

---

**浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金**  
**2013 年年度报告**  
**2013 年 12 月 31 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：二〇一四年三月二十七日

---

## § 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 2014 年 3 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。

本报告期自 2013 年 3 月 25 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	1
1.1	重要提示 .....	1
§ 2	基金简介 .....	4
2.1	基金基本情况 .....	4
2.2	基金产品说明 .....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式 .....	5
2.5	其他相关资料 .....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现 .....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 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.....	10
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的说明.....	12
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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
§ 5	托管人报告 .....	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6	审计报告 .....	18
6.1	管理层对财务报表的责任.....	19
6.2	注册会计师的责任 .....	19
6.3	审计意见 .....	19
§ 7	年度财务报表 .....	21
7.1	资产负债表 .....	21
7.2	利润表 .....	22
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4	报表附注 .....	24
§ 8	投资组合报告 .....	48
8.1	期末基金资产组合情况.....	48
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3	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 .....	49
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6	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 .....	62
8.7	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 .....	62
8.8	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 .....	62

---

8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.11	投资组合报告附注 .....	63
§ 9	基金份额持有人信息 .....	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
§ 10	开放式基金份额变动 .....	64
§ 11	重大事件揭示 .....	65
11.1	基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4	基金投资策略的改变 .....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
11.8	其他重大事件 .....	67
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 13	备查文件目录 .....	68
13.1	备查文件目录 .....	68
13.2	存放地点 .....	69
13.3	查阅方式 .....	69

## § 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	92,498,428.19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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2013年3月25日（基金合同生效日）至 2013年12月31日	2012年	2011年
本期已实现收益	82,529,987.49	-	-
本期利润	82,587,502.07	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.2261	-	-
本期加权平均净值利润率	21.43%	-	-
本期基金份额净值增长率	13.30%	0%	0%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	12,282,214.97	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.1328	-	-
期末基金资产净值	104,780,643.16	-	-
期末基金份额净值	1.133	-	-
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末

基金份额累计净值增长率	13.30%	-	-
-------------	--------	---	---

注：1、本基金《基金合同》2013年3月25日生效。以上财务指标中“本期”指2013年3月25日（基金成立日）至2013年12月31日止期间。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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。

6、本基金《基金合同》生效日为2013年3月25日，至报告期末，合同成立未满一年

### 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

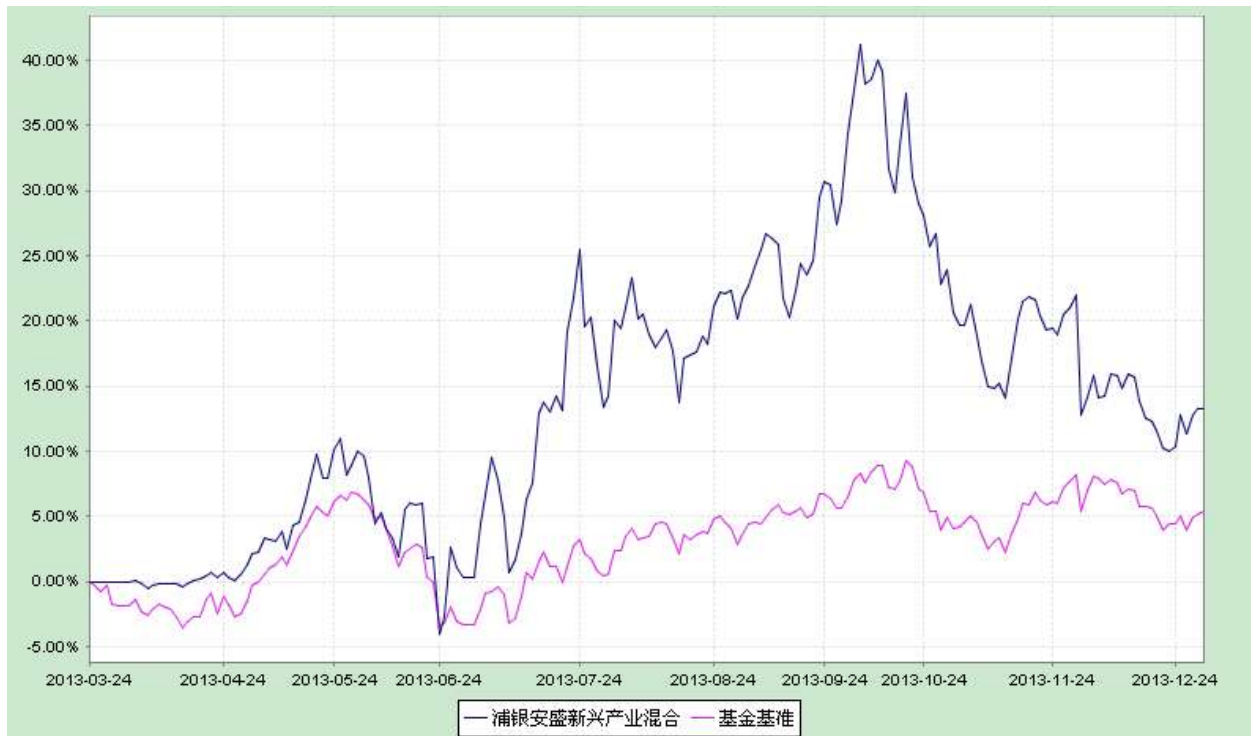
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.64%	1.93%	-0.94%	0.84%	-14.70%	1.09%
过去六个月	12.96%	2.09%	9.03%	0.84%	3.93%	1.25%
自基金合同生效起至今	13.30%	1.91%	5.45%	0.86%	7.85%	1.05%

