

# 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

## 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十七日

## 1 重要提示及目录

### 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 3 月 25 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	44

7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.10	投资组合报告附注	44
8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
9	开放式基金份额变动	45
10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
10.2	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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	48
11	备查文件目录	49
11.1	备查文件目录	49
11.2	存放地点	49
11.3	查阅方式	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金
基金简称	浦银安盛新兴产业混合
基金主代码	519120
交易代码	519120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月25日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	318,487,044.84份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过资产的积极灵活配置，并通过重点关注国家战略新兴产业发展过程中带来的投资机会，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略：动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置。2、股票投资策略：主要采用主题投资策略，通过对战略性新兴产业的及国家政策的持续跟踪研究，结合对战略性新兴产业相关行业的发展趋势的研究分析，上市公司发展战略、商业模式、技术、工艺的分析，对属于战略性新兴产业投资主题范畴的上市公司进行重点投资。3、通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。
业绩比较基准	55%×中证新兴产业指数+ 45%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

## 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		浦银安盛基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	裴学敏
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市淮海中路 381 号中环 广场 38 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200020	200120
法定代表人		姜明生	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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	报告期（2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	34,157,326.25
本期利润	37,948,299.33
加权平均基金份额本期利润	0.0463

本期加权平均净值利润率	4.55%
本期基金份额净值增长率	0.30%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2013年6月30日)</b>
期末可供分配利润	1,067,813.93
期末可供分配基金份额利润	0.0034
期末基金资产净值	319,554,858.77
期末基金份额净值	1.003
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2013年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	0.30%

注：1、本基金合同生效日为 2013 年 3 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、上述基金业绩指标不包括持有人申购、赎回基金等各项交易费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

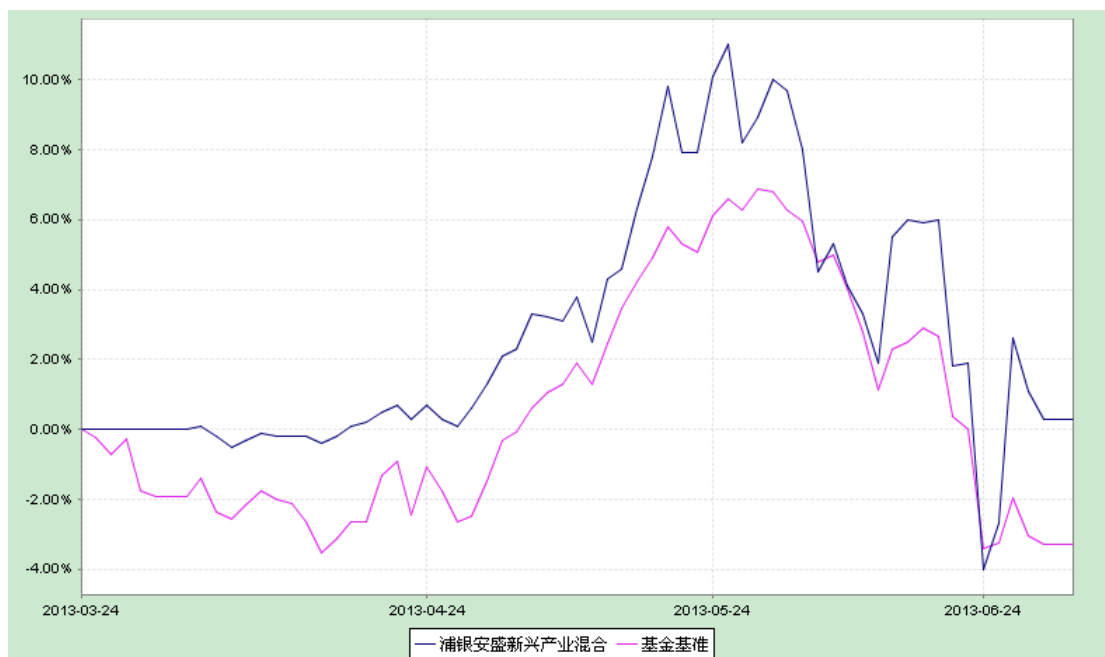
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.57%	2.54%	-8.98%	1.15%	0.41%	1.39%
过去三个月	0.30%	1.60%	-1.40%	0.92%	1.70%	0.68%
自基金合同生效起至今	0.30%	1.52%	-3.28%	0.90%	3.58%	0.62%

