

(上接B309版)

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2016年12月31日	
活期存款	14,361,062.42	71,095,141.54	
定期存款	--	--	
其中:存款期限1-3个月	--	--	
其他存款	--	--	
合计:	14,361,062.42	71,095,141.54	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元			
项目	成本	本期末 2016年12月31日 公允价值	公允价值变动
股票	793,597,625.28	655,313,120.89	-138,284,504.39
贵金属投资—金交所黄金合约	--	--	--
债券	交易所市场 2,670,895,300.66 银行间市场 508,001,015.47	2,795,623,149.48 505,284,000.00	-75,272,151.18 -2,717,015.47
合计	3,378,896,316.33	3,300,907,149.48	-77,989,166.65
资产支持证券	45,000,000.00	45,000,000.00	--
基金	--	--	--
其他	--	--	--
合计	4,217,493,941.41	4,001,220,270.27	-216,273,671.04
项目	成本	本期末 2016年12月31日 公允价值	公允价值变动
股票	898,059,301.88	800,322,304.56	-7,776,997.32
贵金属投资—金交所黄金合约	--	--	--
债券	交易所市场 2,161,853,456.37 银行间市场 1,143,107,442.84	2,195,175,279.40 1,146,820,000.00	33,321,823.03 3,712,557.16
合计	3,304,960,899.21	3,341,995,279.40	37,034,390.19
资产支持证券	--	--	--
基金	--	--	--
其他	--	--	--
合计	4,113,090,201.09	4,142,317,583.96	29,267,382.87

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/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 2016年12月31日 账面余额	其中:买断式逆回购	
交易所市场	--	--	
银行间市场	99,180,348.77	--	
合计	99,180,348.77	--	
项目	上年度末 2015年12月31日 账面余额	其中:买断式逆回购	
交易所市场	--	--	
银行间市场	200,000,620.00	--	
合计	200,000,620.00	--	

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日	
应收活期存款利息	12,313.60	121,736.98	
应收定期存款利息	--	--	
应收其他存款利息	--	--	
应收结算资金利息	7,236.57	7,606.92	
应收债券利息	68,631,221.47	65,211,111.21	
应收买入返售证券利息	312,768.80	141,500.05	
应收申购款利息	--	--	
应收黄金合约计提利息	--	--	
其他	200,792.51	262.46	
合计	69,164,320.95	65,482,226.62	

注:其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日	
其他应收款	--	--	
待摊费用	--	--	
合计	--	--	

注:本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日	
交易所市场应付交易费用	562,881.93	1,063,646.64	
银行间市场应付交易费用	22,276.91	9,325.45	
合计	585,158.84	1,072,972.09	

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日	
应付券商交易单元保证金	--	--	
应付赎回费	80.30	205.42	
预提费用	480,000.00	570,000.00	
合计	480,080.30	570,205.42	

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元			
项目	2016年1月1日至2016年12月31日		基金份额(份)
	基金金额	基金份额(份)	
上年度末	1,848,085,793.12	1,848,085,793.12	
本期申购	1,348,129,429.26	1,348,129,429.26	
本期赎回(以“-”号填列)	-1,513,918,957.40	-1,513,918,957.40	
—基金拆分/份额折算前	--	--	
—基金拆分/份额折算变动份额	--	--	
本期申购	--	--	
本期赎回(以“-”号填列)	1,682,296,264.98	1,682,296,264.98	
合计	480,918,964.90	480,918,964.90	
项目	2016年1月1日至2016年12月31日		基金份额(份)
	基金金额	基金份额(份)	
上年度末	885,932,264.05	885,932,264.05	
本期申购	490,610,489.67	490,610,489.67	
本期赎回(以“-”号填列)	-895,623,798.82	-895,623,798.82	
—基金拆分/份额折算前	--	--	
—基金拆分/份额折算变动份额	--	--	
本期申购	--	--	
本期赎回(以“-”号填列)	--	--	
合计	480,918,964.90	480,918,964.90	

注:申购含转换入份额,赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,012,339,765.01	90,560,629.87	1,102,899,394.88
本期利润	85,221,487.21	-165,576,321.41	-80,354,834.20
本期基金净损益	-107,694,248.17	22,274,488.36	-85,419,769.81
其中:基金申购款	764,018,158.34	-3,636,500.12	760,381,228.22
基金赎回款	-871,712,406.51	25,911,418.48	-845,800,988.03
本期已分配利润	--	--	--
本期末	989,837,004.06	-52,761,203.18	937,085,800.87