#### 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12月31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。

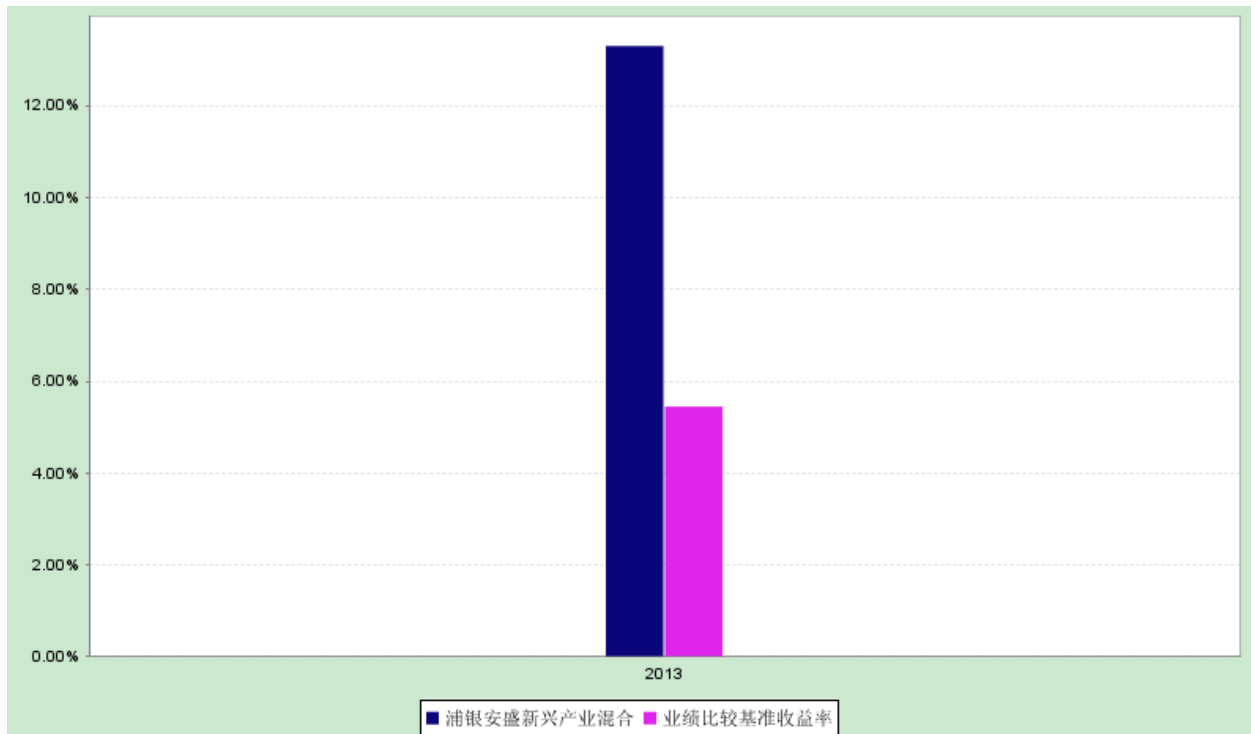
2、根据基金合同第十二部分第四条规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2013 年 3 月 25 日至 2013 年 9 月 24 日，建仓期结束时本基金投资组合比例符合本基金基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图