#### 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

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年3月25日至2013年6月30日)



注：1、本基金合同生效日为 2013 年 3 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同第十二部分第四条规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。至本报告期末本基金投资组合比例符合上述规定。

## 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

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海盛融投资有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 2.4 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至 2013 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 12 只基金，即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛分级增利债券型证券投资基金和浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金。



公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴勇	本基金基金经理，兼本公司权益投资部总监，兼浦银安盛红利精选股票基金基金经理以及浦银安盛精致生活混合型基金基金经理	2013-03-25	-	6	吴勇，上海交通大学工商管理硕士，上海交通大学材料工程系学士，CPA，CFA，中国注册造价师。1993年8月至2002年12月在上海电力建设有限责任公司任预算主管，2003年1月至2007年8月在国家开发银行上海市分行任评审经理，2007年9月起加盟浦银安盛基金管理有限公司任职研究员，2009年8月起担任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理助理。2010年2月至4月，担任浦银安盛红利精选

					股票基金基金经理助理。2010年4月起,担任浦银安盛红利精选股票基金基金经理。2011年5月起,兼任浦银安盛精致生活灵活配置混合型基金基金经理之职。2012年11月起,担任本公司权益投资部总监。自2013年3月25日起担任本基金基金经理。
褚艳辉	本公司股票型基金基金经理助理	2013-03-25	-	5	褚艳辉,南京理工大学经济学硕士。2004年8月至2008年4月间曾在上海信息中心担任宏观经济、政策研究员。2008年5月到2010年9月在爱建证券公司担任制造与消费大类行业高级研究员,后在上海汽车财务公司短暂担任投资经理助理之职。2011年4月起加盟浦银安盛基金公司从事行业研究工作。2013年2月1日起,担任公司股票基金经理助理。
王爽	本公司股票型基金基金经理助理	2013-03-25	-	5	王爽,上海华东政法大学经济、法律专业学士。2008年5月至2010年9月在天相投资顾问有限公司担任行业研究员。2010年9月起加盟浦银安盛基金公司担任行业研究员之职。2013年2月1日起,担任公司股票基金经理助理。

注: 1、吴勇作为本基金的首任基金经理,其任职日期为本基金成立之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、王爽作为本基金的首任基金经理助理,其任职日期为本基金成立之日。

4、褚艳辉作为本基金的首任基金经理助理,其任职日期为本基金成立之日。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本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，以及公司的规章制度，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已制定了《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3日，5日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初在政策放松的预期下，市场在金融、机械等周期股的带动下呈现了短暂的上冲，随后经济数据的持续低迷以及政府对于经济结构转型的表态捅破了上述幻想。随着一季报和半

年报的逐渐披露，符合经济转型方向的新兴产业如传媒、信息服务、通信、医药、乳业等板块获得市场的认可。总体来看，上述市场表现反映了国内实体经济的状况和中央强调经济结构转型的决心。从宏观经济角度来看，传统的实体经济过剩产能的状况仍然十分严重，去产能是个艰巨、长期的任务，因此从中长期来看，传统板块缺乏基本面支持。而以传媒、医药、电子消费为代表的板块在经济结构转型的背景下具有比较好的发展前景和投资机会。

战略新兴产业基金上半年建仓完成，持仓的行业的行业结构主要以传媒、信息服务、节能环保等为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自合同生效至 6 月 30 日，净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为 0.30%，基准收益率为 -3.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年是新一届政府执政的第一年，新政府在经济结构转型方面的表态和决心远大于以往。当前社会贫富差距、环境污染等问题较为严重，也预示着中国经济也到了非转型不可的地步。我们相信，基于中国巨大的经济体量和弹性，未来应该能够逐步成功转型，同时也能创造出一些欣欣向荣的新兴行业。因此，我们坚定看好符合经济转型方向的节能环保、高端装备等行业以及与大众消费相关的传媒、信息服务、医药等行业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求

对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金《基金合同》约定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金自 2013 年 3 月 25 日至 2013 年 6 月 30 日期间未进行收益分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

