民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

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	民生加银中证内地资源主题指数
基金主代码	690008
交易代码	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	111,716,030.78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、贵重金属与矿石等行业；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	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	24,106,364.04
本期利润	43,498,863.42
加权平均基金份额本期利润	0.2241
本期基金份额净值增长率	22.60%
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	–0.1022
期末基金资产净值	104,217,767.28
期末基金份额净值	0.933

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

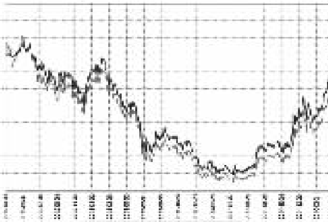
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	–8.08%	3.78%	–5.87%	3.64%	–2.21%	0.14%
过去三个月	9.00%	2.91%	10.24%	2.79%	–1.24%	0.12%
过去六个月	22.60%	2.50%	23.52%	2.46%	–0.92%	0.04%
过去一年	73.42%	2.02%	73.69%	2.00%	–0.27%	0.02%
过去三年	–1.58%	1.63%	–3.39%	1.65%	1.81%	–0.02%
自基金合同生效起至今	–6.70%	1.57%	–12.41%	1.64%	5.71%	–0.07%

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



注：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。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄一明	民生加银品牌蓝筹混合、民生加银中证内地资源主题指数、民生加银城镇化混合、民生加银优选股票的基金经理	2013年5月3日	–	8年	工商管理硕士。自2007年起历任交银施罗德基金公司投资研究部行业研究员，平安大华基金管理公司投资研究部基金经理助理及高级研究员；自2012年5月加盟民生加银基金管理有限公司，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年上半年本基金继续根据申赎情况保持对中证内地资源指数的跟踪，并在六月份根据指数基准基金成分股的变化对组合进行调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为0.933元，本报告期内份额净值增长率为22.60%，同期业绩比较基准收益率为23.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年上半年资源类板块基本跟随上证指数进行波动。展望下半年，我们认为在中国经济逐步企稳，欧美经济复苏、国企改革推进的基础上，资源版块有望继续反弹。

本基金将继续保持对指数基准的跟踪。

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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：民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

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	10,732,090.88	11,729,702.73
结算备付金		–	–
存出保证金		47,465.70	6,813.15
交易性金融资产	6.4.7.2	92,046,067.76	148,237,195.27
其中：股票投资		92,046,067.76	148,237,195.27
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	6.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	6.4.7.4	–	–
应收证券清算款		–	3,683,542.12
应收利息	6.4.7.5	1,538.82	2,920.74
应收股利		–	–
应收申购款		5,090,566.27	178,159.88
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	–	–
资产总计		107,917,729.43	163,838,333.89
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		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		3,069,814.00	1,018,890.52
应付管理人报酬		73,169.61	88,144.59
应付托管费		19,511.90	23,505.24
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	6.4.7.7	207,436.55	48,508.75
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	6.4.7.8	330,030.09	393,634.52
负债合计		3,699,962.15	1,572,683.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	111,716,030.78	213,093,949.25
未分配利润	6.4.7.10	–7,498,263.50	–50,828,298.98
所有者权益合计		104,217,767.28	162,265,650.27
负债和所有者权益总计		107,917,729.43	163,838,333.89

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值人民币0.933元，基金份额总额111,716,030.78份。

6.2 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：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		44,783,020.48	–10,329,636.97
1.利息收入		53,881.81	48,450.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	53,881.81	26,069.70
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		–	22,380.42
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“–”填列）		25,051,850.84	–14,787,762.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,563,465.54	–15,454,639.98
基金投资收益		–	–
债券投资收益	6.4.7.13	–	–
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	488,385.30	666,877.21
3.公允价值变动收益（损失以“–”号填列）	6.4.7.17	19,392,499.38	4,402,025.72
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	284,788.45	7,649.96
减：二、费用		1,284,157.06	890,551.61
1.管理人报酬	6.4.9.2.1	626,384.67	441,269.75
2.托管费	6.4.9.2.2	167,035.92	117,671.95
3.销售服务费		–	–
4.交易费用	6.4.7.19	316,587.68	51,597.86
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用	6.4.7.20	174,148.79	280,012.05
三、利润总额（亏损总额以“–”号填列）		43,498,863.42	–11,220,188.58
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“–”号填列）		43,498,863.42	–11,220,188.58

6.3 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：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）	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（本期净利润）	–	43,498,863.42	43,498,863.42
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）	–101,377,918.47	–168,827.94	–101,546,746.41
其中：1.基金申购款	239,464,396.53	–25,316,044.63	214,148,351.90
2.基金赎回款	–340,842,315.00	25,147,216.69	–315,695,098.31
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）	111,716,030.78	–7,498,263.50	104,217,767.28
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）	236,185,328.16	–98,125,995.79	138,059,332.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	–11,220,188.58	–11,220,188.58
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）	–31,377,625.36	14,729,102.09	–16,648,523.27
其中：1.基金申购款	8,908,465.67	–4,077,928.01	4,830,537.66
2.基金赎回款	–40,286,091.03	18,807,030.10	–21,479,060.93
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）	204,807,702.80	–94,617,082.28	110,190,620.52