注：本基金合同于 2013 年 3 月 25 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

## § 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 2.8 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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 13 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、浦银安盛增利分级债券型证券投资基金、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和浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金。

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了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	本公司权益投资部总监，本基金基金经理、浦银安盛精致生活混合基金基金经理、浦银安盛红利精	2013-03-25	-	6	吴勇先生，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的基金经理助理。2010年4月起，担任浦银安盛红利精

	选股票基金基金经理以及浦银安盛消费升级灵活配置混合基金基金经理				选股票基金基金经理。2011年5月起，兼任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理。2012年11月起，担任本公司权益投资部总监。2013年3月起，兼任本基金基金经理。2013年12月起，兼任浦银安盛消费升级灵活配置混合基金基金经理。
褚艳辉	本公司旗下权益类基金基金经理助理	2013-03-25	-	9	褚艳辉先生，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月起加盟我司担任高级行业研究员。2013年2月起，担任本公司权益类基金基金经理助理。
王爽	本公司旗下权益类基金基金经理助理	2013-03-25	-	5	王爽女士，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管理有限公司担任行业研究员之职。2013年2月起，担任本公司权益类基金基金经理助理。

注：1、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、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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 公平交易制度和控制方法

管理人于 2009 年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》(以下简称公平交易管理规定), 并分别于 2011 年及 2012 年进行了两次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节, 预防和发现可能违反公平交易的异常情况, 并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括:

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度, 不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台;
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系;
- 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离, 不得相互兼任、互为备份;
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易;
- 执行投资交易系统中的公平交易程序;
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行, 并对该分配过程进行监控;
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估;
- 对不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易, 投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明, 并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人根据《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投资组合。

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。

#### **4.3.3 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的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2013 年对于中国经济和资本市场来说是个转折年。利率市场化的推进导致全年资金成本处于高位，对银行等高负债传统行业的盈利前景造成了较大的压力；政府加大了经济结构转型的力度——容忍较低的经济增速，增强信息安全、文化、节能环保等新兴行业的支持力度，强调传统行业的转型和过剩产能的压缩。以上种种对国内资本市场产生了深远的影响，代表新兴产业和经济结构转型的信息服务、计算机、通信、传媒文化、医药等板块表现较好，而传统行业的银行、煤炭、钢铁等板块表现较弱。

战略新兴产业基金在 2013 年保持了信息服务、计算机、通信、传媒等板块的超配，而在银行、钢铁、煤炭等板块保持了低配。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

自基金合同生效至年末，净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为 13.30%，基准收益率为 5.45%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

新一届在经济结构转型方面的决心很大，我们相信，鉴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，我们看好符合经济转型方向的信息服务、计算机、传媒、节能环保、高端装备、医药等行业。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，强化风险及合规管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。2013年，合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理，积极配合公司前台业务的完善一线风险管控工作，并协调、监督全公司和投资组合的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及内部控制工作。

##### 1、进一步健全合规风控团队，提高团队的专业素养

2013年，随着公司管理投资组合的数量与规模大幅提升，合规风控团队也不断加强自身专业素质的提升，强化全面专业素质，鼓励和支持合规风控人员参与相关的专业考试和学习。目前合规风控团队内部形成了良好的学习和业务研讨的氛围，团队成员各自发挥自身优势，相互取长补短，专业素质得到均衡提升，在内部形成了互帮互学、共同提高、自然和谐的良好局面。

在内部管理上，合规风控团队进一步健全合规风控工作的各项规章制度和 workflows，进一步明确各岗位人员的工作职责，强化自觉、客观的工作态度和高度的工作责任感，培养团队协作精神。