### **5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

2013 年上半年度，基金托管人在浦银安盛战略新兴产业混合型基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

2013 年上半年度，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛战略新兴产业混合型基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

2013 年上半年度，由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛战略新兴产业混合型基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会

计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,537,191.09	-
结算备付金		13,005,455.34	-
存出保证金		202,235.86	-
交易性金融资产	6.4.7.2	303,310,205.90	-
其中：股票投资		303,310,205.90	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,834,065.54	-
应收利息	6.4.7.5	8,520.18	-
应收股利		-	-
应收申购款		227,644.91	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		325,125,318.82	-
负 债 和 所 有 者 权 益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,858,665.65	-
应付管理人报酬	6.4.10.2	437,225.12	-
应付托管费	6.4.10.2	72,870.86	-

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,059,433.95	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	142,264.47	-
负债合计		5,570,460.05	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	318,487,044.84	-
未分配利润	6.4.7.10	1,067,813.93	-
所有者权益合计		319,554,858.77	-
负债和所有者权益总计		325,125,318.82	-

注：1、本基金合同生效日为 2013 年 3 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.003 元，基金份额总额 318,487,044.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 3 月 25 日（基金 合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>43,755,659.37</b>	-
1.利息收入		4,152,065.10	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	856,212.84	-
债券利息收入		7,959.85	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收入		3,287,892.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		34,521,004.89	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,613,849.27	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,738,223.85	-
资产支持证券投资收 益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,168,931.77	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,790,973.08	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,291,616.30	-
<b>减：二、费用</b>		<b>5,807,360.04</b>	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2	3,308,338.88	-
2. 托管费	6.4.10.2	551,389.81	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,817,813.82	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	129,817.53	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>37,948,299.33</b>	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>37,948,299.33</b>	-

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,291,090,674.37	-	1,291,090,674.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,948,299.33	37,948,299.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-972,603,629.53	-36,880,485.40	-1,009,484,114.93
其中：1. 基金申购款	22,516,889.11	1,184,539.91	23,701,429.02
2. 基金赎回款	-995,120,518.64	-38,065,025.31	-1,033,185,543.95



四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	318,487,044.84	1,067,813.93	319,554,858.77
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：郁蓓华，主管会计工作负责人：郁蓓华，会计机构负责人：赵迎华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1522 号文《关于核准浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由浦银安盛基金管理有限公司作为管理人于 2013 年 2 月 20 日至 2013 年 3 月 21 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第 60951783\_B03 号验资报告

后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,290,217,724.50 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 872,949.87 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,291,090,674.37 元，折合 1,291,090,674.37 份基金份额。

本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债、中期票据以及中国证监会允许的其他固定收益类投资品种）、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会相关规定）。

本基金的股票投资比例为基金资产的 0%–95%，其中投资于战略新兴产业及其相关行业股票的比例不低于股票资产的 80%；投资于权证的比例不超过基金净资产的 3%；现金、债券资产、中国证监会允许基金投资的其他证券品种及其他资产占基金净资产比例为 0%–95%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：55%×中证新兴产业指数+ 45%×中信标普全债指数

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）起至 2013 年 6 月 30 日止。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### **1 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资；

###### **2 金融负债分类**

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### **6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收

益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### 1 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法结转；

#### 2 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### 3 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价

的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

### 1 股票投资

(1) 证券交易所市场交易的股票按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市股票、定向增发股票、长期停牌股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

### 2 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

2 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

3 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

4 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与

合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

5 股票投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本的差额入账；

6 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

7 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

8 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

1 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率逐日计提；

2 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率逐日计提；

3 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次期末可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

##### 6.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款



单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	6,537,191.09
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,537,191.09

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		299,519,232.82	303,310,205.90	3,790,973.08
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		299,519,232.82	303,310,205.90	3,790,973.08

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	3,171.12
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	5,267.16
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
其他	81.90
合计	8,520.18

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,058,058.77
银行间市场应付交易费用	1,375.18
合计	1,059,433.95

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,542.63
预提费用	127,721.84
合计	142,264.47

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,291,090,674.37	1,291,090,674.37
本期申购	22,516,889.11	22,516,889.11
本期赎回（以“-”号填列）	-995,120,518.64	-995,120,518.64
本期末	318,487,044.84	318,487,044.84

