

(上接B126版)

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日	
活期存款	2,507,26,292	1,776,879,677	
定期存款	-	-	
其中:存款期限1个月以内	-	-	
存款期限1-3个月	-	-	
存款期限3个月以上	-	-	
其他存款	-	-	
合计	2,507,26,292	1,776,879,677	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日	公允价值变动
股票	141,762,197.20	127,872,931.06	-13,889,266.24
贵金属投资—金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	1,500,268,581.88	1,476,060,031.17	-114,300,562.71
银行间市场	44,649,030.68	43,660,000.00	-989,030.68
合计	1,634,917,612.56	1,619,620,031.17	-115,297,584.39
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,776,679,802.26	1,647,402,963.13	-129,196,838.63

单位:人民币元			
项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2017年12月31日	公允价值变动
股票	462,703,009.69	320,429,917.92	-132,273,091.74
贵金属投资—金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	1,407,738,006.92	1,308,091,164.40	-98,746,841.52
银行间市场	332,467,191.27	330,627,000.00	-2,130,191.27
合计	1,740,396,197.19	1,638,518,164.40	-100,877,032.79
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,193,098,906.56	1,969,049,082.32	-223,150,724.53

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无衍生金融资产/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

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年12月31日	其中:买断式回购	
交易所市场	5,000,000.00	-	
银行间市场	199,404,720.41	-	
合计	204,404,720.41	-	
项目	上年度末 2017年12月31日	其中:买断式回购	
交易所市场	600	-	
银行间市场	600	-	
合计	600	-	

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	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日	
应收存单利息	5,179.70	87,203	
应收定期存款利息	-	-	
应收债券利息	-	-	
应收其他应收利息	4,908.79	5,694.89	
应收债券付息	21,221,521.21	33,406,388.24	
应收资产支持证券利息	-	-	
应收申购赎回费	154,327.96	-	
应收中期票据利息	-	-	
应收货币基金利息	-	-	
其他	14,032	34,10	
合计	21,386,106.41	33,504,969.26	

7.4.7.6 其他资产

注:本基金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	本期末 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	698,283.53	119,549.56	
银行间市场应付交易费用	-	516.00	
合计	627,022.94	120,065.56	

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日	
应付存款交易单元保证金	-	-	
应付赎回费	53.62	1,377.51	
应付信息披露费	300,000.00	300,000.00	
应付审计费用	50,000.00	70,000.00	
合计	350,053.62	571,377.51	

7.4.7.9 实收基金

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日	
基金份额总额(份)	796,507,182.01	796,507,182.01	
上期期末	796,507,182.01	796,507,182.01	
本期申购	434,540,426.88	434,540,426.88	
本期赎回(以“-”号填列)	-190,106,006.68	-190,106,006.68	
基金分拆申购前份额	-	-	
基金分拆申购折算变动份额	-	-	
本期申购	-	-	
本期赎回(以“-”号填列)	-	-	
合计	1,040,942,513.21	1,040,942,513.21	

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
上期期末	89,724,726.08	89,724,726.08	
本期申购	286,546,176.20	286,546,176.20	
本期赎回(以“-”号填列)	-327,326,530.99	-327,326,530.99	
基金分拆申购前份额	-	-	
基金分拆申购折算变动份额	-	-	
本期申购	-	-	
本期赎回(以“-”号填列)	-	-	
合计	47,946,362.29	47,946,362.29	

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
上期期末	69,466,370.27	2,170,506.93	71,636,877.20
本期申购	-13,884,615.12	4,986,931.26	-8,897,683.86
本期赎回	-13,884,615.12	4,986,931.26	-8,897,683.86
基金分拆申购前份额	-	-	-
基金分拆申购折算变动份额	-	-	-
本期申购	-	-	-
本期赎回	-	-	-
合计	41,697,140.13	7,158,438.25	48,855,578.38

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
上期期末	181,006,076.01	32,044,888.43	213,050,964.44
本期申购	-212,660,750.00	-30,777,589.50	-243,438,339.50
本期赎回	-11,763,213.23	-	-11,763,213.23
本期末	12,044,060.03	8,424,766.52	20,468,826.55