##### 2、进一步建立健全风险控制体系

###### (1) 对投资组合进行定期业绩归因分析和风险评估

合规风控部在原有每月对投资组合的业绩及风险情况进行评估的基础上，进一步完善了每日、每周的风险评估。特别是对固定收益投资，初步建立了量化的预警风险评估体系。同时，建议固定收益部采取三级债券库控制体系，就个券流动性、信用评级等方面明确评定标准、流程及各岗位职责，将个券风险控制纳入固定收益研究过程。

###### (2) 进一步强化风险报告要求

2013年，积极执行贯彻了风险等级划分及评估体系，将风险分为重大、高、中、低四个等级。不同等级风险对应不同的报告时间及形式要求。该风险分级评估及报告工作由合规风控部牵头，组织公司所有业务部门每月对本部门风险事件进行评估报告，并形成评估结果，并配合人力资源部将风险报告执行情况和评估结果纳入年终风险系数考核。

###### (3) 对公司新产品提供高效、有力的支持

2013年，公司新发行了12只专户产品，4只公募基金。合规风控部与投资团队、产品团队、运营团队合作，就各产品的流动性风险、市场风险、信用风险等方面进行分析，制定相应的风险控制措施和投资控制指标。

###### (4) 初步建立子公司内部控制体系

---

2013年年底，初步建立了子公司多层次的内部控制体系：

1) 业务部门的一线风险控制。子公司设金融市场部和运营管理部两大业务部门，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定及子公司的规章制度，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任；

2) 子公司设独立的风险管理部，负责对子公司内部控制和风险控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的风险管控、检查和评价；

3) 管理层的控制。管理层下设项目评审及决策委员会以及风险控制委员会，采取集体决策制，管理和监督各个部门和各项业务进行，以确保子公司运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任；

4) 执行董事及监事的监控和指导。所有员工应自觉接受并配合执行董事及监事对各项业务和工作行为的检查监督，合理的风险分析和管理建议应予采纳。执行董事对内部控制负最终责任；

5) 母公司及其董事会通过稽核检查、审阅报告、参与会议等方式监督子公司内部控制和风险控制情况。

### 3、稽核工作

根据相关法规要求、公司的实际运作情况及稽核计划，合规风控团队有重点、分步骤、有针对性地对公司的业务和合规运作，以及执行法规和制度的情况进行稽核，并在稽核后督促整改和跟踪检查。在有效控制公司的风险以及推动公司内控监管第二道和第三道防线方面发挥了积极的作用。

稽核工作主要采取定期稽核与不定期稽核相结合、常规稽核与专项稽核相结合的方式。定期稽核的结果主要体现在月度合规报告及季度监察稽核报告中。不定期稽核主要是就定期稽核中发现的问题，与业务部门进行沟通，帮助各部门及时完善和改进工作。不定期稽核的结果主要体现在合规报告及整改反馈表中。

此外，合规风控团队还负责与负责公司内控评价的会计师事务所联系和沟通，配合公司的业务开展。

2013年实施的专项稽核包括：

(1) 完成对2013年反洗钱工作的内部稽核和反洗钱自评估工作；

(2) 根据监管机构对全行业的统一要求，对内幕交易、投管人员行为及利益输送等方面进行专项稽核；

总体来说，2013年度，由于人员配备的原因，并未就所有业务开展全面并深入的稽核工作。2014年，待有关人员招聘到位后，将着重加强各部门制度执行及操作风险的稽核工作。

### 4、实施合规性审核

---

依据法律法规和公司制度对以下材料进行了审核：

(1) 对基金宣传推介材料、公司宣传品、网站资料、客户服务资料、渠道用信息、以公司名义对外发布的新闻等进行了合规性审核，力求公司对外材料的合法合规性；

(2) 2013 年，与公司专业法律顾问一起，对公司发行的基金和专户产品法律文件的合法合规性进行了全面审核；

(3) 对一级市场数百个证券的申购，从关联交易角度进行合法合规性审核，未出现在一级市场投资与公司存在禁止关联交易的关联关系公司发行证券的情形。

## 5、信息披露和文件报送

由于公司信息披露的负责人设在合规风控部，因此，合规风控部指定专人负责并协调公司的信息披露工作，督察长对信息披露工作进行指导、督促、监督、检查。信息披露工作包括拟定披露的文件格式、收集相关部门填写的内容并进行统稿和审核、对定稿的信息披露文件排版、制作成 PDF 文件向监管机关报备等。