注：本基金合同于2013年3月25日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,290,217,724.50元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币872,949.87元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,291,090,674.37元，折合1,291,090,674.37份基金份额。

**6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	34,157,326.25	3,790,973.08	37,948,299.33
本期基金份额交易产生的	-11,504,179.79	-25,376,305.61	-36,880,485.40

变动数			
其中：基金申购款	1,266,280.03	-81,740.12	1,184,539.91
基金赎回款	-12,770,459.82	-25,294,565.49	-38,065,025.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,653,146.46	-21,585,332.53	1,067,813.93

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
活期存款利息收入	710,485.34
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	145,351.81
其他	375.69
合计	856,212.84

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
卖出股票成交总额	506,078,267.76
减：卖出股票成本总额	475,464,418.49
买卖股票差价收入	30,613,849.27

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月25日（基金合同生效日）至 2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,003,353.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	27,242,352.54
减：应收利息总额	22,777.51
债券投资收益	1,738,223.85

## 6.4.7.14 衍生工具收益

## 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,168,931.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,168,931.77

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	3,790,973.08
——股票投资	3,790,973.08
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,790,973.08

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
基金赎回费收入	1,291,489.66
其他	126.64
合计	1,291,616.30

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
交易所市场交易费用	1,817,813.82
银行间市场交易费用	-
合计	1,817,813.82

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日
审计费用	24,163.67
信息披露费	103,558.17
银行汇划费用	1,195.69

沪深股东帐户开户费	900.00
合计	129,817.53

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管	3,308,338.88	-

理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	1,612,662.76	-

注：在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	551,389.81	-

注：在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期末持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2013 年 3 月 25 日，无上年度可比期间。

##### 6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2013 年 3 月 25 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.5 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 2013年3月25日（基金合同生效日）至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	6,537,191.09	710,485.34	-	-

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300020	银江股份	2013-06-03	资产重组	21.22	-	-	189,191	3,717,269.65	4,014,633.02	-
601886	江河创建	2013-06-20	未刊登重要事项	12.20	2013-07-16	13.78	253,656	2,770,331.84	3,094,603.20	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只偏股型的混合型证券投资基金，属于中高风险品种，一般情形下，其风险和收益低于股票型基金，高于货币型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，谋求实现基金财产的安全和增值。

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、合规风控部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立合规风控部，独立地监控公司面临的各类风险。合规风控部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险



信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,因此违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

于 2013 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

于 2013 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因

此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,537,191.09	-	-	-	6,537,191.09
结算备付金	13,005,455.34	-	-	-	13,005,455.34
存出保证金	202,235.86	-	-	-	202,235.86
证券清算款	-	-	-	1,834,065.54	1,834,065.54
交易性金融资产	-	-	-	303,310,205.90	303,310,205.90
买入返售金	-	-	-	-	-

融资产					
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,520.18	8,520.18
应收申购款	-	-	-	227,644.91	227,644.91
其他应收款	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,744,882.29	-	-	305,380,436.53	325,125,318.82
负债					
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,858,665.65	3,858,665.65
应付赎回费	-	-	-	14,542.63	14,542.63
应付管理人 报酬	-	-	-	437,225.12	437,225.12
应付托管费	-	-	-	72,870.86	72,870.86
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	1,059,433.95	1,059,433.95
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付收益	-	-	-	-	-
其他应付款	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	127,721.84	127,721.84
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	5,570,460.05	5,570,460.05
利率敏感度 缺口	19,744,882.29	-	-	299,809,976.48	319,554,858.77
上年度末 2012年12月	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

31日					
资产					
银行存款					
结算备付金					
存出保证金					
证券清算款					
交易性金融资产					
买入返售金融资产					
应收股利					
应收利息					
应收申购款					
其他应收款					
待摊费用					
其他资产					
资产总计	-	-	-	-	-
负债					
卖出回购金融资产款					
应付证券清算款					
应付赎回款					
应付赎回费					
应付管理人报酬					
应付托管费					
应付销售服务费					
应付交易费用					
应交税费					
应付利息					

应付收益					
其他应付款					
预提费用					
其他负债					
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度 缺口	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类；本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%，因此 2013 年 6 月 30 日市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响；本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 30-80%，债券、现金及其它短期金融工具为 20-70%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	303,310,205.90	94.92	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	303,310,205.90	94.92	-	-

