民生加银转债优选债券型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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：2016年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	民生加银转债优选	
基金主代码	000067	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年4月18日	
报告期末基金份额总额	499,446,990.72份	
投资目标	本基金在严格控制基金资产风险、保持资产流动性的基础上，采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略，通过积极主动的投资管理，充分把握可转换债券和普通债券的投资机会，争取实现超过业绩比较基准的投资业绩。	
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对宏观经济环境、市场状况、政策走向等宏观层面信息和个券的微观层面信息进行综合分析，做出投资决策。	
业绩比较基准	60%×中证可转债指数收益率+30%×中证国债指数收益率+10%×沪深300指数收益率	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，一般情况下其预期风险和收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C
下属分级基金的交易代码	000067	000068
报告期末下属分级基金的份额总额	380,606,478.45份	118,840,512.27份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年1月1日 — 2016年3月31日）	
	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C
1. 本期已实现收益	-2,681,781.37	-571,091.79
2. 本期利润	-52,174,469.50	-15,791,487.10
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1370	-0.1972
4. 期末基金资产净值	269,100,778.73	83,814,627.66
5. 期末基金份额净值	0.707	0.705

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

民生加银转债优选A

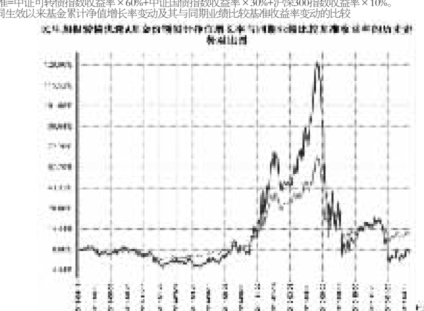
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.23%	1.99%	-5.58%	0.90%	-10.65%	1.09%

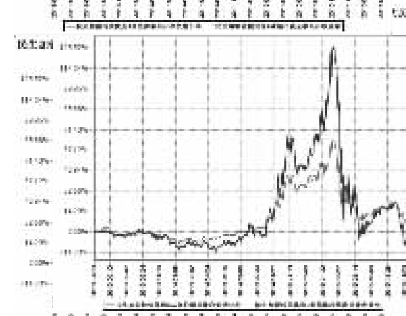
民生加银转债优选C

阶段	净值增长率①	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	-16.27%	1.99%	-5.58%	0.90%	-10.69%	1.09%

注：业绩比较基准=中证可转债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2013年4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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、民生加银转债优选、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、民生加银新收益债券的基金经理；固定收益部总监	2015年6月1日	-	22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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年1季度，经济基本面表现超出市场预期，先是1月份信贷投放量大大超出市场预期，接着是2月份地产销量和一、二线城市房价的快速上行，以及大宗商品价格的暴涨，无不给市场以经济周期回升的预期；监管层摸底基金专户产品的持债规模和质押回购融资情况，再次引发市场对债市去杠杆的担忧；在此氛围下，债券市场特别是长端利率债收益率出现调整；中短期信用债在强大的配置力量下收益率虽整体下行，但违约事件的频繁发生也令收益率的分化继续演绎。权益资产方面，市场在开年即遇到了指数连续下跌熔断的极端行情，后在熔断机制取消，以及注册制和战略新兴板暂缓等一系列政策呵护下震荡反弹，但整个季度下来，上证指数仍有接近 15%的跌幅；转债资产方面，随着新券的大量发行上市，去年一度出现的转债稀缺性溢价大大降低，在正股下跌之外，对转债资产形成雪上加霜的打击。

本基金在1月份股票市场的极端行情下受损失较大，但在随后的市场反弹中由于保持了较高的股票和转债仓位，净值也有所恢复；纯债投资方面，主要策略是自下而上精选个券，通过短久期加杠杆的方式提高短期信用债资产的持仓比例来增强组合的票息收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，本基金A类份额净值为0.707元，本报告期内份额净值增长率为-16.23%，同期业绩比较基准收益率为-5.58%，本基金C类份额净值为0.705元，本报告期内份额净值增长率为-16.27%，同期业绩比较基准收益率-5.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	64,502,744.28	9.76
	其中：股票	64,502,744.28	9.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	543,984,080.24	82.35
	其中：债券	543,984,080.24	82.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	46,500,135.75	7.04
8	其他资产	5,583,040.24	0.85
9	合计	660,570,000.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	14,784,799.78	4.19
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	49,717,944.50	14.09
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	64,502,744.28	18.28