7.4.7.11 民生加银信用双利债券C

单位:人民币元			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	463,761,850.30	42,970,017.33	506,731,867.63
本期利润	22,360,077.81	-79,954,732.50	-57,694,654.69
本期基金净损益	-218,117,129.45	22,310,820.80	-195,806,308.65
其中:基金申购款	264,732,888.82	6,201,682.06	270,934,570.88
基金赎回款	-482,850,018.27	16,109,138.74	-466,740,879.53
本期已分配利润	--	--	--
本期末	267,904,798.06	-14,673,894.37	253,230,903.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
活期存款利息收入	494,688.56	626,261.22	
定期存款利息收入	--	--	
其他存款利息收入	--	--	
结算备付金利息收入	268,327.73	705,413.34	
其他	7,872.24	8,582.85	
合计	760,888.53	1,340,257.44	

7.4.7.12 债券投资收益

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
债券投资收益—买卖债券/债转股及债券到期兑付	-9,537,190.00	117,088,356.89	
债券投资收益—赎回差价收入	--	--	
债券投资收益—申购差价收入	--	--	
债券投资收益—申购差价收入	--	--	
合计	-9,537,190.00	117,088,356.89	

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	3,306,463,053.09	2,166,941,124.69	
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	3,267,005,030.67	1,992,239,062.17	
减:应收利息/溢价摊销	108,905,221.42	57,615,696.63	
买卖债券差价收入	-9,537,190.00	117,088,356.89	

7.4.7.13.3 资产支持证券投资

单位:人民币元			
项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	3,306,463,053.09	2,166,941,124.69	
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	3,267,005,030.67	1,992,239,062.17	
减:应收利息/溢价摊销	108,905,221.42	57,615,696.63	
买卖债券差价收入	-9,537,190.00	117,088,356.89	

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
卖出资产支持证券成交总额	--	12,015,780.82	
减:卖出资产支持证券成本总额	--	11,988,000.00	
减:应收利息/溢价摊销	--	27,780.82	
资产支持证券投资收益	--	--	

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生金融工具收益。

7.4.7.16 股利收益

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
股票投资产生的股利收益	5,545,470.40	2,692,134.00	
基金投资产生的股利收益	--	--	
合计	5,545,470.40	2,692,134.00	

7.4.7.17 公允价值变动收益

项目名称	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
1.交易性金融资产	-245,531,053.91	-115,394,126.98	
—股票投资	-130,507,507.07	-7,587,085.98	
—债券投资	-115,023,546.84	-107,797,039.90	
—资产支持证券投资	--	--	
—贵金属投资	--	--	
—其他	--	--	
2.衍生工具	--	--	
—权证投资	--	--	
3.其他	--	--	
合计	-245,531,053.91	-115,394,126.98	

7.4.7.18 其他收入

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
基金赎回费收入	468,715.94	527,411.36	
基金转换费收入	37,830.14	45,571.85	
合计	506,546.98	572,983.20	

7.4.7.19 交易费用

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
交易所市场交易费用	1,125,813.82	5,409,340.70	
银行间市场交易费用	17,600.00	13,000.00	
合计	1,143,463.82	5,422,340.70	

7.4.7.20 其他费用

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
审计费用	90,000.00	80,000.00	
信息披露费	390,000.00	390,000.00	
其他费用	1,200.00	20.00	
银行费用	56,899.22	48,451.05	
债券持有人维护费	36,000.00	36,000.00	
合计	574,099.22	554,451.05	

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末,本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务,因此,无需作披露的分部报告。

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“民生加银基金公司”	基金管理人,注册登记机构,基金销售机构
中国银行	基金托管人,基金销售机构
中国民生银行股份有限公司“中国民生银行”	基金管理人的股东,基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的股东
三峡财务有限责任公司	基金管理人的股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

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股票交易。

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 支付关联方款项

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

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
当期发生的基金应支付的管	29,042,689.92	19,858,406.56	
其中:支付销售机构的客户	231,468.94	343,549.05	

注:1)基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的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为前一日基金资产净值

2)于2016年12月31日的应付基金管理费为人民币2,328,140.14元(2015年12月31日:人民币2,143,031.32元)。

7.4.9.2.2 基金托管费

项目	本期末 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
当期发生的基金应支付的托	8,297,910.54	5,673,887.59	
其中:支付销售机构的客户	231,468.94	343,549.05	

注:1)基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的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为前一日基金资产净值

2)于2016年12月31日的应付基金托管费为人民币665,182.90元(2015年12月31日:人民币612,294.65元)。

7.4.9.2.3 销售服务费

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银信用双利债券A	民生加银信用双利债券C	合计
民生加银基金公司	-	3,571,315.53	3,571,315.53
中国银行	-	37,318.97	37,318.97
中国民生银行	-	329,803.00	329,803.00
合计	-	3,938,437.50	3,938,437.50
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银信用双利债券A	民生加银信用双利债券C	合计
民生加银基金公司	-	1,027,120.12	1,027,120.12
中国银行	-	41,476.69	41,476.69
中国民生银行	-	552,677.39	552,677.39
合计	-	1,621,274.20	1,621,274.20