注：本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加19,953,874.82	-
	业绩比较基准下降5%	减少19,953,874.82	-

注：本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

## 7.1 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	303,310,205.90	93.29
	其中：股票	303,310,205.90	93.29
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	19,542,646.43	6.01
6	其他各项资产	2,272,466.49	0.70
7	合计	325,125,318.82	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	3,874,562.10	1.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	146,702,602.13	45.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,970,691.31	7.81
F	批发和零售业	7,875,956.09	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,793,289.83	20.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,976,814.44	2.18
L	租赁和商务服务业	10,828,974.84	3.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,930,400.00	0.92
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	34,356,915.16	10.75
S	综合	-	-
	合计	303,310,205.90	94.92

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002570	贝因美	555,842	15,535,783.90	4.86
2	600880	博瑞传播	691,106	12,184,198.78	3.81
3	300071	华谊嘉信	677,658	10,828,974.84	3.39
4	002310	东方园林	255,657	9,789,106.53	3.06
5	002055	得润电子	927,359	9,505,429.75	2.97
6	300168	万达信息	340,454	9,188,853.46	2.88
7	300336	新文化	229,366	8,892,519.82	2.78
8	300155	安居宝	639,901	8,881,825.88	2.78
9	300074	华平股份	477,301	8,639,148.10	2.70
10	600498	烽火通信	489,900	8,073,552.00	2.53
11	002008	大族激光	699,961	7,832,563.59	2.45
12	300136	信维通信	320,102	7,778,478.60	2.43
13	300075	数字政通	246,783	6,983,958.90	2.19
14	300183	东软载波	238,579	6,723,156.22	2.10
15	300197	铁汉生态	263,746	6,670,136.34	2.09
16	300083	劲胜股份	384,007	6,512,758.72	2.04
17	002052	同洲电子	913,400	6,457,738.00	2.02
18	600312	平高电气	630,309	5,811,448.98	1.82
19	000050	深天马 A	449,960	5,278,030.80	1.65
20	000400	许继电气	189,431	5,129,791.48	1.61
21	300291	华录百纳	141,926	5,068,177.46	1.59
22	300002	神州泰岳	313,439	5,011,889.61	1.57
23	002429	兆驰股份	645,000	4,831,050.00	1.51
24	300188	美亚柏科	294,724	4,815,790.16	1.51
25	002253	川大智胜	330,000	4,755,300.00	1.49
26	300115	长盈精密	139,172	4,472,988.08	1.40
27	300270	中威电子	216,752	4,395,730.56	1.38
28	300315	掌趣科技	131,782	4,346,170.36	1.36
29	002589	瑞康医药	94,648	4,025,379.44	1.26
30	300020	银江股份	189,191	4,014,633.02	1.26
31	600067	冠城大通	499,966	3,994,728.34	1.25
32	002250	联化科技	167,783	3,353,982.17	1.05
33	002690	美亚光电	138,548	3,329,308.44	1.04
34	600633	浙报传媒	150,000	3,235,500.00	1.01
35	300251	光线传媒	99,910	3,198,119.10	1.00
36	600587	新华医疗	75,143	3,113,925.92	0.97
37	601886	江河创建	253,656	3,094,603.20	0.97
38	300212	易华录	100,536	3,016,080.00	0.94
39	002573	国电清新	180,000	2,930,400.00	0.92
40	300311	任子行	116,900	2,793,910.00	0.87