信息披露工作是一项繁杂的事物性工作，需要信息披露负责人耐心、细致、认真的工作态度和较强的协调能力，不仅涉及到披露的格式，还涉及披露的内容，以及整理、审阅和报送等。该项工作虽然占据了合规风控团队很多时间，但由于团队成员的工作认真、仔细，所有的披露均做到了及时、准确，基本未出现迟披、漏披、延披、错披的情形。

2013 年，按时按质完成基金定期报告（月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告）和招募说明书更新的提示及合规审核工作，并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制，及时进行合规审核，并安排公告的披露及上报事宜。2013 年全年共审核并安排披露、上报数百份公告及报告，未出现重大迟、漏等现象。

## 6、法律事务

对公司签署的上百份协议、合同等进行了法律审核，在合理范围内最大限度地防范由合同产生的违约风险及侵权风险，同时，根据中国证监会发布的关于销售费用及反洗钱等相关法律法规，对基金代销协议模板进行了更新；参与起草、审阅并修改董事会、股东会会议通知、决议等会议材料。此外，合规风控团队还负责与公司法律和基金产品律师联系和沟通，配合公司的业务开展。

全年的法务工作基本做到了有序而高效，积极协助了公司业务的正常开展，公司未发生诉讼或仲裁现象，较好地控制了法律风险。

## 7、组织开展合规培训

根据工作安排，合规风控团队负责公司的合规培训工作，合规培训包括新员工入司培训、重大新法规培训、从业人员投资限制培训、新股发行体制改革培训、退市机制改革培训等。培训前，合规风



---

控团队会商量每次培训的议题和内容，并准备书面培训材料；培训中，采取讲实例的互动培训方式；培训后，积极听取员工的建议，以期不断改进培训效果。

(1) 对于 2013 年新入司员工分多场进行了入职合规培训，内容包括公司制度流程体系、主要业务法律法规、公司利益冲突管理要求等。对于外地同事，则采取先发送书面培训材料，待其来司时再进行面对面培训的方式；

(2) 由于中国证券业协会每年会安排 15 小时左右的远程在线合规培训。为避免占用业务人员过多工作时间以及培训内容过多重复，2013 全年为业务人员提供了共 4 场 8 小时的专项合规培训；

(3) 对反洗钱领导小组及反洗钱骨干人员开展了共 2 小时的反洗钱合规培训。

合规培训部分提高和增强了员工的合规守法意识，促进了公司业务的合规运作。

#### 8、督导和推动公司的制度建设和完善

督导和推动公司的制度建设和完善是合规风控团队的重要工作之一。合规风控团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

#### 9、组织进行反洗钱工作

公司反洗钱工作由合规风控团队组织和牵头。全年开展的反洗钱工作包括：(1) 完善反洗钱相关制度；(2) 利用反洗钱监控系统从 TA 数据中心自动抓取数据，对可疑交易进行适时监控；(3) 向中国人民银行定期报送可疑交易；(4) 定期向人民银行报送非现场监管报表；(5) 进行反洗钱的合规培训；(6) 进行反洗钱的专项审计。

#### 10、落实监管政策和要求，配合和协助监管机关的现场调研

与监管机关的沟通和交流主要由督察长和合规风控部负责，总体来说，在落实监管机关的监管政策和要求方面的工作包括：

(1) 收发监管机关的所有文件，传达监管机关的政策，从收文和报送环节进行协调和督促；

(2) 组织、协调和督导公司的专项自查；

(3) 代表公司参与上海基金同业公会的相关会议。

#### 11、督导处理投资人的投诉

公司已经建立了投资人投诉的处理机制，合规风控团队负责指导、督促客服中心妥善处理投资人的重大投诉，包括商量投诉处理的反馈内容、形式和解决方法等，避免了因投资人投诉致使公司品牌和声誉受损的情形发生。

#### 12、向董事会报告公司经营的合法合规情况

根据《公司章程》的要求，定期向董事会报告公司经营的合法合规情况。报告的形式包括：(1) 书面报告：通过季度和年度监察稽核报告的形式；(2) 当面报告：通过在董事会会议以及合规与审计

