

## 民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金

## [2015]第三季度报告

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  
报告送出日期：2015年10月27日

重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性、及时性和合规性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司承诺以诚实信用、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，该文件并不代表基金合同。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	民生加银平稳添利债券
场内简称	民生添利
基金主代码	160600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21日
报告期末基金份额总额	1,749,122,454.98份

本基金采取定期开放运作模式，通过定期开放的机制，在满足流动性需求的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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，该文件并不代表基金合同。

本报告期财务资料未经审计。

## § 3 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，本基金A类份额净值为1.131元，本基金期内份额净值增长率为5.29%，同期业绩比较基准收益率为0.74%，本基金C类份额净值为1.128元，本基金期内份额净值增长率为5.20%，同期业绩比较基准收益率为0.74%。

4.42 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，本基金A类份额净值为1.131元，本基金期内份额净值增长率为5.29%，同期业绩比较基准收益率为0.74%，本基金C类份额净值为1.128元，本基金期内份额净值增长率为5.20%，同期业绩比较基准收益率为0.74%。

4.43 管理人对宏观经济、市场及行业走势的简要展望

展望第四季度，本基金将稳健地延续当前的风格，坚持企业投资意愿不强，政策“托”而不“举”的思路，密切关注经济数据，把握好阶段性机会，同时关注宏观政策的边际变化。

本基金将坚持对基本面的判断，但无论短期还是中长端，收益曲线继续下行空间均较为有限，且目前得到的明显提升。因此，本基金仍将坚持本基金季度重点关注的指标的，但需要加强对个别风险的警惕。

本基金持有人对本基金的信任和支持，我们将本着勤勉尽责的精神，秉承“诚信、稳健、专业、创新”的原则，力争为基金份额持有人保持良好流动性前提下获取较好回报。

4.44 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动情况

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千元的情形。

## § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	2,897,965,199.60	97.15
其中：债券	2,897,965,199.60	97.15	
货币市场工具	-	-	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	27,089,770.05	0.91
7	其他资产	67,071,193.56	1.94
8	合计	3,052,926,163.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.3 报告期内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

本基金报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期内按行业分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,406,266.60	0.29
2	中央银行票据	-	-
3	金融债	109,999,000.00	10.16
4	企业债	2,640,697,632.00	124.20
5	中期票据	41,762,000.00	2.12
6	可转债	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,897,965,199.60	147.27

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124041	13国债	1,600,000	169,151,000.00	8.08
2	124042	13农商债	1,600,000	167,095,000.00	7.98
3	124041	14文投债	1,000,000	108,810,000.00	5.63
4	124007	13国开债	1,000,000	106,940,000.00	5.63
5	124036	13国债	1,000,000	105,400,000.00	5.36

5.6 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

本基金报告期末未持有贵金属。

5.7 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权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

5.8 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股指期货投资明细

本基金报告期末未持有股指期货。

5.9 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国债期货投资明细

本基金报告期末未持有国债期货。

5.10 本基金报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末前十名股票中存在其他账户描述部分

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。

5.10.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券变动情况

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。

5.10.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资变动明细

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。

5.10.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.10 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细

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。

5.10.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资变动明细

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。

5.10.14 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细

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。

5.10.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资变动明细

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。

5.10.18 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细

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。

5.10.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资变动明细

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。

5.10.22 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细

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。

5.10.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资变动明细

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。

5.10.26 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细

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。

5.10.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资变动明细

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。

5.10.30 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细

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。

5.10.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资变动明细

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。

5.10.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资变动明细

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。

5.10.34 报告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指期货投资变动明细

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。

5.10.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资变动明细