收益率变化和一二级波动不同步的机会，获取债券价格波动的资本利得，提高基金超额收益。基金规模上半年保持相对稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年6月30日，本报告期内份额净值增长率为2.1659%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为随着货币政策和财政政策的积极发力，房地产销售企稳反弹有望带来房地产投资降幅收窄，地方政府债务置换为基建投资提供了较多的资金支持，经济内生动力有望3季度内见到企稳，CPI由于基数效应下半年震荡上行概率较大，基本面对债券收益率影响偏中性。地方政府债务置换的总量和节奏短期内仍然会加剧市场对供需关系的担忧。

货币政策仍然会有适度宽松，但考虑到宽松政策前期已经逐步兑现，汇率、股票和房地产市场等资产价格的波动仍然会成为央行货币政策的考量因素，货币政策放松的力度和节奏具有一定的不确定性。

综合来看，本基金对下半年债券市场中性偏谨慎，宽幅震荡的概率较大，大幅下行动力不足，存在一定的上行压力。投资策略上，本基金将继续加大同业存款的配置，同时积极把握债券价格小幅波动的机会，通过波段操作获得有效价差。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持，我们将本着勤勉尽责的精神，秉承"诚信、稳健、专业、创新"的原则，力争为基金持有人在保持良好流动性前提下获取较好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括分管运营的公司领导、督察长、投资总监、金融工程小组、运营管理部、交易部、研究部、投资部、固定收益部、专户一部、专户二部、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。分管运营的公司领导任估值小组组长。且基金经理不参与其管理基金的相关估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定：本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配，每日进行支付。本报告期内本基金应分配利润409,296,294.13元，报告期内已分配利润409,296,294.13元。

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：民生加银现金宝货币市场基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	10,305,284,905.11	5,467,468,788.30
结算备付金		–	–
存出保证金		–	–
交易性金融资产	6.4.7.2	7,372,467,021.43	6,663,563,408.04
其中：股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		7,372,467,021.43	6,663,563,408.04
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	3,012,006,718.00	4,013,860,780.78
应收证券清算款		–	–
应收利息	6.4.7.5	131,334,404.05	160,175,432.12
应收股利		–	–
应收申购款		–	–
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	–	–
资产总计		20,821,093,048.59	16,305,068,409.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		1,571,396,602.90	1,401,564,817.64
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		5,184,916.35	4,158,129.34
应付托管费		1,382,644.37	1,108,834.48
应付销售服务费		4,320,763.65	3,465,107.79
应付交易费用	6.4.7.7	249,595.66	128,878.10
应交税费		–	–
应付利息		427,717.36	541,871.54
应付利润		2,782,881.33	1,642,079.18
递延所得税负债		–	–
其他负债	6.4.7.8	1,815,631.81	802,130.43
负债合计		1,587,560,753.43	1,413,411,848.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	19,233,532,295.16	14,891,656,560.74
未分配利润	6.4.7.10	–	–
所有者权益合计		19,233,532,295.16	14,891,656,560.74
负债和所有者权益总计		20,821,093,048.59	16,305,068,409.24

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.000元，基金份额总额19,233,532,295.16份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银现金宝货币市场基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		492,148,561.59	87,761,912.58
1.利息收入		477,794,799.06	85,858,724.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	268,177,099.85	48,613,219.46
债券利息收入		143,465,017.64	20,594,345.39
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		66,152,681.57	16,651,159.39
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		14,353,762.53	1,903,188.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益	6.4.7.13	14,353,762.53	1,903,188.34
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	–	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	–	–
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	–	–
减：二、费用		82,852,267.46	12,941,591.04
1.管理人报酬	6.4.9.2.1	28,612,158.62	4,475,311.45
2.托管费	6.4.9.2.2	7,629,908.98	1,193,416.37
3.销售服务费	6.4.9.2.3	23,843,465.67	3,729,426.28
4.交易费用	6.4.7.19	–	–
5.利息支出		22,597,576.44	3,401,127.48
其中：卖出回购金融资产支出		22,597,576.44	3,401,127.48
6.其他费用	6.4.7.20	169,157.75	142,309.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		409,296,294.13	74,820,321.54
减：所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		409,296,294.13	74,820,321.54

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：民生加银现金宝货币市场基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	14,891,656,560.74	–	14,891,656,560.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	409,296,294.13	409,296,294.13
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)	4,341,875,734.42	–	4,341,875,734.42
其中：1.基金申购款	185,194,830,786.40	–	185,194,830,786.40
2.基金赎回款	-180,852,955,051.98	–	-180,852,955,051.98
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)	–	-409,296,294.13	-409,296,294.13
五、期末所有者权益(基金净值)	19,233,532,295.16	–	19,233,532,295.16
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	653,630,013.50	–	653,630,013.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	74,820,321.54	74,820,321.54
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)	6,640,791,891.30	–	6,640,791,891.30
其中：1.基金申购款	25,824,243,856.21	–	25,824,243,856.21
2.基金赎回款	-19,183,451,964.91	–	-19,183,451,964.91
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)	–	-74,820,321.54	-74,820,321.54
五、期末所有者权益(基金净值)	7,294,421,904.80	–	7,294,421,904.80