---

委员会会议汇报的形式；（3）电邮或电话：当董事想了解公司的合规经营情况或提出一些问题时，通过电子邮件或电话的形式进行沟通和汇报。

### 13、与中介机构的协调

合规风控团队负责与律师事务所和审计师事务所的日常工作协调，包括：

（1）与律师事务所：就重大制度修订事项、基金产品募集、专户产品审核、高管和董事的任免出具法律意见书。

（2）与审计师事务所：就公司的内控评价工作建立了与普华永道会计师事务所日常沟通和协调的机制。

回顾过去的 2013 年，从董事会、管理层到员工，对合规风控工作都比以前有了更多的重视和理解、支持，合规风控团队与公司各部门的联系日益紧密和协调，这为公司合规风控工作的开展进一步奠定了良好基石。

## 4.7 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。

本基金管理人已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》。

## 4.8 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》第十六部分第三条约定，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。

本基金自 2013 年 3 月 25 日至 2013 年 12 月 31 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 年度，基金托管人在浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金的托管过程中，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证券投资基金投资运作、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证券投资基金的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 审计报告

安永华明（2014）审字第 60951783\_B04 号

浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表和 2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 边卓群 濮晓达

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2014-03-26

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明（2014）审字第60951783_B04号
审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金财务报表，包括2013年12月31日的资产负债表和2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年12月31日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金2013年12月31日的财务状况以及2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	边卓群 濮晓达
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2014-03-26

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,275,121.16	-
结算备付金		2,699,727.32	-
存出保证金		256,982.54	-
交易性金融资产	7.4.7. 2	94,219,111.91	-
其中：股票投资		94,219,111.91	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7. 3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7. 4	-	-
应收证券清算款		1,183,471.47	-
应收利息	7.4.7. 5	6,650.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,134.64	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7. 6	-	-
资产总计		107,648,199.71	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		703,953.55	-

应付赎回款		497,685.78	-
应付管理人报酬	7.4.10.2	137,200.77	-
应付托管费	7.4.10.2	22,866.81	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,133,973.97	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	371,875.67	-
负债合计		2,867,556.55	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	92,498,428.19	-
未分配利润	7.4.7.10	12,282,214.97	-
所有者权益合计		104,780,643.16	-
负债和所有者权益总计		107,648,199.71	-

注：1、本财务报表的实际编制期间自 2013 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间。

2、报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.133 元，基金份额总额 92,498,428.19 份。

3、本基金《基金合同》生效日为 2013 年 3 月 25 日，至报告期末，合同成立未满一年

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013年3月25日（基金合同生效日）至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>93,617,330.79</b>	-
1. 利息收入		4,318,665.10	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,005,597.67	-
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		3,305,107.58	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		87,509,467.73	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	83,644,671.97	0.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,738,223.85	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,126,571.91	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	57,514.58	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,731,683.38	-
<b>减：二、费用</b>		<b>11,029,828.72</b>	-
1. 管理人报酬		4,464,798.91	-
2. 托管费		744,133.21	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,438,701.43	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	382,195.17	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>82,587,502.07</b>	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>82,587,502.07</b>	-

注：本基金《基金合同》生效日为 2013 年 3 月 25 日，至报告期末，合同成立未满一年。

### 7.3 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 12 月 31 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12月31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	-	82,587,502.07	82,587,502.07



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）	-1,198,592,246.18	-70,305,287.10	-1,268,897,533.28
其中：1. 基金申购款	97,203,592.18	19,133,168.26	116,336,760.44
2. 基金赎回款	-1,295,795,838.36	-89,438,455.36	-1,385,234,293.72
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）	92,498,428.19	12,282,214.97	104,780,643.16
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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《基金合同》生效日为 2013 年 3 月 25 日，至报告期末，合同成立未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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： $55\% \times \text{中证新兴产业指数} + 45\% \times \text{中信标普全债指数}$

#### **7.4.2 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。

#### **7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 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12月31日止。

#### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

#### **7.4.4.3 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、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

##### **(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。

#### **7.4.4.4 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股票、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或现金股利，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于成交日结转；

(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) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 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。

#### 7.4.4.5 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) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。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) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，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，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

