

民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月27日

1.1 重要提示

基金管理人董事会、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2019年3月26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。

毕马威华振会计师事务所 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。

本报告期间自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

1.2 基金简介

| | |
|---------|--------------|
| 基金名称 | 民生加银策略精选混合 |
| 基金代码 | 000300 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年6月17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 |
| 基金合同期限 | 不定期 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 争取实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下资产配置与自下而上个股精选相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金根据对宏观经济、政策环境、市场估值、行业景气度等因素的综合分析,动态调整股票、债券、货币资产等大类资产的配置比例。在个股选择方面,本基金采取自下而上的策略,重点挖掘具有良好成长性的个股。同时,本基金还将根据市场估值水平,适时调整仓位,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+中国国债综合收益率(半年)×40% |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的混合型基金,属于证券投资基金中风险收益特征较高的品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人及基金托管人

| 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 |
| 法定代表人 | 王卫 | 王洪章 |
| 注册地址 | 中国(上海)自由贸易试验区民生路1199号2幢201室 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | 中国(上海)自由贸易试验区民生路1199号2幢201室 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 电话 | 021-20699000 | 010-67596383 |

2.4 信息披露方式

| | |
|-----------------|----------------------------|
| 基金年度报告全文的上网查询地址 | http://www.minghuafund.com |
| 基金管理人网站投资人服务信箱 | investor@minghuafund.com |

注:2019年1月23日,基金管理人已发布《关于旗下公开募集证券投资基金调整信息披露的公告》,明确本公司旗下各公开募集证券投资基金的信息披露载体。

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

| 项目 | 2018年 | 2017年 | 2016年 |
|----------------|-----------------|----------------|------------------|
| 3.1.1 期初基金份额总额 | 104,328,355.03 | 79,497,300.71 | -27,074,316.43 |
| 本期申购 | -110,263,269.71 | 100,722,026.04 | -64,182,149.41 |
| 本期赎回(含基金转换转出) | -4,333.02 | 0.292 | -0.611 |
| 本期基金份额净增加额 | -104,277.70 | 11,727.01 | -64,833.04 |
| 3.1.2 期末基金份额总额 | 201,050.33 | 91,217.78 | 201,050.33 |
| 期末基金份额持有人户数 | 0.482 | 0.788 | 0.074 |
| 期末基金份额持有人户数 | 512,315,466.03 | 762,307,448.29 | 1,162,277,668.34 |
| 期末基金份额持有人户数 | 1,907 | 2,220 | 2,333 |

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可能会低于所列数字。

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的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孰低者,表中“期末”指报告期末最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

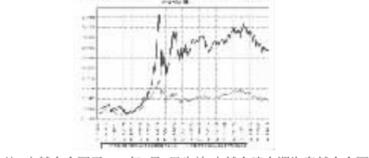
3.2 基金净值表现

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 | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 差额 |
|-------|-----------|-----------|---------|
| 过去三个月 | -5.00% | 3.02% | -8.02% |
| 过去六个月 | -11.47% | 1.02% | -12.49% |
| 过去一年 | -14.79% | 1.00% | -15.79% |
| 过去三年 | -13.51% | 1.38% | -14.89% |
| 过去五年 | 13.31% | 5.63% | 7.68% |
| 成立以来 | 122.19% | 1.66% | 120.53% |

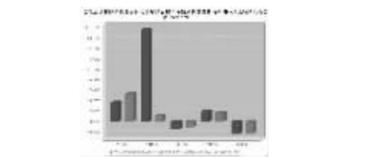
注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中国国债综合收益率(半年)×40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2013年6月17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 过去五年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



注:本基金合同于2013年6月17日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按自然年度进行计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每10份基金份额现金红利 | 每10份基金份额分红金额 | 分红次数 | 备注 |
|------|--------------|---------------|------|----|
| 2018 | - | - | - | 无 |
| 2017 | 0.017 | 87,877,782.27 | 47 | 无 |
| 2016 | - | - | - | 无 |
| 合计 | 0.017 | 87,877,782.27 | 47 | 无 |

4 基金管理人及基金托管人

4.1 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”)是由中国建设银行股份有限公司、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日在深圳市正式成立,2012年注册资本增加至3亿元人民币。

截至2018年12月31日,民生加银基金管理有限公司管理44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、民生加银信用双债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、民生加银稳利定期开放债券型证券投资基金、民生加银增利货币市场基金、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、民生加银新动力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、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国红利配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源纯债债券型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源货币型证券投资基金、民生加银新前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银

4.2 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”)是由中国建设银行股份有限公司、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日在深圳市正式成立,2012年注册资本增加至3亿元人民币。

截至2018年12月31日,民生加银基金管理有限公司管理44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、民生加银信用双债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、民生加银稳利定期开放债券型证券投资基金、民生加银增利货币市场基金、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、民生加银新动力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、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国红利配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源纯债债券型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源货币型证券投资基金、民生加银新前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银

4.3 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”)是由中国建设银行股份有限公司、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日在深圳市正式成立,2012年注册资本增加至3亿元人民币。

截至2018年12月31日,民生加银基金管理有限公司管理44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、民生加银信用双债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、民生加银稳利定期开放债券型证券投资基金、民生加银增利货币市场基金、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、民生加银新动力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、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国红利配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源纯债债券型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源货币型证券投资基金、民生加银新前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银

4.4 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”)是由中国建设银行股份有限公司、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日在深圳市正式成立,2012年注册资本增加至3亿元人民币。

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、民生加银信用双债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、民生加银稳利定期开放债券型证券投资基金、民生加银增利货币市场基金、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、民生加银新动力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、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国红利配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源纯债债券型证券投资基金、民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫源货币型证券投资基金、民生加银新前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银