41	002313	日海通讯	159,080	2,623,229.20	0.82
42	002649	博彦科技	100,000	2,475,000.00	0.77
43	600594	益佰制药	80,028	2,473,665.48	0.77
44	600038	哈飞股份	109,929	2,464,608.18	0.77
45	300293	蓝英装备	179,000	2,416,500.00	0.76
46	000963	华东医药	59,889	2,386,576.65	0.75
47	300281	金明精机	302,802	2,358,827.58	0.74
48	300090	盛运股份	75,960	2,345,644.80	0.73
49	002431	棕榈园林	119,894	2,273,190.24	0.71
50	000559	万向钱潮	399,951	2,099,742.75	0.66
51	002041	登海种业	98,200	2,084,786.00	0.65
52	000961	中南建设	207,000	2,024,460.00	0.63
53	300110	华仁药业	238,332	1,880,439.48	0.59
54	300106	西部牧业	118,922	1,789,776.10	0.56
55	300148	天舟文化	130,000	1,778,400.00	0.56
56	300043	星辉车模	165,450	1,760,388.00	0.55
57	600079	人福医药	66,189	1,726,209.12	0.54
58	002138	顺络电子	92,200	1,659,600.00	0.52
59	002241	歌尔声学	43,744	1,587,469.76	0.50
60	002146	荣盛发展	110,916	1,565,024.76	0.49
61	002268	卫士通	100,000	1,508,000.00	0.47
62	300001	特锐德	99,928	1,488,927.20	0.47
63	600387	海越股份	100,000	1,464,000.00	0.46
64	300349	金卡股份	35,301	1,440,633.81	0.45
65	002273	水晶光电	68,882	1,266,739.98	0.40
66	600418	江淮汽车	172,164	1,210,312.92	0.38
67	002308	威创股份	130,000	1,196,000.00	0.37
68	002325	洪涛股份	94,050	1,119,195.00	0.35
69	300024	机器人	30,000	1,114,500.00	0.35
70	300241	瑞丰光电	76,934	965,521.70	0.30
71	300072	三聚环保	60,000	963,000.00	0.30
72	300026	红日药业	24,865	843,918.10	0.26
73	002305	南国置业	100,947	832,812.75	0.26
74	000656	金科股份	47,779	553,758.61	0.17
75	002467	二六三	30,000	521,400.00	0.16
76	300128	锦富新材	16,900	338,000.00	0.11
77	600559	老白干酒	6,667	177,342.20	0.06
78	600340	华夏幸福	937	30,489.98	0.01
79	002450	康得新	250	6,995.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002570	贝因美	36,981,680.03	11.57
2	000400	许继电气	27,081,781.78	8.47
3	002273	水晶光电	22,979,935.82	7.19
4	600587	新华医疗	21,353,908.86	6.68
5	002106	莱宝高科	20,043,917.26	6.27
6	600312	平高电气	19,949,476.07	6.24
7	002052	同洲电子	19,561,360.97	6.12
8	300090	盛运股份	19,159,552.07	6.00
9	000625	长安汽车	19,152,459.35	5.99
10	002310	东方园林	17,512,363.33	5.48
11	300002	神州泰岳	17,311,254.10	5.42
12	600563	法拉电子	17,178,321.05	5.38
13	002008	大族激光	17,097,109.27	5.35
14	002250	联化科技	16,465,211.36	5.15
15	002055	得润电子	16,335,897.42	5.11
16	300197	铁汉生态	13,969,757.79	4.37
17	300212	易华录	13,342,284.90	4.18
18	300168	万达信息	12,727,733.11	3.98
19	002146	荣盛发展	11,321,840.76	3.54
20	600880	博瑞传播	11,161,270.92	3.49
21	300336	新文化	10,244,807.21	3.21
22	600559	老白干酒	10,055,397.41	3.15
23	300155	安居宝	10,042,515.60	3.14
24	600199	金种子酒	9,961,350.00	3.12
25	000050	深天马 A	9,766,459.49	3.06
26	300071	华谊嘉信	9,369,940.14	2.93
27	002429	兆驰股份	9,144,693.53	2.86
28	601888	中国国旅	9,140,360.29	2.86
29	300136	信维通信	8,733,404.47	2.73
30	002305	南国置业	8,398,773.10	2.63
31	300074	华平股份	8,292,768.74	2.60
32	000961	中南建设	8,241,628.09	2.58
33	600073	上海梅林	7,813,423.00	2.45
34	002589	瑞康医药	7,741,039.15	2.42

35	300083	劲胜股份	7,657,975.19	2.40
36	002168	深圳惠程	7,576,155.28	2.37
37	600340	华夏幸福	7,461,397.15	2.33
38	600079	人福医药	7,323,872.70	2.29
39	300291	华录百纳	7,257,677.90	2.27
40	600498	烽火通信	7,134,965.80	2.23
41	300075	数字政通	6,628,500.45	2.07
42	600418	江淮汽车	6,602,303.02	2.07
43	300188	美亚柏科	6,449,451.00	2.02