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) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。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) 未上市流通的权证，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，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

### 5) 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### **7.4.4.8 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)”。

#### **7.4.4.9 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)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金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)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)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；

(10)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。

#### **7.4.4.10 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。

#### **7.4.4.11 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。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

##### **重要会计估计及其关键假设**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**



---

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

##### **7.4.6.1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **7.4.6.2 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。

##### **7.4.6.3 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；

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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
活期存款	9,275,121.16	-
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	9,275,121.16	-

注：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。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	94,161,597.33	94,219,111.91	57,514.58
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	94,161,597.33	94,219,111.91	57,514.58
项目	上年度末 2012年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	-	-	-
----	---	---	---

注：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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。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。

#### 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

本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。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。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应收活期存款利息	5,319.25	-
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	1,215.82	-
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	115.60	-
合计	6,650.67	-

注：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。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末未持有其他资产。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。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,133,973.97	-
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	1,133,973.97	-
----	--------------	---

注：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。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,875.67	-
预提审计费	70,000.00	-
预提信息披露费	300,000.00	-
合计	371,875.67	-

注：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。

#### 7.4.7.9 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12月31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	97,203,592.18	97,203,592.18
本期赎回（以“-”号填列）	-1,295,795,838.36	-1,295,795,838.36
本期末	92,498,428.19	92,498,428.19

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。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	82,529,987.49	57,514.58	82,587,502.07
本期基金份额交易产生的变动数	-44,903,632.77	-25,401,654.33	-70,305,287.10
其中：基金申购款	29,102,639.26	-9,969,471.00	19,133,168.26
基金赎回款	-74,006,272.03	-15,432,183.33	-89,438,455.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,626,354.72	-25,344,139.75	12,282,214.97

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
活期存款利息收入	841,622.53	-
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	160,818.54	-
其他	3,156.60	-
合计	1,005,597.67	-

注：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。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	83,644,671.97	-
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	83,644,671.97	0.00

注：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。

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
卖出股票成交总额	1,780,629,564.48	-
减：卖出股票成本总额	1,696,984,892.51	-
买卖股票差价收入	83,644,671.97	-

注：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。

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	27,242,352.54	-

付) 成本总额		
减: 应收利息总额	22,777.51	-
债券投资收益	1,738,223.85	-

注: 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。

#### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内未持有资产支持证券。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。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无买卖权证差价收入。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。

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
股票投资产生的股利收益	2,126,571.91	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,126,571.91	-

注: 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。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2013年3月25日(基金合同生效 日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
1. 交易性金融资产	57,514.58	-
——股票投资	57,514.58	-
——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	57,514.58	-

注: 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。

#### 7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
基金赎回费收入	1,731,299.53	-
其他	126.64	-
转换费收入	257.21	-
合计	1,731,683.38	-

注：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。

#### 7.4.7.19 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
交易所市场交易费用	5,438,701.43	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,438,701.43	-

注：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。

#### 7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
审计费用	70,000.00	-
信息披露费	300,000.00	-
沪深股东帐户开户费	900.00	-
债券帐户维护费	9,000.00	-
银行汇划费用	2,295.17	-
合计	382,195.17	-

注：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。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

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（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海盛融投资有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。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。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。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。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。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。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。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。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期无应支付关联方的佣金。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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,464,798.91	-



其中：支付销售机构的客户维护费	2,138,493.95	-
-----------------	--------------	---

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。

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。

#### 7.4.10.2.2 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	744,133.21	-

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。

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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
交通	9,275,121.16	841,622.53	-	-

注：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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期承销期内未参与关联方承销的证券。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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期内未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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
000625	长安汽车	2013-12-31	重大事项 停牌	11.45	2014-01-03	11.72	400,000	4,667,224.41	4,580,000.00	-
002279	久其软件	2013-10-28	重大事项 停牌	12.26	2014-01-10	11.78	15,000	218,880.00	183,900.00	-
002573	国电清新	2013-12-23	重大事项 停牌	22.17	-	-	27,920	360,088.44	618,986.40	-

