

民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金

[2015]第四季度报告

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:2016年1月21日

§ 1 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、准确性和完整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根据基金合同规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告告期内财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔业	3,629,548.00	3.23
B	采掘业	42,866,103.00	38.08
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,977,140.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	3,400,991.00	3.01
H	住宿和餐饮业	1,676,307.00	1.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,164,393.00	5.46
J	金融业	3,263,125.00	2.89
K	房地产业	5,276,775.00	4.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,662,340.00	4.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,463,169.00	1.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和体育与社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,326,836.72	9.15
S	综合	4,016,415.00	3.56
	合计	88,013,186.72	76.72

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		
报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)		
1.本期已实现收益	22,444,316.02	
2.本期利润	29,369,436.09	
3.期末可供分配基金份额利润	0.0001	
4.期末基金资产净值	112,021,071.36	
5.期末基金份额净值	1.002	

注:①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。

②所述基金业绩指标不包括持有认购或交易基金的费用项,计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金的净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
过去三个月	32.09%	2.10%	13.98%	1.02%

注:业比较基准=沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金合于2013年1月31日生效，本基金仓位制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相关招募说明有关投资比例的约定。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
李海	本基金的基金经理	2013年1月31日至	7年	硕士研究生，曾任民生加银基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，2013年1月31日起任本基金基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金合同生效日或本基金管理人员对外披露的免任日期填写。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，勤勉尽责地履行基金职责，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平等交易原则的执行情况

公司严格执行《关于证券投资基金公平交易行为的指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内、外股票、债券的一级市场申购、二级市场价格偏离等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控和异常情况处理等环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司制定了系统中公平交易程序，在指令分批和指价申报时，均通过系统强制执行公平委托；此外，公司定期对各基金经理账户进行公平交易监控，对异常交易行为及时采取干预措施。

对于场外交易，公司完善银行间同业市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易方式，非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在经独立地确定各投资组合的交易价格和数量、公司按价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

本报告期内，本基金实行公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照相关法律法规的规定，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内、外股票、债券的一级市场申购、二级市场价格偏离等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控和异常情况处理等环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司制定了系统中公平交易程序，在指令分批和指价申报时，均通过系统强制执行公平委托；此外，公司定期对各基金经理账户进行公平交易监控，对异常交易行为及时采取干预措施。

对于场外交易，公司完善银行间同业市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易方式，非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在经独立地确定各投资组合的交易价格和数量、公司按价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

本报告期内，本基金实行公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具等金融品种，通过资产配置，追求长期资本增值。

本基金在报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，勤勉尽责地履行基金职责，不存在损害基金持有人利益的行为。

本基金在报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的