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十名股票投资明细

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	601318	中国平安	900,000	28,629,000.00	8.11
2	601688	华泰证券	799,950	13,687,144.50	3.88
3	600990	四创电子	99,922	7,942,799.78	2.25
4	600699	均胜电子	200,000	6,842,000.00	1.94
5	000728	国元证券	290,000	5,370,800.00	1.52
6	600958	东方证券	100,000	2,031,000.00	0.58

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,006,000.00	5.67
	其中：政策性金融债	20,006,000.00	5.67
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）	523,978,080.24	148.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	543,984,080.24	154.14

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113008	电气转债	1,438,840	170,962,968.80	48.44
2	126018	08江铜债	1,595,320	158,351,463.20	44.87
3	132001	14宝钢EB	712,470	88,089,790.80	24.96
4	128009	歌尔转债	352,087	44,616,464.64	12.64
5	110031	航信转债	222,320	28,866,028.80	8.18

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	37,112.63
2	应收证券清算款	3,152,515.61
3	应收股利	-
4	应收利息	2,015,547.85
5	应收申购款	377,864.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,583,040.24

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113008	电气转债	170,962,968.80	48.44
2	132001	14宝钢EB	88,089,790.80	24.96
3	128009	歌尔转债	44,616,464.64	12.64
4	110031	航信转债	28,866,028.80	8.18
5	110030	格力转债	15,964,000.00	4.52

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C
报告期期初基金份额总额	387,105,206.42	131,238,192.05
报告期期间基金总申购份额	34,582,365.24	132,183,200.40
减：报告期期间基金总赎回份额	41,081,093.21	144,580,880.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	380,606,478.45	118,840,512.27

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内无基金管理人持有本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2016年1月4日，本基金管理人发布了《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》。

2、2016年1月5日，本基金管理人发布了《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》。

3、2016年1月8日，本基金管理人发布了《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》。

4、2016年1月21日，本基金管理人发布了《民生加银转债优选债券型证券投资基金2015年第4季度报告》。

5、2016年1月27日，本基金管理人发布了《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》。

6、2016年1月28日，本基金管理人发布了《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》。

7、2016年3月3日，本基金管理人发布了《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信建投证券股份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》。

8、2016年3月16日，本基金管理人发布了《民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《民生加银转债优选债券型证券投资基金招募说明书》；

9.1.3《民生加银转债优选债券型证券投资基金基金合同》；

9.1.4《民生加银转债优选债券型证券投资基金托管协议》；

9.1.5 法律意见书；

9.1.6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

9.1.7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人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
2016年4月20日

民生加银增强收益债券型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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：2016年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	民生加银增强收益债券	
基金主代码	690002	
交易代码	690002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年7月21日	
报告期末基金份额总额	1,673,207,733.93份	
投资目标	本基金在控制基金资产风险，通常预期风险收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，争取实现超过业绩比较基准的投资业绩。	
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；同时，根据股票一级市场资金供求关系、股票二级市场交易状况、基金的流动性等情况，本基金将积极参与新股发行申购，增发新股申购等权益类资产投资，适当参与股票二级市场投资，以增强基金资产的获利能力。	
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，通常预期风险收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中的较低风险品种	
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	
下属分级基金的基金简称	民生加银增强收益债券A	民生加银增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	690002	690202
报告期末下属分级基金的份额总额	1,375,446,405.52份	297,761,328.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年1月1日 — 2016年3月31日）	
	民生加银增强收益债券A	民生加银增强收益债券C
1. 本期已实现收益	19,751,225.19	4,804,193.47
2. 本期利润	-81,324,460.74	-34,689,707.10
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0606	-0.0873
4. 期末基金资产净值	2,602,724,196.67	547,791,964.85
5. 期末基金份额净值	1.892	1.840

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

民生加银增强收益债券A

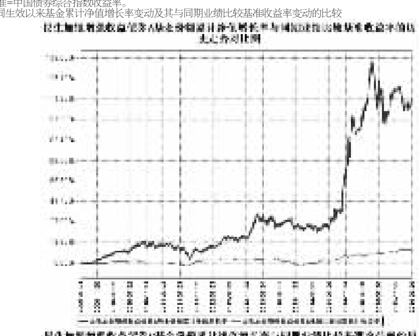
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.37%	0.64%	0.31%	0.07%	-3.68%	0.57%