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 | 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-------|-----------|------|--------|---|
| 王卫 | 基金管理人 | 2014年7月7日 | - | 7年 | 2008年12月,王卫管理民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银增强收益债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银精选混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银稳健成长混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银内需增长混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银景气行业混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银信用双债债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银稳利定期开放债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银增利货币市场基金,2014年7月,王卫管理民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银家盈理财7天债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银转债优选债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银家盈理财月度债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银量化中国红利配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银鑫源纯债债券型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银鑫源灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银鑫源货币型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银新前沿科技灵活配置混合型证券投资基金,2014年7月,王卫管理民生加银 |

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 管理人对外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 管理人对外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,公司采用了交易系统集中的公平交易程序,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由公司统一进行的操作,各投资组合经理在交易前独立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口(日内、3日内、5日内)不同投资组合间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的贯彻执行,未发现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,不存在有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对外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

2018年基金始终保持独立策略,精选个股的格局,做好以下两个方面的工作:一是专注于具有长期成长潜力的战略性行业,充分挖掘其中的优秀成长性公司;二是围绕价值投资的理念,通过产业链分析、业绩与估值评测等手段把握投资机会。

基金坚持成长股,秉承科技为王、消费为辅的投资理念,2018年主要投资了计算机、电子、新能源行业,出行相关的机场资源方向,1季度基金净值实现了正收益,但随着中美贸易摩擦的不断加剧,净值跟随市场调整,及时调整仓位,造成基金净值回撤。下半年,进行了一定的减仓,净值有所下跌,但相比上证指数、中小板指数、创业板指数的跌幅,由于仓位较低,基金净值回撤较小。

4.4.2 报告期内本基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.907元;本报告期基金份额净值增长率为-14.79%,业绩比较基准收益率为-13.83%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观经济下行压力下,资本市场整体流动性水平有所下降,一定程度上抑制了资本市场的表现。但考虑到货币政策相对比较宽松,2019年市场比2018年可能会好一些,将告别2018年单边下行市场,2019年迎来震荡市,结构性机会显现,表现在科技、医药等领域,但也需要降低收益预期。很多股票经过2018年下跌后,估值具有较好的吸引力,如果企业经营层面比较好的话,将是未来几年比较好的布局机会,可以慢慢布局建仓。

同时,随着科创板的推出,科技行业将迎来较好的融资环境,经营环境、市场的交易制度也会不同,我们将对科技股表现持积极乐观的观点。

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,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 管理人对外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相关会计准则、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。本基金托管人根据相关法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人为了确保估值工作的顺利开展,已通过行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构估值数据等方式,谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括运营部的公司领导、督察长、投资总监、运营管理部、交易部、研究部、风控部、固定收益部、监察稽核部、风险管理部等部门负责人及其指定的相关人员,研究部担任估值小组组长,基金经理及相关业务人员负责。分管运营的公司领导任估值小组组长,基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对外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,本基金管理人承诺不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对外本基金持有人数或基金资产净值预警情况的说明

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

本报告期内,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关损害基金份额持有人利益的行为。

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。

5.4 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|-------------|------------------|
| 财务报表编制及审计机构 | 毕马威 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告文号 | 毕马威华振审字第1801133号 |

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题:民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金的持有人,应当在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内修改基金合同并一致,并报监管机构备案,民生加银基金管理有限公司对本基金的基金合同进行了修改,修改后的基金合同已于2018年3月23日生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中国国债综合收益率(全价)×40%。

7.1 资产负债表

会计主体:民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

| 资产 | 期末数 | 本期末 | 上年度末 |
|-----------|--------|----------------|----------------|
| | | 2018年12月31日 | 2017年12月31日 |
| 货币资金 | 74,713 | 131,472,296.29 | 63,762,948.03 |
| 结算备付金 | - | 107,707,303.31 | 4,077,475.19 |
| 应收利息 | - | 798,725.97 | - |
| 交易性金融资产 | 74,713 | 213,506,328.98 | 678,063,674.41 |
| 其中:股票 | - | 189,494,042.48 | 528,751,131.19 |
| 债券 | - | 24,012,286.50 | - |
| 资产支持证券 | - | 32,011,466.00 | 60,310,289.30 |
| 贵金属 | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - |
| 应收款项类金融资产 | - | 180,000,000.00 | 99,378,269.06 |
| 其他资产 | - | 10,160,642.28 | 2,381,465.96 |
| 资产总计 | 74,713 | 536,358,054.55 | 745,602,382.95 |
| 负债 | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - |
| 应付股利 | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - |
| 应付债券 | - | - | - |
| 其他金融负债 | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - |
| 所有者权益 | - | - | - |
| 实收基金 | 74,713 | 269,181,164.49 | 339,434,226.74 |
| 未分配利润 | - | 267,176,890.06 | 406,168,156.21 |
| 所有者权益合计 | 74,713 | 536,358,054.55 | 745,602,382.95 |

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值人民币1.907元,基金份额总额268,881,924.45份。

7.2 利润表

会计主体:民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

| 项目 | 本期 | 上年度 |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| 一、营业收入 | 1,182,366.80 | 127,644,080.51 |
| 1.利息收入 | 7,786,078.88 | 6,778,078.00 |
| 2.公允价值变动收益 | 1,174,909.92 | 1,689,316.93 |
| 3.其他业务收入 | 2,009,110.29 | 2,300,962.30 |
| 4.其他公允价值变动收益 | - | - |
| 5.其他业务收入 | 4,499,966.04 | 1,794,174.43 |
| 6.其他业务收入 | - | - |
| 7.其他业务收入 | - | - |
| 8.其他业务收入 | - | - |
| 9.其他业务收入 | - | - |
| 10.其他业务收入 | - | - |
| 11.其他业务收入 | | |