

(上接B118版)

7.4.7.3 衍生金融资产/负债
注:本基金本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。
7.4.7.4 买入返售金融资产
7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额
注:本基金本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。
7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券
注:本基金本报告期末及上年度末均无从买断式逆回购交易中取得的债券。
7.4.7.5 应收利息
单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|------------|-------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 65,008.09 | 17,581.29 |
| 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 | 3,632.08 | 2,169.08 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购赎回费 | - | - |
| 其他 | 696.27 | 203.39 |
| 合计 | 70,336.44 | 19,953.76 |

注:其他为应收结算保证金利息。
7.4.7.6 其他资产
注:本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。
7.4.7.7 应付交易费用
单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-------------|-------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,326,500.57 | 1,598,837.07 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 3,326,500.57 | 1,598,837.07 |

7.4.7.8 其他负债
单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-------------|-------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 49,119.93 | 20,846.72 |
| 预提审计费用 | 60,000.00 | 40,000.00 |
| 预提信息披露费 | 100,000.00 | 100,000.00 |
| 其他 | 199,119.93 | 160,846.72 |

7.4.7.9 实收基金
金额单位:人民币元

| 项目 | 2018年1月1日至2018年12月31日 基金份额(份) | 2017年12月31日 基金份额(份) |
|----------------|----------------------------------|------------------------|
| 上年度末 | 479,620,412.70 | 479,620,412.70 |
| 本期申购 | 701,512,941.99 | 701,512,941.99 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -517,406,362.96 | -517,406,362.96 |
| —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) | - | - |
| 合计 | 663,927,991.73 | 663,927,991.73 |

注:此处申购含红利再投资、转换入份额、赎回含转换出份额。
7.4.7.10 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 | 673,227,400.12 | -14,006,592.97 | 659,220,807.15 |
| 本期利润 | -243,680,919.35 | -31,067,736.93 | -274,748,656.28 |
| —基金净收益 | 274,569,163.20 | 3,170,888.33 | 277,740,051.53 |
| —其他:基金净收益 | 968,699,587.64 | -11,129,309.80 | 947,570,277.84 |
| —其他:基金净收益 | -684,061,404.34 | 14,299,108.13 | -669,762,296.21 |
| —其他:基金净收益 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | 794,144,667.97 | -41,903,441.47 | 662,241,226.50 |

7.4.7.11 存款利息收入
单位:人民币元

| 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 |
|----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 1,779,691.04 | 463,778.57 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 其他 | 92,241.61 | 40,458.80 |
| 合计 | 10,440.50 | 3,619.88 |
| 合计 | 1,887,283.15 | 447,866.94 |

注:其他为结算保证金利息收入。
7.4.7.12 股票投资收益
7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入
单位:人民币元

| 项目 | 本期 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 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交金额 | 6,538,098,846.36 | 2,178,160,372.68 |
| —卖出股票成本总额 | 7,153,169,682.91 | 2,122,935,671.29 |
| —卖出股票差价收入 | -615,070,836.55 | 56,224,701.39 |

7.4.7.13 债券投资收益
7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成
单位:人民币元

| 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 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券成交金额 | 10,964,380.71 | 1,316,640.00 |
| —卖出债券成本 | 10,162,506.61 | 1,239,000.00 |
| —卖出债券差价收入 | 6,167.31 | 244.41 |
| —卖出债券差价收入 | 795,686.79 | 77,356.59 |

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入
单位:人民币元

| 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 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券成交金额 | 10,162,506.61 | 1,239,000.00 |
| —卖出债券成本 | 10,162,506.61 | 1,239,000.00 |
| —卖出债券差价收入 | 6,167.31 | 244.41 |
| —卖出债券差价收入 | 795,686.79 | 77,356.59 |

7.4.7.13.3 资产支持证券投资情况
注:本基金报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资情况。
7.4.7.14 贵金属投资收益
注:本基金报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。
7.4.7.15 衍生工具收益
注:本基金报告期内及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。
7.4.7.16 股利收益
单位:人民币元

| 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 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 10,326,506.37 | 1,763,989.18 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 10,326,506.37 | 1,763,989.18 |

7.4.7.17 公允价值变动收益
单位:人民币元

| 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 | -31,067,736.93 | -2,347,697.73 |
| —股权投资 | -31,067,736.93 | -2,347,697.73 |
| —债券投资 | - | - |
| —资产支持证券投资 | - | - |
| —贵金属投资 | - | - |
| —衍生工具 | - | - |
| —其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| —公允价值 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减:应购金融商品公允价值变动产生的损益扣除 | - | - |
| 合计 | -31,067,736.93 | -2,347,697.73 |

7.4.7.18 其他收入
单位:人民币元

| 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 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.7.19 交易费用
单位:人民币元

| 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 | 19,838,260.48 | 6,836,732.97 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 其他基金产生的费用 | - | - |
| 其中:申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 19,838,260.48 | 6,836,732.97 |

7.4.7.20 其他费用
单位:人民币元

| 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 | 50,000.00 | 40,000.00 |
| 信息披露费 | 100,000.00 | 100,000.00 |
| 其他费用 | 360.00 | 360.00 |
| 银行费用 | 25,767.29 | 14,508.06 |
| 债券托管费 | 13,500.00 | - |
| 合计 | 189,627.29 | 154,868.06 |

7.4.7.21 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(以下简称“民生加银基金”) | 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(以下简称“中国建设银行”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 加拿大皇家银行 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 三湘银行股份有限公司 | 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:本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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:本基金报告期内及上年度可比期间无通过关联方的交易单元进行股票交易。

7.4.9.1.2 债券交易
注:本基金报告期内及上年度可比期间无通过关联方的交易单元进行债券交易。

7.4.9.1.3 债券回购交易
注:本基金报告期内及上年度可比期间无通过关联方的交易单元进行债券回购交易。

7.4.9.1.4 权证交易
注:本基金报告期内及上年度可比期间无通过关联方的交易单元进行权证交易。

7.4.9.1.5 支付关联方的佣金
注:本基金报告期内及上年度可比期间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
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理费 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.2 基金托管费
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 基金托管费 | 53,533,908.88 | 31,810 |
| 合计 | 53,533,908.88 | 31,810 |

7.4.9.2.3 基金销售服务费
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金销售服务费 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.4 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.5 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.6 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.7 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.8 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.9 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.10 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.11 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.12 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.13 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.14 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.15 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.16 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.17 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.18 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.19 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | 26,827.79 | 26,463.89 |
| 合计 | 1,654,045.40 | 787,031.04 |

7.4.9.2.20 基金管理人报酬
单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金管理人报酬 | 1,627,217.61 | 760,567.15 |
| 基金转换费收入 | | |