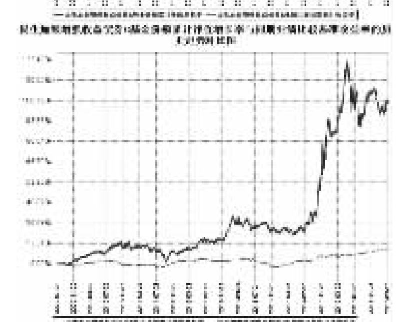
民生加银增强收益债券C

阶段	净值增长率①	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	-3.41%	0.64%	0.31%	0.07%	-3.72%	0.57%

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2009年7月21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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、民生加银转债优选、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、民生加银新收益债券的基金经理；固定收益部总监	2015年6月1日	-	22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。

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行业协会《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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年1季度，经济基本面表现超出市场预期，先是1月份信贷投放量大大超出市场预期，接着是2月份地产销量和一、二线城市房价的快速上行，以及大宗商品价格的暴涨，无不给市场以经济周期回升的预期；监管层摸底基金专户产品的持债规模和质押回购融资情况，再次引发市场对债市去杠杆的担忧；在此氛围下，债券市场特别是长端利率债收益率出现调整；中短期信用债在强大的配置力量下收益率整体下行，但违约事件的频繁发生也令收益率的分化继续演绎。权益资产方面，市场在开年即遇到了指数连续下跌熔断的极端行情，后在熔断机制取消，以及注册制和战略新兴板暂缓等一系列政策呵护下震荡反弹，但整个季度下来，上证指数仍有接近 15%的跌幅。

本基金在1月份股票市场的极端行情下受损失较大，但在随后的市场反弹中由于保持了较高的股票和转债仓位，净值也有所恢复；纯债投资方面，主要策略是自下而上精选个券，通过短久期加杠杆的方式提高短期信用债资产的持仓比例来增强组合的票息收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，本基金A类份额净值为1.892元，本报告期内份额净值增长率为-3.37%，同期业绩比较基准收益率为0.31%；本基金C类份额净值为1.840元，本报告期内份额净值增长率为-3.41%，同期业绩比较基准收益率为0.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	622,776,559.36	17.73
	其中：股票	622,776,559.36	17.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,798,062,938.52	79.66
	其中：债券	2,798,062,938.52	79.66
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,718,131.37	0.33
8	其他资产	79,840,999.76	2.27
9	合计	3,512,398,629.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	288,130,553.93	9.15
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	4,879,824.84	0.15
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	74,668,225.90	2.37
J	金融业	232,266,742.64	7.37
K	房地产业	9,393,212.05	0.30
L	租赁和商务服务业	8,252,400.00	0.26
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	5,185,600.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	622,776,559.36	19.77

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十名股票投资明细

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	601318	中国平安	4,500,000	143,145,000.00	4.54
2	600482	风帆股份	1,944,869	63,986,190.10	2.03
3	300182	捷成股份	3,089,418	55,918,465.80	1.77
4	000728	国元证券	2,535,095	46,949,959.40	1.49
5	600855	航天长峰	1,374,436	42,676,237.80	1.35
6	600699	均胜电子	800,000	27,368,000.00	0.87
7	600271	航天信息	455,898	26,533,263.60	0.84
8	600562	国睿科技	713,000	23,978,190.00	0.76
9	002519	银河电子	1,092,786	20,730,150.42	0.66
10	600816	安信信托	999,912	16,768,524.24	0.53

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	57,242,500.00	1.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	181,458,000.00	5.76
	其中：政策性金融债	181,458,000.00	5.76
4	企业债券	1,820,028,675.50	57.77
5	企业短期融资券	390,467,000.00	12.39
6	中期票据	10,373,000.00	0.33
7	可转债（可交换债）	338,493,763.02	10.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,798,062,938.52	88.81

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	126018	08江铜债	1,705,710	169,308,774.60	5.37
2	113008	电气转债	1,174,270	139,526,761.40	4.43
3	122284	13鲁金02	1,300,000	138,866,000.00	4.41
4	130228	13国开28	1,000,000	100,450,000.00	3.19
5	011534008	15东航股SCP008	1,000,000	100,150,000.00	3.18

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	200,116.97
2	应收证券清算款	21,881,810.15
3	应收股利	-
4	应收利息	37,449,220.36
5	应收申购款	20,309,852.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,840,999.76

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113008	电气转债	139,526,761.40	4.43
2	128009	歌尔转债	87,749,291.52	2.79
3	132001	14宝钢EB	48,907,038.40	1.55
4	110030	格力转债	27,300,896.00	0.87

