（上接B108版）

7.4.9.1.2 权证交易
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。
7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金
本基金于本期末及上年度末均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

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年8月12日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,658,674.16	4,704,811.94
其中:支付销售机构的客户维护费	204,472.69	77,901.22

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金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.70%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
2) 于2014年12月31日本基金的应付基金管理费为人民币1,124,570.57元(2013年12月31日:人民币1,021,239.39元)。
7.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年8月12日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,616,763.93	1,344,232.02

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金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
2) 于2014年12月31日本基金的应付基金托管费为人民币321,305.87元(2013年12月31日:人民币291,782.66元)。
7.4.9.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银平稳添利债券A	民生加银平稳添利债券C	合计
中国建设银行	-	1,939.57	1,939.57
中国民生银行	-	406,194.22	406,194.22
民生加银基金公司	-	120.42	120.42
合计	-	408,254.21	408,254.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年8月12日(基金合同生效日)至2013年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银平稳添利债券A	民生加银平稳添利债券C	合计
中国建设银行	-	722.19	722.19
中国民生银行	-	151,240.16	151,240.16
民生加银基金公司	-	57.20	57.20
合计	-	152,019.55	152,019.55

注:1) 民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金A类份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.40%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下:
H=E×0.40%/当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值
销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径支付给基金管理人,经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
2) 本基金于本期末未支付关联方的销售服务费余额为人民币36,255.24元;其中,应支付民生加银基金管理有限公司人民币11.99元,应支付中国建设银行人民币172.25元,应支付中国民生银行人民币36,071.00元。于上年度末未支付关联方的销售服务费余额为人民币32,978.93元;其中,应支付民生加银基金管理有限公司人民币10.32元,应支付中国建设银行人民币156.69元,应支付中国民生银行人民币32,811.92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
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
基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。
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
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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年8月12日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	12,018,115.92	63,540.89	183,989.83	609,124.88
中国民生银行	-	-	-	240,138.89

注:1.本基金本期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,利息收入为人民币63,540.89元(上年度可比期间:121,574.88元)。
2.本基金本期无存放于中国建设银行的定期存款。上年度可比期间由中国建设银行保管的定期银行存款按银行约定利率计息,利息收入为人民币487,550.00元。
3.本基金本期无存放于中国民生银行的定期存款。上年度可比期间由中国民生银行保管的定期银行存款按银行约定利率计息,利息收入为人民币240,138.89元。
7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
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(2014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

金额单位:人民币元

7.4.10.1.2 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127060	14遵义投资债	2014年12月11日	2015年2月9日	新发	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
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2014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2014年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币1,751,500,000.00元,于2015年1月5日至2015年1月7日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。
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
管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、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2014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881,733,000.00元,划分为第二层次的余额为人民币2,495,384,535.00元,无划分为第三层次余额。
公允价值所属层次间重大变动
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(包括涨跌停时的交易不活跃)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。
7.4.11.3财务报表的批准
本财务报表已于2015年3月22日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	3,377,117,535.00	92.92
	其中:债券	3,377,117,535.00	92.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	70,000,305.00	1.93
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	117,179,231.80	3.22
7	其他各项资产	70,010,240.87	1.93
8	合计	3,634,307,312.67	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
本基金本报告期内未持有股票。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	253,098,000.00	13.53
	其中:政策性金融债	153,098,000.00	8.18
4	企业债券	2,983,116,535.00	159.46
5	企业短期融资券	100,300,000.00	5.36
6	中期票据	40,603,000.00	2.17
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,377,117,535.00	180.53

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122312	13海通05	2,000,000	201,560,000.00	10.77
2	124384	13雅发投	1,500,000	157,500,000.00	8.42
3	124342	13黔南资	1,500,000	153,000,000.00	8.18
4	124349	13福东海	1,000,000	106,200,000.00	5.68
5	124607	14津环城	1,000,000	103,950,000.00	5.56

