

(上接B114版)

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	1,784,173.08	1,565,228.76
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中:申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,784,173.08	1,565,228.76

7.4.7.2 其他费用

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	30,000.00	40,200.00
信息披露费	90,000.00	90,000.00
销售账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	9,113.31	6,138.21
合计	147,113.31	156,138.21

7.4.7.2.1 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。

7.4.8 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(“中国民生银行”)	基金托管人、基金销售机构
民生加银银行股份有限公司(“中国民生银行”)	基金管理人、基金销售机构
民生加银资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
民生加银资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

注:以下关联交易均在正常业务范围按一般商业条款订立。  
7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易  
7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易  
7.4.9.1.1 股票交易  
注: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。  
7.4.9.1.2 债券交易  
注: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债券交易。  
7.4.9.1.3 债券回购交易  
注: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债券回购交易。  
7.4.9.1.4 权证交易  
注: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。  
7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金  
注:本基金于本期末及上年度末均无支付关联方的佣金。  
7.4.9.2 关联方报酬  
7.4.9.2.1 基金管理费

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的基金管理费	1,524,688.64	1,881,563.12
其中:支付销售机构的佣金	188,408.66	238,361.54

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础资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:  
 $H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$   
H为每日应支付的基金管理费  
E为前一日的基础资产净值  
2) 于2018年12月31日的应付基金管理费为人民币110,628.96元。(2017年12月31日:人民币149,872.56元)  
7.4.9.2.2 基金托管费

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	264,114.94	313,592.28

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础资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:  
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$   
H为每日应支付的基金托管费  
E为前一日的基础资产净值  
2) 于2018年12月31日的应付基金托管费为人民币18,421.51元。(2017年12月31日:人民币24,978.78元)  
7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
注: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。  
7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况  
7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
注:本基金于本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,于本期末及上年度末亦未持有本基金份额。  
7.4.9.4.2 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  
注: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。  
7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
中国建设银行	26,562,390.75	150,234.82
民生银行	150,234.82	198,962.27
合计	26,712,625.57	249,197.09

注:本基金的活期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。  
7.4.9.6 本基金在承销期内参与与关联方承销证券的情况  
注:本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与与关联方承销证券。  
7.4.9.7 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。  
7.4.10 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券  
7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券  
注: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。  
7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票简称	停牌日期	期末公允价值	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末公允价值	备注
60030	中信证券	2018年12月26日	1601	2019年1月10日	17.15	149,400	2,562,543.17	2,291,894.00	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券  
7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2018年12月31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。  
7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末2018年12月31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。  
7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
7.4.11.1 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。  
7.4.11.2 其他事项  
(1)公允价值  
本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、其他应收款项类投资以及其他金融负债,因利率期限不同,公允价值与账面价值相若。  
各层次金融工具公允价值  
于2018年12月31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人民币66,201,875.85元,划分为第二层次的余额为人民币3,391,894.00元,无划分为第三层次余额。于2017年12月31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人民币79,967,996.11元,划分为第二层次的余额为人民币6,379,113.11元,无划分为第三层次余额。  
(2)公允价值所属层次重大变动  
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,本基金本报告期未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。  
§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,503,769.05	66.56
2	其中:股票	57,503,769.05	66.56
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	26,280,956.01	30.35
11	其他负债	2,669,568.43	3.09
12	合计	86,124,323.28	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金总资产的比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	3,812,613.76	4.43
C	金融业	31,662,574.50	37.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,012,037.00	2.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,217,377.00	3.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,819,132.60	8.03
J	金融业	2,391,894.00	2.82
K	房地产业	2,717,862.00	3.20
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	卫生健康工作	3,467,926.00	4.07
R	文化、体育和娱乐业	1,481,944.00	1.74
S	综合	-	-
合计		57,503,769.05	67.79

8.3 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

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	000001	万科A	114,400	4,082,330.00	4.01
2	600519	贵州茅台	5,900	3,481,050.00	4.10
3	002044	美年健康	231,300	3,467,926.00	4.07
4	602288	海天味业	46,200	3,178,560.00	3.74
5	000002	万科A	114,100	2,717,862.00	3.20
6	300222	润明科技	271,100	2,586,294.00	3.04
7	600887	伊利股份	112,000	2,583,152.00	3.04
8	002449	国星光电	244,600	2,538,948.00	2.99
9	600276	恒顺醋业	46,400	2,394,850.00	2.82
10	600030	中信证券	149,400	2,391,394.00	2.82

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。  
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动  
8.4.1 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

