

(上接B116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
当期发生的利息收益	236,185.70	409,234.28
基金资产产生的股利收益	—	—
合计	236,185.70	409,234.28

7.4.7.17 公允价值变动收益

项目名称	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
1.交易性金融资产	-1,138,467.94	2,750,191.36
—股票投资	-1,138,467.94	2,750,191.36
—债券投资	—	—
—资产支持证券投资	—	—
—其他	—	—
2.衍生工具	—	—
—权证投资	—	—
3.其他	—	—
减:应融金融资产公允价值变动产生的利得/损失	—	—
合计	-1,138,467.94	2,750,191.36

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回收入	19,640.94	9,202.70
转换费收入	1,695.59	876.01
合计	21,344.53	10,078.71

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	970,542.41	1,481,270.52
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	970,542.41	1,481,270.52

7.4.7.20 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	30,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
债券账户管理费	36,000.00	36,000.00
银行管理费	7,346.08	6,196.15
合计	173,346.08	172,196.15

7.4.7.21 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。

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”)	基金管理人,注册登记机构,基金销售机构,发起人(中国建设银行)
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
加银基金(香港)有限公司	基金管理人的股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的股东,发起人
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内在一般商业条款订立。
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。

7.4.9.1.4 基金交易
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:本基金于本期及上年度均未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	606,412.14	1,006,664.73
其中:支付销售机构的佣金/手续费	83,127.46	136,358.62

注:1) 基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
 $H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值

2) 于2018年12月31日的应付基金管理费为人民币44,384.84元。
(2017年12月31日:人民币65,966.27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	100,902.00	167,610.78

注:1) 基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
 $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日基金资产净值

2) 于2018年12月31日的应付基金托管费为人民币7,397.47元。
(2017年12月31日:人民币10,994.34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	6,403,133.27	46,508.97
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

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金矿业	2019年1月22日	2019年3月13日	新股发行	3.14	3.14	1,000	3,140.00	3,140.00	

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
注:本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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14,992,683.55元,划分为第二层次的余额为人民币3,140,000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32,363,734.03元,划分为第二层次的余额为人民币5,111,143.96元,无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间的重大变动
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。

第三层次公允价值计量数据和期末变动金额
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,本基金本报告期末未持有第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 截至资产负债表日,本基金的资产净值为人民币34,454,802.82元,已连续超过20个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。

(3) 除上述事项外,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	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	14,096,823.56	43.14
	其中:股票	14,096,823.56	43.14
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	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	13,000,000.00	37.40
	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	6,701,812.20	19.28
8	其他各项资产	64,033.65	0.18
9	合计	34,761,669.40	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	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	—	—
B	医药生物	891,625.00	2.23
C	制造业	3,591,152.40	10.42
D	电力、热力、燃气及生产供应	1,422,280.98	4.13
E	建筑业	973,701.93	2.83
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	1,046,320.00	3.04
J	金融业	1,626,602.60	4.72
K	房地产业	4,112,471.36	11.84
L	租赁和商业服务业	—	—
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	1,073,410.00	3.12
R	文化、体育和娱乐业	347,260.20	1.01
S	综合	—	—
合计		14,996,823.56	43.12

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	600011	华能国际	102,721	1,422,280.98	4.13
2	600048	保利地产	96,650	1,138,972.56	3.31
3	002044	美年健康	71,800	1,073,410.00	3.12
4	000061	南方航空	100,277	1,067,453.07	3.10
5	300454	蓝盾医疗	11,700	1,046,320.00	3.04
6	002916	欧陆集团	12,400	894,108.00	2.89
7	601386	工商银行	168,300	837,407.00	2.43
8	600647	山东黄金	26,500	801,625.00	2.33
9	600036	招商银行	31,153	785,056.60	2.28
10	000002	万科A	31,792	767,285.44	2.20