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.10.1本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。
8.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
8.10.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
8.11 投资组合报告附注
8.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
8.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
8.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,301.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	69,968,938.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,010,240.87

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
8.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

序号	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
民生加银平稳添利债券A	978	1,678,666.64	1,509,426,263.98	91.94%	132,309,714.28	8.06%
民生加银平稳添利债券C	822	119,922.94	186,083.97	0.19%	98,390,572.75	99.81%
合计	1,800	966,840.35	1,509,612,347.95	86.74%	230,700,287.03	13.26%

注:机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。
9.2 期末上市基金前十名持有人

民生加银平稳添利债券A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国铁路通信信号集团公司企业年金计划-中国建设银行股份有限	2,184,700.00	26.06%
2	云南煤化工集团有限公司企业年金计划-招商银行股份有限公司	1,729,515.00	20.63%
3	中国人寿保险(集团)公司企业年金计划-中国农业银行股份有限	1,296,481.00	15.47%
4	广发证券-广发-广发金管家多添利集合资产管理计划	647,988.00	7.73%
5	无锡威孚高科技集团股份有限公司企业年金计划-招商银行股份有	579,500.00	6.91%
6	宝钢集团有限公司钢铁业企业年金计划-中国工商银行股份有限公	500,000.00	5.96%
7	杨春娟	307,380.00	3.67%
8	蔡玲柳	146,831.00	1.75%
9	杨旻豪	145,670.00	1.74%
10	梁淑娟	118,200.00	1.41%

注:持有人为场内持有人。
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	民生加银平稳添利债券A	1,990.24	0.00%
	民生加银平稳添利债券C	0.00	0.00%
	合计	1,990.24	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	民生加银平稳添利债券A	0
	民生加银平稳添利债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	民生加银平稳添利债券A	0
	民生加银平稳添利债券C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	民生加银平稳添利债券A	民生加银平稳添利债券C
基金合同生效日(2013年8月12日)基金份额总额	1,641,735,978.26	98,576,656.72
本报告期期初基金份额总额	1,641,735,978.26	98,576,656.72
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	1,641,735,978.26	98,576,656.72

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。
本基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。
11.4 基金投资策略的改变
本报告期基金投资策略没有改变。
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期支付给安永华明会计师事务所的报酬为70,000.00元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供2年的审计服务。
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。
11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况
11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本报告期新增
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券股份有限公司	203,291.61	0.02%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1,091,965,873.25	97.58%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	26,861,624.94	2.40%	186,402,400,000.00	100.00%	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注:由于四舍五入的原因,百分比分项之和与合计可能有尾差。
①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:
ⅰ实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;
ⅱ研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为基金提供高质量的资讯服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;
ⅲ财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
ⅳ经营行为规范,内部管理规范、严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求;
ⅴ具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的要求,并能为基金提供全面的信息服务。
②券商专用交易单元选择程序:
ⅰ投研能力打分:由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分,填写《券商评价表》
ⅱ指定租用方案:由交易部根据评价结果,结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案;
ⅲ公司领导审批:公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见;
ⅳ交易部洽谈:交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈,并起草相关书面协议;
ⅴ律师审议:席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计;
ⅵ交易部经办:席位租用协议生效后,由交易部专人与券商进行联系,具体办理租用手续;
ⅶ连通测试:信息技术部接到交易部通知后,将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试;
ⅷ通知托管行:信息技术部测试通过后,应及时通知投资部、交易部及运营部,由运营部通知托管行有关席位的具体信息;
ⅸ席位启用:交易席位正式使用,投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。
本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。
本基金本期新增方正证券股份有限公司交易单元作为本基金交易单元。

§12 影响投资决策的其他重要信息

无。

民生加银基金管理有限公司
2015年3月26日

（上接B106版）

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	319,702,252.33	152,819.73	2,271,512.60	8,980,422.91
中国民生银行	-	1,868,544.45	-	12,962,865.31