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	26,533,263.60	0.84	重大事项

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银增强收益债券A	民生加银增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	1,259,893,871.74	517,583,320.47
报告期期间基金总申购份额	187,067,083.90	47,412,815.47
减：报告期期间基金总赎回份额	71,514,550.12	267,234,807.53
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,375,446,405.52	297,761,328.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8,540,751.59
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,540,751.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.51

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期末运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2016年1月4日，本基金管理人发布了《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》。

2、2016年1月5日，本基金管理人发布了《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》。

3、2016年1月5日，本基金管理人发布了《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》。

4、2016年1月8日，本基金管理人发布了《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》。

5、2016年1月21日，本基金管理人发布了《民生加银增强收益债券型证券投资基金2015年第4季度报告》。

6、2016年1月27日，本基金管理人发布了《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》。

7、2016年1月28日，本基金管理人发布了《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》。

8、2016年2月26日，本基金管理人发布了《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》。

9、2016年3月4日，本基金管理人发布了《民生加银增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要（2016年第1号）》。

10、2016年3月16日，本基金管理人发布了《民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《民生加银增强收益债券型证券投资基金招募说明书》；

9.1.3《民生加银增强收益债券型证券投资基金基金合同》；

9.1.4《民生加银增强收益债券型证券投资基金托管协议》；

9.1.5 法律意见书；

9.1.6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

9.1.7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人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
2016年4月20日

民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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：2016年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	102,131,472.44份
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份股编制而成，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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年1月1日 — 2016年3月31日）
1.本期已实现收益	-1,529,491.63
2.本期利润	-5,136,840.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0512
4.期末基金资产净值	65,654,892.17
5.期末基金份额净值	0.643

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-8.27%	2.93%	-8.68%	2.98%	0.41%	-0.05%

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%

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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、民生加银城镇化混合、民生加银优选股票的基金经理	2013年5月3日	2016年1月4日	9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。
蔡晓	本基金的基金经理；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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年1季度中证内地资源指数先跌后涨。1月份伴随市场受熔断机制影响而下跌，2月份开始，受益于美元加息节奏放缓、美元指数震荡回落、资源价格稳步回暖而持续震荡上行。

投资运作上我们继续根据申赎情况保持对中证内地资源指数进行跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，本基金份额净值为0.643元，本报告期内份额净值增长率为-8.27%，同期业绩比较基准收益率为-8.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	62,308,669.57	93.70
	其中：股票	62,308,669.57	93.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,098,026.99	6.16
8	其他资产	91,022.44	0.14
9	合计	66,497,719.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	39,729,856.90	60.51
C	制造业	21,922,838.47	33.39
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	655,974.20	1.00
	合计	62,308,669.57	94.90

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	600028	中国石化	1,033,688	4,920,354.88	7.49
2	601857	中国石油	460,606	3,505,211.66	5.34
3	600111	北方稀土	258,418	3,276,740.24	4.99
4	601088	中国神华	228,657	3,214,917.42	4.90
5	601899	紫金矿业	879,383	2,875,582.41	4.38
6	601600	中国铝业	532,225	2,336,467.75	3.56
7	600547	山东黄金	72,888	1,916,225.52	2.92
8	000060	中金岭南	164,982	1,842,848.94	2.81
9	600497	驰宏锌锗	160,700	1,795,019.00	2.73
10	600219	南山铝业	241,526	1,676,190.44	2.55

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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发行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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,296.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	963.65
5	应收申购款	86,762.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,022.44

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	91,646,872.18
报告期期间基金总申购份额	41,086,372.00
减：报告期期间基金总赎回份额	30,601,771.74
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	102,131,472.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内无基金管理人持有本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2016年1月4日，本基金管理人发布了《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》。

2、2016年1月5日，本基金管理人发布了《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》。

3、2016年1月5日，本基金管理人发布了《民生加银基金管理有限公司基金经理变更公告》。

4、2016年1月8日，本基金管理人发布了《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》。

5、2016年1月12日，本基金管理人发布了《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》。

6、2016年1月21日，本基金管理人发布了《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》。

7、2016年1月28日，本基金管理人发布了《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》。

8、2016年3月8日，本基金管理人发布了《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》。

9、2016年3月16日，本基金管理人发布了《民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《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》；

9.1.3《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》；

9.1.4《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》；

9.1.5法律意见书；

9.1.6基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。

9.1.7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人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
2016年4月20日