(上接B315版)

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位:人民币元

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
银行间市场	19,800,149.70	–
交易所市场	–	–
合计	19,800,149.70	–
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
合计	–	–

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位:人民币元

项目	本期末 2016年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中:已出售或再质押总额
合计					–	–	–
项目	上年度末 2015年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中:已出售或再质押总额
合计					–	–	–

注: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	1,034.87	4,569.40
应收定期存款利息	–	–
应收其他存款利息	–	–
应收结算备付金利息	2,723.06	2,055.79
应收债券利息	2,427,877.15	2,123,065.16
应收买入返售证券利息	18,141.32	–
应收申购款利息	–	–
应收黄金合约拆借孳息	–	–
其他	37.29	52.69
合计	2,449,813.68	2,129,743.04

注:其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

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	329,843.43	251,394.15
银行间市场应付交易费用	299.40	1,387.75
合计	330,142.83	252,781.90

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	327.15	604.25
预提费用	350,000.00	450,000.00
合计	350,327.15	450,604.25

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

民生加银转债优选A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	387,105,206.42	387,105,206.42
本期申购	427,165,730.21	427,165,730.21
本期赎回(以"-"号填列)	-124,290,123.09	-124,290,123.09
-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)	–	–
本期末	689,980,813.54	689,980,813.54

民生加银转债优选C		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	131,238,192.05	131,238,192.05
本期申购	574,246,705.83	574,246,705.83
本期赎回(以"-"号填列)	-617,244,479.54	-617,244,479.54
-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)	–	–
本期末	88,240,418.34	88,240,418.34

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

民生加银转债优选A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	76,079,371.54	-136,585,494.38	-60,506,122.84
本期利润	-50,931,325.44	-19,181,815.19	-70,113,140.63
本期基金份额交易产生的变动数	39,866,238.48	-132,781,473.47	-92,915,234.99
其中:基金申购款	61,917,289.14	-193,130,952.10	-131,213,662.96
基金赎回款	-22,051,050.66	60,349,478.63	38,298,427.97
本期已分配利润	–	–	–
本期末	65,014,284.58	-288,548,783.04	-223,534,498.46

民生加银转债优选C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,403,554.00	-46,202,215.05	-20,798,661.05
本期利润	-16,516,449.91	-15,631,874.41	-32,148,324.32
本期基金份额交易产生的变动数	-961,381.97	24,982,920.42	24,021,538.45
其中:基金申购款	91,727,647.16	-266,709,736.24	-174,982,089.08
基金赎回款	-92,689,029.13	291,692,656.66	199,003,627.53
本期已分配利润	–	–	–
本期末	7,925,722.12	-36,851,169.04	-28,925,446.92

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 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	101,579.01	412,016.98
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	90,656.92	274,740.53
其他	853.52	8,838.46
合计	193,089.45	695,595.97

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 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
卖出股票成交总额	194,353,066.79	693,867,406.65
减:卖出股票成本总额	204,709,267.95	603,558,885.91
买卖股票差价收入	-10,356,201.16	90,308,520.74

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 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)差价收入	-52,048,457.08	300,251,472.66
债券投资收益——赎回差价收入	–	–
债券投资收益——申购差价收入	–	–
合计	–	–

7.4.7.13.2债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 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	864,884,887.24	3,300,542,249.14
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	910,648,077.02	2,980,874,424.00
减:应收利息总额	6,285,267.30	19,416,352.48
买卖债券差价收入	-52,048,457.08	300,251,472.66

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

单位:人民币元

项目	本期 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	717,296.48	313,390.23
基金投资产生的股利收益	–	–
合计	717,296.48	313,390.23

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 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	-34,813,689.60	-464,026,299.22
——股票投资	3,604,797.20	-33,295,390.39
——债券投资	-38,418,486.80	-430,730,908.83
——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	-34,813,689.60	-464,026,299.22

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 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	69,180.94	292,717.63
转换费收入	320.40	80,592.41
合计	69,501.34	373,310.04

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 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	577,194.69	1,716,019.90
银行间市场交易费用	1,375.00	1,850.00
合计	578,569.69	1,717,869.90

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 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	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	1,100.00	200.00
债券帐户维护费	31,500.00	18,000.00
银行费用	22,323.34	26,472.10
合计	404,923.34	394,672.10

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
中国建设银行	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:下述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 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 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理费	3,087,652.61	5,114,644.15
其中:支付销售机构的客户维护费	152,584.37	390,413.45

