民生加银转债优选债券型证券投资基金

【2014】年度报告摘要

基金管理人:民生加银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	民生加银转债优选	
基金主代码	000067	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年4月18日	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,215,025,235.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称;	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C
下属分级基金的交易代码;	000067	000068
报告期末下属分级基金的份额总额	1,081,116,413.66份	133,908,822.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制基金资产风险、保持资产流动性的基础上,采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略,通过积极主动的投资管理,充分挖掘可转换债券和普通债券的投资机会,争取实现超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对宏观经济环境、市场状况、政策走向等宏观层面信息和个券的微观层面信息进行综合分析,做出投资决策。
业绩比较基准	60%×中证可转债指数收益率+30%×中证国债指数收益率+10%×沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,一般情况下其预期风险和收益高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	田青
	联系电话	0755-23999888	010-67595096
	电子邮箱	linhai@mysfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096
传真		0755-23999800	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.mysfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标,基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年		2013年4月18日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C
本期已实现收益	245,379,220.31	3,796,624.11	13,776,022.17	7,168,621.04
本期利润	751,356,103.18	109,381,574.11	-96,719,746.92	-33,284,101.18
加权平均基金份额本期利润	0.4542	0.2750	-0.0601	-0.0528
本期基金份额净值增长率	61.76%	61.28%	-7.70%	-8.00%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末	
期末可供分配基金份额利润	0.2424	0.2343	-0.0771	-0.0795
期末基金资产净值	1,613,577,861.11	198,554,806.51	1,715,164,042.12	605,437,848.44
期末基金份额净值	1.493	1.483	0.923	0.920

注:1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3)期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和本期利润中已实现部分的期末金额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易所的开放日。

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
民生加银转债优选A

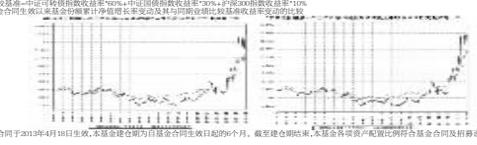
3.2.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	48.41%	2.66%	30.36%	1.30%	17.85%	1.36%
过去六个月	58.49%	2.06%	36.71%	0.96%	21.78%	1.10%
过去一年	61.76%	1.58%	41.50%	0.74%	20.26%	0.84%
自基金合同生效起至今	49.30%	1.27%	33.95%	0.65%	15.35%	0.62%

民生加银转债优选C

阶段	份额净值增长率②	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	48.30%	2.66%	30.36%	1.30%	17.74%	1.36%
过去六个月	58.27%	2.07%	36.71%	0.96%	21.56%	1.11%
过去一年	61.28%	1.58%	41.50%	0.74%	19.70%	0.84%
自基金合同生效起至今	48.30%	1.27%	33.95%	0.65%	14.35%	0.62%

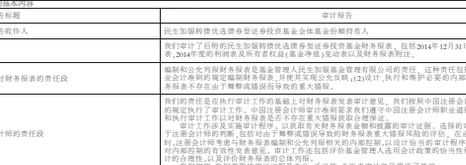
注:业绩比较基准=中证可转债指数收益率*60%+中证国债指数收益率*30%+沪深300指数收益率*10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2013年4月18日生效,本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月,截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每个净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2013年4月18日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金自2013年4月18日(基金合同生效日)至本报告期末未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
民生加银基金管理有限公司,以下简称“公司”,是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。经中国证监会(2008)1187号文批准,于2008年11月3日在深圳正式成立,2012年注资后本期加股至3亿元人民币。
截至2014年12月31日,公司共管理21只开放式基金:民生加银品味蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银精选股票型证券投资基金、民生加银精睿混合型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、民生加银平安行业股票型证券投资基金、民生加银内需均衡股票型证券投资基金、民生加银稳健证券投资基金、民生加银稳健回报证券投资基金、民生加银稳健增利债券型证券投资基金、民生加银平稳纯利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳纯利定期开放债券型证券投资基金、民生加银稳健增利货币市场基金、民生加银鑫利货币市场基金、民生加银鑫利债券型证券投资基金、民生加银鑫利增利债券型证券投资基金、民生加银鑫利稳健债券型证券投资基金、民生加银鑫利稳健纯利债券型证券投资基金、民生加银鑫利稳健纯利定期开放债券型证券投资基金、民生加银鑫利稳健纯利定期开放债券型证券投资基金、民生加银鑫利稳健纯利定期开放