注:1.本基金本期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,利息收入为人民币152,819.73元(2013年度:人民币1,151,530.67元)。
2.本基金本期无存放于中国建设银行的定期存款,2013年度由中国建设银行保管的定期银行存款按银行约定利率计息,利息收入为人民币7,828,892.24元。
3. 本基金本期由中国民生银行保管的定期银行存款按银行约定利率计息, 利息收入为人民币1,868,544.45元(2013年度,人民币12,962,865.31元)。
7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
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(2014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
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
本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2014年12月31日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 409,548,985.67元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
100209	10国开09	2015年1月7日	100.26	350,000	35,091,097.17
130235	13国开35	2015年1月7日	99.23	200,000	19,846,319.89
130241	13国开41	2015年1月7日	100.38	300,000	30,113,576.65
130242	13国开42	2015年1月7日	100.81	700,000	70,567,395.94
140327	14进出27	2015年1月7日	100.25	500,000	50,126,419.94
140357	14进出57	2015年1月7日	99.96	1,000,000	99,958,182.22
100209	10国开09	2015年1月9日	100.26	1,050,000	105,273,291.52
130212	13国开12	2015年1月9日	99.99	50,000	4,999,666.03
合计				4,150,000	415,975,949.36

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2014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
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。
2其他事项
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。
3财务报表的批准
本财务报表已于2015年3月22日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,972,838,207.93	44.53
	其中:债券	2,972,838,207.93	44.53
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,320,004,060.00	19.77
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,331,702,252.33	34.93
4	其他各项资产	51,620,384.11	0.77
5	合计	6,676,164,904.37	100.00

购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.22	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	409,548,985.67	6.54
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2014年4月2日	20.44	赎回	发生后五个工作日内

8.3 基金投资组合平均剩余期限
8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	132
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	135
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2014年12月26日	121	赎回	发生后十个工作日内
2	2014年12月29日	126	赎回	发生后十个工作日内
3	2014年12月30日	135	赎回	发生后十个工作日内
4	2014年12月31日	132	赎回	发生后十个工作日内

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内本基金发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况详见上表。
8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	29.57	6.54
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.01	-
2	30天(含)—60天	0.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.16	-
3	60天(含)—90天	31.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.41	-
4	90天(含)—180天	11.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	33.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.82	6.54

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,040,691,464.69	16.62
	其中:政策性金融债	1,040,691,464.69	16.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,932,146,743.24	30.87
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,972,838,207.93	47.49
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	349,898,391.13	5.59

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	100209	10国开09	3,300,000	330,858,916.22	5.29
2	041453118	14酒钢CP002	2,500,000	249,964,516.75	3.99
3	140223	14国开23	2,100,000	209,849,555.18	3.35
4	130234	13国开34	1,700,000	168,889,282.80	2.70
5	041465006	14北京钢铁CP001	1,200,000	119,949,157.32	1.92
6	041460079	14梅花CP002	1,000,000	100,407,805.69	1.60
7	041473003	14丹东港CP002	1,000,000	100,085,853.07	1.60
8	011481002	14淮南矿SCP002	1,000,000	99,978,457.85	1.60
9	140357	14进出57	1,000,000	99,958,182.22	1.60
10	011481003	14淮南矿SCP003	900,000	89,970,949.21	1.44

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	11
报告期内偏离度的最高值	0.3131%
报告期内偏离度的最低值	-0.0545%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0764%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
8.8 投资组合报告附注
8.8.1声明报告期内本基金投资的前十名证券中是否有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。
为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人应与基金托管人协商一致后,参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。
如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。
8.8.2 本基金本报告期内未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。
8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	50,072,207.86
4	应收申购款	1,548,176.25
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	51,620,384.11

8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
民生加银现金增利货币A	28,561	60,495.32	36,975,461.83	2.14%	1,690,831,508.31	97.86%
民生加银现金增利货币B	102	44,432,639.67	3,848,819,931.47	84.92%	683,309,315.24	15.08%