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2016年12月31日的应付基金管理费为人民币369,500.62元。(2015年12月31日:人民币295,131.84元)。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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管费	882,186.41	1,461,326.88

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2016年12月31日的应付基金托管费为人民币105,571.62元。(2015年12月31日:人民币84,323.37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 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		
	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C	合计
民生加银基金公司	–	293,890.97	293,890.97
中国建设银行	–	31,027.95	31,027.95
中国民生银行	–	75,829.09	75,829.09
合计	–	400,748.01	400,748.01
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		
	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C	合计
民生加银基金公司	–	259,068.43	259,068.43
中国建设银行	–	91,908.64	91,908.64
中国民生银行	–	157,624.23	157,624.23
合计	–	508,601.30	508,601.30

注:1)民生加银转债优选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

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51,234.33元;其中,应支付民生加银基金公司人民币41,833.51元,应支付中国建设银行人民币2,747.50元,应支付中国民生银行人民币6,653.32元。于上年度末未支付关联方的销售服务费余额为人民币35,807.83元;其中,应支付民生加银基金公司人民币24,641.43元,应支付中国建设银行人民币3,122.41元,应支付中国民生银行人民币8,043.99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

单位:人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金于本期内及上年度可比期间内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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资于本基金。

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 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	
	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	1,745,850.36	101,579.01	2,827,742.14	412,016.98

注: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。

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(2016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

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金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2016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2016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25,800,000.00元,于2017年1月3日到期。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

7.4.14.1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。

7.4.14.2其他事项

(1)公允价值

本基金管理人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2016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417,198,915.66元,划分为第二层次的余额为人民币105,328,852.20元,无划分为第三层次的余额。于2015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334,507,774.69元,划分为第二层次的余额为人民币381,110,192.46元,无划分为第三层次的余额。

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。

?

7.4.14.2其他事项(续)

(1)公允价值(续)

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。

§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	57,343,425.76	10.32
	其中:股票	57,343,425.76	10.32
2	固定收益投资	465,184,342.10	83.73
	其中:债券	465,184,342.10	83.73
	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	19,800,149.70	3.56
	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	7,246,882.25	1.30
7	其他各项资产	6,005,741.64	1.08
8	合计	555,580,541.45	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	11,601,204.00	2.21
C	制造业	18,215,995.24	3.46
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	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	25,156,436.52	4.78
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	8,000.00	0.00
K	房地产业	2,361,790.00	0.45
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	57,343,425.76	10.91

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	3,553,169	25,156,436.52	4.78
2	000709	河钢股份	4,715,286	15,749,055.24	3.00
3	600028	中国石化	2,144,400	11,601,204.00	2.21
4	000807	云铝股份	368,200	2,466,940.00	0.47
5	000402	金融街	229,300	2,361,790.00	0.45
6	601375	中原证券	2,000	8,000.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	23,013,208.15	5.27
2	000709	河钢股份	14,754,676.60	3.38
3	600170	上海建工	10,932,368.00	2.50
4	600855	航天长峰	10,586,151.00	2.42
5	600028	中国石化	10,546,604.00	2.41
6	600755	厦门国贸	10,131,758.00	2.32
7	002117	东港股份	9,581,877.50	2.19
8	000860	顺鑫农业	9,267,578.38	2.12
9	601088	中国神华	6,191,242.84	1.42
10	601872	招商轮船	5,489,369.37	1.26
11	300182	捷成股份	5,480,142.00	1.25
12	601607	上海医药	5,189,183.00	1.19
13	600958	东方证券	5,083,897.00	1.16
14	002241	歌尔股份	4,439,472.50	1.02
15	601333	广深铁路	4,044,376.00	0.93
16	601928	凤凰传媒	3,970,400.00	0.91
17	600585	海螺水泥	3,822,606.99	0.87
18	000027	深圳能源	3,495,253.16	0.80
19	600787	中储股份	3,460,872.88	0.79
20	600795	国电电力	3,270,885.00	0.75

注:"本期累计买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	32,084,815.92	7.34
2	601688	华泰证券	14,699,200.74	3.36
3	600170	上海建工	11,570,833.00	2.65
4	600855	航天长峰	10,601,239.91	2.43
5	000728	国元证券	9,522,762.51	2.18
6	600755	厦门国贸	9,361,755.00	2.14
7	000860	顺鑫农业	9,247,006.36	2.12
8	002117	东港股份	8,677,429.20	1.99
9	600990	四创电子	7,272,496.23	1.66
10	600699	均胜电子	6,906,283.00	1.58
11	600958	东方证券	6,306,069.94	1.44
12	601088	中国神华	6,273,361.76	1.44
13	300182	捷成股份	5,425,940.76	1.24
14	601607	上海医药	4,847,400.00	1.11
15	601872	招商轮船	4,793,047.00	1.10
16	601333	广深铁路	4,689,254.00	1.07
17	002241	歌尔股份	4,127,554.04	0.94
18	600585	海螺水泥	3,900,156.92	0.89
19	600787	中储股份	3,772,963.92	0.86
20	601928	凤凰传媒	3,737,745.00	0.86