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	000002	万科A	13,577,948.82	11.60
2	600048	保利地产	12,584,768.32	10.66
3	000565	海康光电	12,156,523.00	10.30
4	600028	中国石化	10,794,786.00	9.14
5	000061	格力电器	10,784,740.00	9.07
6	300373	德高股份	10,513,900.00	8.91
7	601061	中国太保	10,222,196.00	8.66
8	600030	中信证券	10,092,584.76	8.56
9	601877	正泰电器	9,526,760.89	8.07
10	300188	美亚光电	9,311,862.72	7.89
11	001979	拓尔微	9,306,985.61	7.88
12	000788	中航飞机	9,288,527.49	7.87
13	000533	美的集团	9,036,002.00	7.65
14	002044	美年健康	6,754,397.76	5.74
15	601318	中国平安	6,351,626.00	5.39
16	602986	高昌新材	6,233,036.75	5.27
17	600754	锦江股份	6,232,567.00	5.27
18	600519	贵州茅台	6,208,938.72	5.26
19	601088	中国神华	7,994,242.00	6.77
20	603889	口子窖	7,994,056.00	6.77
21	600887	通化东宝	7,788,516.69	6.60
22	600036	招商证券	7,741,403.00	6.56
23	002508	雅克科技	7,681,734.00	6.51
24	000887	伊利股份	7,655,006.00	6.48
25	601088	中国神华	7,449,220.00	6.30
26	200569	东方财富	7,194,624.44	6.09
27	300036	招商银行	7,139,896.00	6.05
28	600036	招商银行	7,139,896.00	6.03
29	601233	桐昆股份	7,113,268.34	6.03
30	000663	华东医药	6,900,201.00	5.86
31	000826	广生堂	6,777,468.24	5.74
32	000826	广生堂	6,696,547.00	5.67
33	000498	蓝帆医疗	6,562,010.00	5.56
34	002179	中航光电	6,297,203.84	5.30
35	600872	中微光电	5,986,120.27	5.07
36	002447	山东黄金	5,938,672.29	5.03
37	600309	万华化学	5,884,522.63	4.97
38	002036	华帝股份	5,866,271.86	4.96
39	300017	网宿科技	5,855,763.84	4.96
40	000889	山西汾酒	5,568,101.81	4.74
41	003288	海天味业	5,569,456.64	4.72
42	002456	欧科软件	5,499,933.00	4.66
43	000196	夏新电子	5,493,014.64	4.65
44	000779	水井坊	5,376,096.00	4.56
45	300083	欧派家居	5,263,090.00	4.46
46	001887	中国广核	5,093,774.00	4.31
47	000036	招商银行	4,832,605.00	4.08
48	300124	汇川技术	4,800,482.00	4.06
49	000661	长春高新	4,606,880.00	3.90
50	000418	小天鹅A	4,606,878.92	3.90
51	002832	顺丰控股	4,570,018.00	3.87
52	600782	新钢股份	4,537,228.00	3.84
53	000741	华远汽车	4,464,850.00	3.78
54	002044	美年健康	4,447,366.00	3.77
55	002476	立讯精密	4,378,125.00	3.71
56	002599	顺光文具	4,339,492.96	3.66
57	002912	中顺洁纳	4,312,292.20	3.65
58	600286	安捷股份	4,179,136.00	3.54
59	001225	陕西煤业	4,167,045.00	3.53
60	002410	广联达	4,164,158.00	3.53
61	000670	恒生电子	4,139,167.00	3.51
62	601186	中国铁建	4,119,611.00	3.49
63	002916	浙报传媒	4,066,840.00	3.46
64	600860	张江高科	4,046,010.00	3.43
65	600276	恒顺醋业	4,039,648.00	3.42
66	000019	宝通股份	4,027,802.00	3.41
67	002027	分众传媒	3,922,739.99	3.32
68	000741	华远汽车	3,706,662.00	3.14
69	004339	明亚保险	3,466,569.00	2.93
70	600846	宝信软件	3,370,580.00	2.86
71	002185	华天科技	3,368,803.40	2.85
72	300461	创业慧康	3,276,000.00	2.77
73	601698	中国神华	3,153,363.00	2.68
74	002271	北方华创	3,145,006.00	2.67
75	002483	聚源股份	3,108,762.18	2.63
76	600517	翰宇药业	3,105,156.00	2.63
77	000703	三安光电	3,008,768.00	2.55
78	000568	泸州老窖	2,993,680.00	2.54
79	300271	华宇软件	2,967,269.90	2.51
80	300251	光线传媒	2,946,782.00	2.50
81	600666	济川药业	2,670,442.80	2.26
82	300750	宁德时代	2,664,747.10	2.26
83	600104	上汽集团	2,657,823.00	2.25
84	300222	润明科技	2,513,623.00	2.14
85	002449	国星光电	2,504,141.00	2.14
86	300383	光新股份	2,494,002.00	2.11
87	002110	三联虹润	2,472,723.96	2.09
88	300263	卫宁健康	2,391,661.04	2.03
89	601336	新华保险	2,385,937.00	2.02
90	001228	航天泵业	2,381,468.00	2.02

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。

8.4.2 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

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	600048	保利地产	16,382,922.78	13.89
2	600565	海康光电	15,363,481.48	13.01
3	300002	万科A	13,066,646.32	11.07
4	300373	德高股份	12,893,430.73	10.91
5	600887	通化东宝	11,239,059.75	9.52
6	600028	中国石化	10,243,041.70	8.68
7	601877	正泰电器	9,806,886.11	8.31
8	600519	贵州茅台	9,711,229.17	8.23
9	603986	孔翔创新	9,708,967.67	8.22
10	601601	中国太保	9,692,814.52	8.21
11	001979	拓尔微	9,387,743.16	7.95
12	000651	格力电器	9,266,351.47	7.85
13	000788	中航飞机	9,144,613.76	7.75
14	000963	华东医药	9,093,584.51	7.70
15	300188	美亚光电	8,846,424.86	7