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 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银现金宝货币市场基金(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[2013]1244号《关于核准民生加银现金宝货币市场基金募集的批复》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10月18日正式生效，首次设立募集规模为300,033,165.19份基金份额，其中认购资金利息折合12,500.73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法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据，期限在一年以内(含一年)的银行定期存款与大额存单，剩余期限在一年以内(含一年)的中央银行票据与债券回购，剩余期限在397天以内(含397天)的债券，剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、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，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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 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。

6.4.6 税项

1.营业税、企业所得税

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、债券的差价收入，免征营业税。

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

2.个人所得税

个人所得税税率为20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	5,284,905.11
定期存款	10,300,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	8,260,000,000.00
存款期限3个月-1年	2,040,000,000.00
其他存款	–
合计：	10,305,284,905.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日 摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	–	–	–	–
	银行间市场	7,372,467,021.43	7,386,425,500.00	13,958,478.57	0.0726%
	合计	7,372,467,021.43	7,386,425,500.00	13,958,478.57	0.0726%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日 账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	3,012,006,718.00	–
合计	3,012,006,718.00	–

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,815.94
应收定期存款利息	11,130,416.52
应收其他存款利息	–
应收结算备付金利息	–
应收债券利息	116,429,528.03
应收买入返售证券利息	3,772,643.56
应收申购款利息	–
应收黄金合约拆借孳息	–
其他	–
合计	131,334,404.05

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	–
银行间市场应付交易费用	249,595.66
合计	249,595.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	–
应付赎回费	–
预提费用	107,719.55
预收待摊季度申购款利息	1,707,912.26
合计	1,815,631.81

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日 基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,891,656,560.74	14,891,656,560.74
本期申购	185,194,830,786.40	185,194,830,786.40
本期赎回(以"-"号填列)	-180,852,955,051.98	-180,852,955,051.98
- 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	19,233,532,295.16	19,233,532,295.16

注：申购含红利再投份额。

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	–	–	–
本期利润	409,296,294.13	–	409,296,294.13
本期基金份额交易产生的变动数	–	–	–
其中：基金申购款	–	–	–
基金赎回款	–	–	–
本期已分配利润	-409,296,294.13	–	-409,296,294.13
本期末	–	–	–

注：本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每日以红利再投资方式集中支付收益，即按份额面值1.00元转为基金份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	302,681.65
定期存款利息收入	266,132,070.09
其他存款利息收入	–
结算备付金利息收入	–
其他	1,742,348.11
合计	268,177,099.85

注：其他为申购款利息收入。

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

本基金于本期无股票投资收益。

6.4.7.13债券投资收益

6.4.7.13.1债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	8,499,340,540.14
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	8,280,930,333.40
减：应收利息总额	204,056,444.21
买卖债券差价收入	14,353,762.53

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

本基金于本期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金于本期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金于本期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金于本期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	49,588.57
债券帐户维护费	18,000.00
银行费用	56,738.20
其他费用	200.00
合计	169,157.75

6.4.7.21 分部报告

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

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	28,612,158.62	4,475,311.45
其中：支付销售机构的客户维护费	2,722,499.86	–

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0.30%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.30%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2) 于2015年6月30日应付基金管理费为人民币5,184,916.35元(2014年12月31日：人民币4,158,129.34元)。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,629,908.98	1,193,416.37

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0.08%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.08%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2) 于2015年6月30日的应付基金托管费为人民币1,382,644.37元(2014年12月31日：人民币1,108,834.48元)。

6.4.9.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费
民生加银基金公司	23,843,465.67
合计	23,843,465.67
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费
民生加银基金公司	3,729,426.28
合计	3,729,426.28

注：1)基金销售服务费每日计算，按月支付。民生加银现金宝货币市场基金销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费计提的计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

2)于2015年6月30日的应付关联方销售服务费余额为人民币4,320,763.65元；其中，应付民生加银基金公司人民币4,320,763.65元。于2014年12月31日的应付关联方销售服务费余额为人民币3,465,107.79元；其中，应付民生加银基金公司人民币3,465,107.79元。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
	本期 2015年1月1日至2015年6月30日					
中国建设银行	30,283,124.39	–	–	–	9,070,446,900.00	3,151,471.20
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日					
中国建设银行	–	–	–	–	634,662,000.00	255,255.40

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2013年10月18日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	649,294.73	–
期间申购/买入总份额	217,189,344.84	25,109,760.23
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	109,000,000.00	20,000,000.00
期末持有的基金份额	108,838,639.57	5,109,760.23
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.57%	0.07%

注：报告期间申购/买入总份额包括红利再投份额。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,284,905.11	302,681.65	3,510,581.14	54,810.19
中国民生银行	–	–	–	926,978.11