## 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000400	许继电气	26,920,271.86	8.42
2	300090	盛运股份	24,772,294.23	7.75
3	002570	贝因美	22,031,659.15	6.89
4	002106	莱宝高科	21,252,365.55	6.65
5	002273	水晶光电	20,745,847.37	6.49
6	600587	新华医疗	19,535,342.88	6.11
7	000625	长安汽车	18,836,077.17	5.89
8	600563	法拉电子	15,692,608.89	4.91
9	600312	平高电气	15,089,806.00	4.72
10	002052	同洲电子	14,400,659.26	4.51
11	300002	神州泰岳	13,675,029.97	4.28
12	300212	易华录	12,707,842.58	3.98
13	002250	联化科技	12,472,487.57	3.90
14	002146	荣盛发展	10,290,191.56	3.22
15	002055	得润电子	9,997,771.97	3.13
16	601888	中国国旅	9,560,019.38	2.99
17	002008	大族激光	9,558,583.85	2.99
18	600199	金种子酒	8,903,486.85	2.79
19	600559	老白干酒	8,237,063.54	2.58
20	600073	上海梅林	8,153,388.30	2.55
21	600340	华夏幸福	8,083,353.90	2.53
22	002310	东方园林	7,974,267.61	2.50
23	002305	南国置业	7,871,156.49	2.46
24	002168	深圳惠程	6,733,276.14	2.11
25	300168	万达信息	6,430,946.64	2.01

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	774,983,651.31
卖出股票的收入（成交）总额	506,078,267.76

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

无。

#### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

#### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.10.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

#### 7.10.3 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	202,235.86
2	应收证券清算款	1,834,065.54
3	应收股利	-
4	应收利息	8,520.18
5	应收申购款	227,644.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,272,466.49
---	----	--------------

## 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,874	82,211.42	22,963,367.81	7.21%	295,523,677.03	92.79%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	680,172.43	0.21%

注：1、本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量在 10 万份—50 万份（含）之间；

2、本基金的基金经理持有该只基金份额总量在 0—10 万份（含）之间。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 25 日）基金份额总额	1,291,090,674.37
基金合同生效日起至报告期期末总申购份额	22,516,889.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	995,120,518.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	318,487,044.84
-------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本基金管理人总经理郁蓓华女士经 2013 年第二次股东会会议审议批准，自 2013 年 3 月起出任公司第二届董事会董事。基金管理人于 2 季度就上述事项完成向监管机关的报备。另外，朱敏奕女士自 2013 年 3 月起出任公司职工监事。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 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	
招商证券股份有限公司	2	1,100,041,653.07	85.87%	1,001,478.14	85.87%	-
东兴证券	1	181,020,266.00	14.13%	164,801.49	14.13%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

## (1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

## (2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无交易单元变更。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	56,260,524.10	100.00%	18,361,900,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛基金管理有限公司关于独立董事变更的公告	报刊及公司网站	2013-2-6
2	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书	报刊及公司网站	2013-2-8
3	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金合同	报刊及公司网站	2013-2-8
4	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金托管协议	报刊及公司网站	2013-2-8
5	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金发售公告	报刊及公司网站	2013-2-8
6	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金合同内容摘要	报刊及公司网站	2013-2-8
7	关于新增好买基金和天相投顾为浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2013-2-22
8	关于新增中信证券（浙江）、中信万通和万联证券为浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2013-3-1
9	关于新增数米基金为浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2013-3-8
10	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金合同生效公告	报刊及公司网站	2013-3-26
11	浦银战略新兴产业混合型基金开放日常申购、赎回业务公告	报刊及公司网站	2013-4-24
12	浦银战略新兴产业混合型基金在交通银行推出定期定额投资业务并参加申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-5-3
13	浦银安盛基金管理有限公司关于郁蓓华董事任职的公告	报刊及公司网站	2013-6-25
14	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-6-25
15	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-6-26
16	关于旗下部分基金在好买基金销售开通定期定额投资业务并参加定期定额费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-6-28
17	关于旗下部分基金在上海证券推出定期定额投资业务并参加网上申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-6-28



## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金设立的文件
- 2、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司  
二〇一三年八月二十七日