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
活期存款利息收入	12,397.01	109,700.65	
定期存款利息收入	-	-	
其他存款利息收入	-	-	
债券利息收入	164,146.97	162,213.88	
其他利息收入	2,362.41	1,360.03	
合计	208,906.29	273,380.56	

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
活期存款利息收入	12,397.01	109,700.65	
定期存款利息收入	-	-	
其他存款利息收入	-	-	
债券利息收入	164,146.97	162,213.88	
其他利息收入	2,362.41	1,360.03	
合计	208,906.29	273,380.56	

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
卖出股票(含:债券利息和债券利息)	723,889,367.48	1,989,473,676.71	
买入股票(含:债券利息和债券利息)	-721,144,132.09	-1,037,148,102.19	
公允价值变动损益	30,304,260.00	30,323,890.05	
买卖股票差价收入	-17,559,064.70	-8,998,364.13	
合计	-17,559,064.70	-8,998,364.13	

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
卖出债券(含:债券利息和债券利息)	723,889,367.48	1,989,473,676.71	
买入债券(含:债券利息和债券利息)	-721,144,132.09	-1,037,148,102.19	
公允价值变动损益	30,304,260.00	30,323,890.05	
买卖债券差价收入	-17,559,064.70	-8,998,364.13	
合计	-17,559,064.70	-8,998,364.13	

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
卖出债券(含:债券利息和债券利息)	723,889,367.48	1,989,473,676.71	
买入债券(含:债券利息和债券利息)	-721,144,132.09	-1,037,148,102.19	
公允价值变动损益	30,304,260.00	30,323,890.05	
买卖债券差价收入	-17,559,064.70	-8,998,364.13	
合计	-17,559,064.70	-8,998,364.13	

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	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
卖出债券(含:债券利息和债券利息)	723,889,367.48	1,989,473,676.71	
买入债券(含:债券利息和债券利息)	-721,144,132.09	-1,037,148,102.19	
公允价值变动损益	30,304,260.00	30,323,890.05	
买卖债券差价收入	-17,559,064.70	-8,998,364.13	
合计	-17,559,064.70	-8,998,364.13	

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注:本基金本报告期末及上年度末均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注:本基金本报告期末及上年度末均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具损益

注:本基金在本报告期内及上年度末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	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
股票投资收益	2,003,697.23	3,786,776.11	
债券投资收益	-	-	
其他投资收益	-	-	
合计	2,003,697.23	3,786,776.11	

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元			
项目名称	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
1.交易性金融资产	102,962,264.00	-40,279,768.94	
—股票投资	118,384,426.55	-40,332,347.40	
—债券投资	-14,420,561.60	-19,497,419.44	
—资产支持证券投资	-	-	
—贵金属投资	-	-	
—衍生工具	-	-	
2.其他	-	-	
合计	103,963,864.00	-40,279,768.94	

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
基金赎回费收入	822,777.44	277,026.05	
基金转换费收入	50.30	427.44	
合计	822,827.74	277,453.49	

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
交易所市场交易费用	2,727,626.58	761,146.41	
银行间市场交易费用	5,176.00	6,000.00	
其中:申购费	-	-	
赎回费	-	-	
合计	2,732,802.58	767,146.41	

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元			
项目	本期末 2018年1月1日至2018年12月31日	上期期末 2017年1月1日至2017年12月31日	
审计费用	50,000.00	70,000.00	
信息披露费	300,000.00	300,000.00	
客户维护费	31,500.00	36,000.00	
其他	21,523.41	31,006.97	
合计	403,023.41	437,006.97	

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“民生加银基金公司”)	基金管理人,注册登记机构,基金服务机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人,基金服务机构
中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)	基金管理人的关联方投资者,基金服务机构
加拿大皇家银行	基金管理人的关联方投资者
三峡财务有限责任公司	基金管理人的关联方投资者
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的关联方投资者

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:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.9.1.2 权证交易

注:本基金本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。

7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内及上年度末无应支付关联方的佣金。

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			
---------	--	--	--