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

民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金（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[2011]1540号文《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》的核准，由民生加银基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集，基金合同于2012年3月8日生效。首次设立募集规模为682,579,362.28份基金份额，其中认购资金利息折合101,912.12份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）。

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。本基金的业绩比较基准为：中证内地资源主题指数×95%+活期存款利率（税后）×5%。

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、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。

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

除6.4.5.2所述事项外本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《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》的通知的规定，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

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。

2.营业税、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；

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。

3.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。

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，减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，减按25%计入应纳税所得额。

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。

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	10,732,090.88
定期存款	–
其中：存款期限1-3个月	–
其他存款	–
合计：	10,732,090.88

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		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		80,335,946.15	92,046,067.76	11,710,121.61
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		80,335,946.15	92,046,067.76	11,710,121.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,517.42
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	21.40
合计	1,538.82

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

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	207,436.55
银行间市场应付交易费用	–
合计	207,436.55

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	10,605.73
预提费用	269,424.36
应付指数使用费	50,000.00
合计	330,030.09

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	213,093,949.25	213,093,949.25
本期申购	239,464,396.53	239,464,396.53
本期赎回(以"–"号填列)	–340,842,315.00	–340,842,315.00
– 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	111,716,030.78	111,716,030.78

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	–58,267,470.19	7,439,171.21	–50,828,298.98
本期利润	24,106,364.04	19,392,499.38	43,498,863.42
本期基金份额交易产生的变动数	22,746,711.27	–22,915,539.21	–168,827.94
其中：基金申购款	–57,774,496.53	32,458,451.90	–25,316,044.63
基金赎回款	80,521,207.80	–55,373,991.11	25,147,216.69
本期已分配利润	–	–	–
本期末	–11,414,394.88	3,916,131.38	–7,498,263.50

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	52,930.59
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	726.60
其他	224.62
合计	53,881.81

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	137,829,245.05
减：卖出股票成本总额	113,265,779.51
买卖股票差价收入	24,563,465.54

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	488,385.30
基金投资产生的股利收益	–
合计	488,385.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	19,392,499.38
——股票投资	19,392,499.38
——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	19,392,499.38

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	247,285.89
转换费收入	37,502.56
合计	284,788.45

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	316,587.68
银行间市场交易费用	–
合计	316,587.68

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	19,835.79
信息披露费	49,588.57
银行费用	4,724.43
指数使用费	100,000.00
合计	174,148.79

6.4.7.21 分部报告

截至本报告期末，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
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、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	626,384.67	441,269.75
其中：支付销售机构的客户维护费	144,369.26	59,408.69

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0.75%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.75%/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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

2) 于2015年6月30日，本基金应付基金管理费为人民币73,169.61元（2014年12月31日：人民币88,144.59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	167,035.92	117,671.95

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0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/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，本基金应付基金托管费为人民币19,511.90元（2014年12月31日：人民币23,505.24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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4 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

本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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		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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	10,732,090.88	52,930.59	8,420,652.90	24,340.04

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

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000630	铜陵有色	2015年3月9日	重大事项	10.32	–	–	407,760	3,391,706.08	4,208,083.20	–
600175	美都能源	2015年6月29日	重大事项	10.64	2015年7月20日	9.58	131,600	1,518,186.00	1,400,224.00	–
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大事项	18.53	–	–	83,308	1,376,085.13	1,543,697.24	–
002203	海亮股份	2015年4月27日	重大事项	11.83	–	–	177,534	1,343,547.62	2,100,227.22	–
600395	盘江股份	2015年6月9日	重大事项	15.71	2015年8月19日	14.00	51,692	644,481.97	812,081.32	–
000693	华泽钴镍	2015年6月30日	重大事项	20.57	2015年8月18日	22.63	24,044	612,991.50	494,585.08	–
000519	江南红箭	2015年6月15日	重大事项	26.06	–	–	21,995	310,974.16	573,189.70	–

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，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 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

(1)公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、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2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为80,913,980.00人民币元，划分为第二层次的余额为人民币 11,132,087.76元，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)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，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，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	权益投资	92,046,067.76	85.29
	其中：股票	92,046,067.76	85.29
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	10,732,090.88	9.94
7	其他各项资产	5,139,570.79	4.76
8	合计	107,917,729.43	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	50,944,010.79	48.88
C	制造业	35,199,100.11	33.77
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	1,400,224.00	1.34
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	3,675,547.20	3.53
	合计	91,218,882.10	87.53