注:"本期累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	174,913,730.65
卖出股票收入(成交)总额	194,353,066.79

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	4,766,554.20	0.91
2	央行票据	–	–
3	金融债券	30,011,000.00	5.71
	其中:政策性金融债	30,011,000.00	5.71
4	企业债券	2,032,000.00	0.39
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	428,374,787.90	81.48
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	465,184,342.10	88.48

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	113008	电气转债	1,400,000	160,202,000.00	30.47
2	132006	16皖新EB	601,240	68,511,238.00	13.03
3	127003	海印转债	421,510	47,824,524.60	9.10
4	120001	16以岭EB	409,875	46,373,257.50	8.82
5	110033	国贸转债	248,760	28,507,896.00	5.42

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持有国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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	75,308.92
2	应收证券清算款	3,471,840.63
3	应收股利	–
4	应收利息	2,449,813.68
5	应收申购款	8,778.41
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,005,741.64

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	160,202,000.00	30.47
2	127003	海印转债	47,824,524.60	9.10
3	110033	国贸转债	28,507,896.00	5.42
4	110032	三一转债	26,209,818.00	4.99
5	113009	广汽转债	17,805,840.80	3.39
6	110035	白云转债	17,762,256.00	3.38
7	110034	九州转债	15,177,897.00	2.89

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601375	中原证券	8,000.00	0.00	新股锁定

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

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
民生加银转债优选A	5,324	129,598.20	653,813,173.41	94.76%	36,167,640.13	5.24%
民生加银转债优选C	2,946	29,952.62	25,987,841.95	29.45%	62,252,576.39	70.55%
合计	8,270	94,101.72	679,801,015.36	87.35%	98,420,216.52	12.65%

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)。

9.3 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	民生加银转债优选A	430.07	0.0001%
	民生加银转债优选C	1,000.96	0.0011%
	合计	1,431.03	0.0003%

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	民生加银转债优选A	0
	民生加银转债优选C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	民生加银转债优选A	0
	民生加银转债优选C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	民生加银转债优选A	民生加银转债优选C
基金合同生效日(2013年4月18日)基金份额总额	630,479,172.14	1,689,722,087.81
本报告期期初基金份额总额	387,105,206.42	131,238,192.05
本报告期基金总申购份额	427,165,730.21	574,246,705.83
减:本报告期基金总赎回份额	124,290,123.09	617,244,479.54
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	689,980,813.54	88,240,418.34

§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

基金管理人于2016年3月16日在指定媒介上披露了《民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,经基金管理人第三届董事会第十七次会议审议通过,张力女士不再担任副总经理职务。

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50,000.00元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供4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	
国金证券股份有限公司	2	141,784,483.80	38.40%	132,042.71	38.95%	本报告期新增深圳交易单元
中银国际证券有限责任公司	2	66,624,448.40	18.04%	62,048.10	18.30%	–
中国国际金融股份有限公司	2	64,194,537.73	17.38%	59,784.52	17.64%	–
中信证券股份有限公司	1	23,435,245.00	6.35%	21,825.36	6.44%	–
广发证券股份有限公司	1	17,666,616.37	4.78%	16,452.80	4.85%	–
方正证券股份有限公司	1	13,490,093.00	3.65%	9,595.67	2.83%	–
安信证券股份有限公司	2	11,221,030.82	3.04%	10,450.07	3.08%	–
华泰证券股份有限公司	2	11,213,254.28	3.04%	10,442.92	3.08%	–
中国银河证券股份有限公司	2	9,581,877.50	2.59%	7,007.15	2.07%	–
国信证券股份有限公司	1	7,018,183.54	1.90%	6,536.02	1.93%	–
东吴证券股份有限公司	1	3,029,027.00	0.82%	2,820.94	0.83%	–
申万宏源证券有限公司	2	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
国联证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
川财证券有限责任公司	1	–	–	–	–	本报告期新增深圳交易单元
东兴证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东北证券股份有限公司	1	–	–	–