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

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	603799	华友钴业	9,494,277.42	19.11
2	600686	海康威视	8,777,028.31	17.67
3	600011	华能国际	6,542,947.56	13.17
4	601888	华泰证券	6,034,961.00	12.06
5	300059	东方财富	6,005,361.04	12.09
6	600392	盛和资源	5,768,983.31	11.61
7	002902	嘉康药业	5,333,817.00	11.34
8	601398	工商银行	4,176,030.00	8.41
9	000792	新钢股份	5,210,722.00	10.51
10	300054	蓝盾医疗	5,110,480.00	10.29
11	002035	华邦股份	4,222,214.42	8.71
12	600083	新华水电	4,643,032.48	9.35
13	600027	华信国际	4,621,677.06	9.30
14	600670	恒生电子	4,587,372.00	9.24
15	000002	万科A	4,533,367.00	9.13
16	600048	保利地产	4,464,437.00	8.97
17	601868	中国建筑	4,426,620.00	8.91
18	601386	工商银行	4,317,510.02	8.89
19	600519	贵州茅台	4,317,200.28	8.89
20	600036	招商银行	4,282,456.00	8.64
21	601318	中国平安	4,262,741.00	8.58
22	600021	三一重工	4,176,030.00	8.41
23	601869	招商银行	4,068,210.00	8.23
24	600271	航天信息	3,988,926.00	8.03
25	002110	三钢闽光	3,655,210.00	7.36
26	002898	兆阳创新	3,414,080.00	6.87
27	600669	安钢钢铁	3,405,923.00	6.86
28	601899	紫金矿业	3,404,700.00	6.86
29	600256	广晟有色	3,397,037.00	6.84
30	300073	当升科技	3,286,668.43	6.64
31	000425	徐工机械	3,096,668.00	6.23
32	600547	山东黄金	3,088,320.00	6.06
33	300286	利达德	2,894,022.00	6.03
34	600362	江西铜业	2,867,762.00	6.02
35	300747	锐科激光	2,862,964.28	6.01
36	200766	财信证券	2,874,637.00	5.89
37	002352	盛药医疗	2,867,480.00	5.83
38	600271	航天信息	2,868,926.00	5.83
39	300054	蓝盾医疗	2,862,611.00	5.84
40	002271	北方华创	2,765,120.00	5.56
41	002044	美年健康	2,749,582.42	5.54
42	000963	华东医药	2,738,810.91	5.51
43	002916	欧陆集团	2,717,801.00	5.47
44	000639	西王食品	2,543,026.00	5.12
45	300070	碧水源	2,503,802.00	5.04
46	300618	聚威股份	2,459,618.00	4.95
47	600702	奇伟股份	2,428,110.00	4.89
48	600717	新钢股份	2,380,016.00	4.81
49	600340	华鲁恒升	2,320,050.00	4.67
50	000038	顺发股份	2,279,590.00	4.59
51	002179	中航光电	2,273,607.00	4.59
52	002466	欧陆集团	2,260,480.00	4.53
53	002241	新松科技	2,240,820.00	4.51
54	601223	福耀玻璃	2,204,080.00	4.44
55	002898	兆阳创新	2,204,020.00	4.44
56	600779	华开股份	2,159,587.69	4.36
57	300451	创业慧康	2,154,404.00	4.34
58	300306	超图软件	2,076,582.08	4.18
59	002352	盛药医疗	2,027,686.00	4.08
60	600029	南方航空	2,025,291.00	4.08
61	002146	荣盛发展	1,966,306.18	4.02
62	002027	分众传媒	1,922,872.40	3.97
63	601081	中国神华	1,945,502.00	3.92
64	002220	科大讯飞	1,824,851.00	3.88
65	000661	格力电器	1,812,867.00	3.85
66	000898	五矿资本	1,860,567.00	3.79
67	601198	中国铁建	1,836,202.00	3.70
68	600359	华鲁恒升	1,834,644.00	3.69
69	000961	中国建设	1,818,868.00	3.66
70	600446	金证股份	1,797,150.00	3.62
71	603288	海天味业	1,794,910.00	3.61
72	001079	拓尔微	1,790,540.00	3.60
73	002013	中航光电	1,790,294.00	3.60
74	300261	光华科技	1,733,387.00	3.49
75	002095	华胜天成	1,733,016.00	3.49
76	000955	欣龙控股	1,721,044.00	3.46
77	601111	中国国航	1,620,614.00	3