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	–	–
C	制造业	827,185.66	0.79
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	827,185.66	0.79

7.3 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

7.3.1 指数投资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

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	1,041,797	7,355,086.82	7.06
2	601899	紫金矿业	1,138,282	5,828,003.84	5.59
3	601857	中国石油	438,835	4,972,000.55	4.77
4	601600	中国铝业	490,962	4,580,675.46	4.40
5	601088	中国神华	216,344	4,510,772.40	4.33
6	600111	北方稀土	241,759	4,385,508.26	4.21
7	000630	铜陵有色	407,760	4,208,083.20	4.04
8	600256	广汇能源	353,418	3,675,547.20	3.53
9	000060	中金岭南	141,454	2,629,629.86	2.52
10	600157	永泰能源	376,629	2,591,207.52	2.49

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600432	吉恩镍业	49,651	827,185.66	0.79

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	4,982,404.06	3.07
2	601088	中国神华	3,278,393.61	2.02
3	601857	中国石油	2,613,888.55	1.61
4	600111	北方稀土	2,281,499.00	1.41
5	600256	广汇能源	1,900,369.30	1.17
6	601600	中国铝业	1,659,637.00	1.02
7	600175	美都能源	1,518,186.00	0.94
8	600219	南山铝业	1,483,943.00	0.91
9	002340	格林美	862,494.31	0.53
10	601899	紫金矿业	829,314.00	0.51
11	000831	五矿稀土	697,340.00	0.43
12	600157	永泰能源	687,574.00	0.42
13	000060	中金岭南	650,986.00	0.40
14	600673	东阳光科	637,352.00	0.39
15	600432	吉恩镍业	629,744.44	0.39
16	600489	中金黄金	629,691.00	0.39
17	600547	山东黄金	626,705.00	0.39
18	600362	江西铜业	618,118.44	0.38
19	601168	西部矿业	597,633.00	0.37
20	000983	西山煤电	562,561.00	0.35

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

7.4.2 累计卖出金额超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	601088	中国神华	13,938,249.49	8.59
2	601857	中国石油	8,057,149.12	4.97
3	600111	北方稀土	7,544,438.41	4.65
4	600028	中国石化	6,345,702.38	3.91
5	600256	广汇能源	5,573,071.81	3.43
6	002340	格林美	5,471,093.76	3.37
7	000060	中金岭南	4,844,123.08	2.99
8	601899	紫金矿业	4,733,992.39	2.92
9	601600	中国铝业	4,515,083.50	2.78
10	600432	吉恩镍业	3,736,728.62	2.30
11	600490	鹏欣资源	3,693,293.61	2.28
12	000960	锡业股份	3,425,932.44	2.11
13	600489	中金黄金	3,269,814.21	2.02
14	000831	五矿稀土	3,222,392.66	1.99
15	601168	西部矿业	2,975,490.32	1.83
16	600547	山东黄金	2,955,298.49	1.82
17	600362	江西铜业	2,725,050.81	1.68
18	600392	盛和资源	2,593,233.30	1.60
19	601898	中煤能源	2,293,684.42	1.41
20	600157	永泰能源	2,255,419.12	1.39

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	37,682,152.62
卖出股票收入（成交）总额	137,829,245.05

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

1.1.1 7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

2015年3月17日中国石油天然气股份有限公司（股票简称“中国石油”，证券代码601857，以下简称“公司”）公告于2015年3月16日接到控股股东中国石油天然气集团公司通知，公司非执行董事、副董事长廖永远先生涉嫌严重违纪违法，正在接受组织调查。本基金投资上述公司证券的决策程序符合相关法律法规的要求。

本基金持有的前十名证券的其余发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,465.70
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,538.82
5	应收申购款	5,090,566.27
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,139,570.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000630	铜陵有色	4,208,083.20	4.04	重大事项

7.12.5.2 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十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,670	23,922.06	9,901.54	0.01%	111,706,129.24	99.99%

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	65,809.80	0.06%

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	0~10
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(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	213,093,949.25
本报告期基金总申购份额	239,464,396.53
减:本报告期基金总赎回份额	340,842,315.00
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	111,716,030.78

§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		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	
申万宏源证券有限公司	1	118,323,541.74	67.42%	107,721.33	67.78%	–
兴业证券股份有限公司	1	23,973,853.15	13.66%	21,826.01	13.73%	–
安信证券股份有限公司	2	15,418,043.51	8.78%	14,036.66	8.83%	–
中银国际证券有限责任公司	2	13,992,256.47	7.97%	12,738.55	8.02%	–
华泰证券股份有限公司	2	3,803,702.80	2.17%	2,605.25	1.64%	本报告期新增深圳交易单元
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国联证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
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	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东海证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	1	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
民生证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国国际金融股份有限公司	2	–	–	–	–	–
英大证券有限责任公司	1	–	–	–	–	本报告期新增深圳交易单元

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

§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