注：本基金的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。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量(单位：份)	总金额
		本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
中国建设银行	41454012	14红豆CP001	余额包销	400,000	40,000,000.00
中国民生银行	41452033	14正泰CP001	余额包销	100,000	10,000,000.00

注：本基金于本期末发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.10 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金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1,571,396,602.90元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011598004	15浙物产SCP004	2015年7月2日	99.99	1,000,000	99,992,136.81
041466031	14冀水泥CP003	2015年7月2日	99.97	1,000,000	99,968,904.16
130333	13进出33	2015年7月2日	100.20	1,000,000	100,196,372.95
140223	14国开23	2015年7月2日	100.12	1,960,000	196,227,932.61
140443	14农发43	2015年7月2日	100.09	490,000	49,042,893.24
150202	15国开02	2015年7月2日	100.59	1,600,000	160,943,018.73
011599380	15江阴公SCP001	2015年7月3日	99.98	500,000	49,988,602.61
041454073	14河钢CP002	2015年7月3日	99.98	500,000	49,990,820.64
041460081	14天业CP003	2015年7月3日	99.99	200,000	19,998,587.60
041460087	14渝江北嘴CP002	2015年7月3日	99.99	500,000	49,995,068.34
041461064	14青投CP002	2015年7月3日	99.99	600,000	59,993,230.32
130235	13国开35	2015年7月3日	99.32	2,700,000	268,164,052.94
140443	14农发43	2015年7月3日	100.09	815,000	81,571,342.84
140444	14农发44	2015年7月3日	100.18	3,000,000	300,545,199.09
合计				15,865,000	1,586,618,162.88

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

2.其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	7,372,467,021.43	35.41
	其中：债券	7,372,467,021.43	35.41
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	3,012,006,718.00	14.47
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	10,305,284,905.11	49.49
4	其他各项资产	131,334,404.05	0.63
5	合计	20,821,093,048.59	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目		占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		8.12
	其中：买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,571,396,602.90	8.17
	其中：买断式回购融资	–	–

注：报告期内回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限????????	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定："本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天"，本报告期内本基金未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	34.72	8.17
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.00	–
2	30天(含)—60天	4.99	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.36	–
3	60天(含)—90天	42.06	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	16.33	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	9.47	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		107.57	8.17

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,983,056,210.24	10.31
	其中：政策性金融债	1,983,056,210.24	10.31
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	5,389,410,811.19	28.02
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	7,372,467,021.43	38.33
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	646,352,260.85	3.36

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	100225	10国开25	3,100,000	309,550,072.77	1.61
2	140444	14农发44	3,000,000	300,545,199.09	1.56
3	071503007	15中信CP007	3,000,000	299,952,422.38	1.56
4	130234	13国开34	2,700,000	268,192,920.82	1.39
5	130235	13国开35	2,700,000	268,164,052.94	1.39
6	071502006	15国泰君安CP006	2,300,000	229,987,234.87	1.20
7	140223	14国开23	2,100,000	210,244,213.51	1.09
8	071503005	15中信CP005	2,000,000	199,989,472.54	1.04
9	011599214	15徐矿SCP001	2,000,000	199,956,601.49	1.04
10	011537006	15中建材SCP006	1,800,000	179,992,837.49	0.94

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.2411%
报告期内偏离度的最低值	0.0444%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1378%

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1基金计价方法的说明

本基金估值采用"摊余成本法"，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即"影子定价"。当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

7.8.2 本基金本报告期内持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券未发生其摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

7.8.3 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。

7.8.4 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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	131,334,404.05
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	131,334,404.05

7.8.5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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
331,363	58,043.69	1,262,814,403.33	6.57%	17,970,717,891.83	93.43%

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	2,336,886.65	0.01%

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10月18日)基金份额总额	300,033,165.19
本报告期期初基金份额总额	14,891,656,560.74
本报告期基金总申购份额	185,194,830,786.40
减：本报告期基金总赎回份额	180,852,955,051.98
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	19,233,532,295.16

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年1月23日，本基金管理人发布公告，解聘俞岱曦先生总经理职务，由公司董事长万青元先生代为履行总经理职务。
2015年2月27日，本基金管理人发布公告，原副总经理朱晓光先生转任公司监事会主席。
2015年6月18日，本基金管理人发布公告，解聘吴剑飞先生副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
平安证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	2	–	–	–	–	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	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
山西证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
申万宏源证券有限公司	1	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东海证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	1	–	–	–	–	–
民生证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国联证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
英大证券有限责任公司	1	–	–	–	–	本报告期新增

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国国际金融股份有限公司	–	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
山西证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
申万宏源证券有限公司	–	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东海证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	–	–	–	–	–	–
民生证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国联证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
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研究报告等，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本基金本期新增华泰证券股份有限公司的深圳交易单元和英大证券有限责任公司的交易单元作为本基金交易单元。本基金本期取消东吴证券股份有限公司的交易单元。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11 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

2015年8月25日