300010	立思辰	2013-12-05	重大事项停牌	11.88	2014-03-05	13.07	135,296	1,979,349.56	1,607,316.48	-
300071	华谊嘉信	2013-11-25	重大事项停牌	29.00	-	-	3,747	91,346.21	108,663.00	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金在本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金在本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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、中高收益的基金品种，一般情形下，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。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，设立了多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、督察长和内部审计。

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。合规风控部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产生的可能损失。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。

#### **7.4.13.2 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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

于 2013 年 12 月 31 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%。本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

##### **7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

于 2013 年 12 月 31 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%。本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

#### **7.4.13.3 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、组合在短时间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%。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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	9,275,121.16	-	-	-	9,275,121.16
结算备付金	2,699,727.32	-	-	-	2,699,727.32
存出保证金	256,982.54	-	-	-	256,982.54
证券清算款	-	-	-	1,183,471.47	1,183,471.47
交易性金融资产	-	-	-	94,219,111.91	94,219,111.91
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,650.67	6,650.67
应收申购款	-	-	-	7,134.64	7,134.64
其他应收款	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,231,831.02	-	-	95,416,368.69	107,648,199.71
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	703,953.55	703,953.55
应付赎回款	-	-	-	497,685.78	497,685.78
应付赎回费	-	-	-	1,875.67	1,875.67
应付管理人报酬	-	-	-	137,200.77	137,200.77
应付托管费	-	-	-	22,866.81	22,866.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,133,973.97	1,133,973.97
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付收益	-	-	-	-	-
其他应付款	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	370,000.00	370,000.00
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	2,867,556.55	2,867,556.55
利率敏感度缺口	12,231,831.02	-	-	92,548,812.14	104,780,643.16

上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 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 0.00%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无影响。本基金成立于 2013 年 3 月 25 日。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金的股票投资比例为基金净资产的 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%。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，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2013年12月31日		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	94,219,111.91	89.92	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	94,219,111.91	89.92	-	-

注：本基金成立于2013年3月25日。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本基金业绩比较标准外的其他市场变量保持不变		
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：人民币元）	
		本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加8,319,070.80	-
	业绩比较基准下降5%	减少8,319,070.80	-

注：本基金成立于2013年3月25日。

#### 7.4.14 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

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	94,219,111.91	87.53

	其中：股票	94,219,111.91	87.53
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	11,974,848.48	11.12
6	其他各项资产	1,454,239.32	1.35
7	合计	107,648,199.71	100.00

## 8.2 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	6,786.00	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,046,440.72	44.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,858,548.05	11.32
F	批发和零售业	8,760,537.51	8.36
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	20,171,591.49	19.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,921,163.00	1.83
M	科学研究和技术服务业	2,017,498.40	1.93
N	水利、环境和公共设施管理业	618,986.40	0.59
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	1,817,560.34	1.73
	合计	94,219,111.91	89.92

## 8.3 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	300197	铁汉生态	227,385	6,196,241.25	5.91
2	600315	上海家化	110,400	4,662,192.00	4.45
3	000625	长安汽车	400,000	4,580,000.00	4.37
4	002431	棕榈园林	191,980	3,966,306.80	3.79
5	300074	华平股份	160,143	3,593,608.92	3.43
6	300136	信维通信	169,300	3,199,770.00	3.05
7	002242	九阳股份	314,700	3,109,236.00	2.97
8	002185	华天科技	280,000	3,082,800.00	2.94
9	300295	三六五网	35,111	2,726,720.26	2.60
10	002514	宝馨科技	141,694	2,709,189.28	2.59
11	000418	小天鹅 A	266,075	2,682,036.00	2.56
12	600845	宝信软件	100,331	2,508,275.00	2.39
13	300077	国民技术	82,500	2,054,250.00	1.96
14	300315	掌趣科技	71,291	2,044,625.88	1.95
15	002178	延华智能	139,330	2,017,498.40	1.93
16	000521	美菱电器	400,000	1,972,000.00	1.88
17	600617	*ST 联华	86,633	1,817,560.34	1.73
18	002400	省广股份	50,000	1,812,500.00	1.73
19	002570	贝因美	58,105	1,783,823.50	1.70
20	600729	重庆百货	80,790	1,759,606.20	1.68
21	002368	太极股份	53,669	1,747,462.64	1.67
22	002663	普邦园林	100,000	1,696,000.00	1.62
23	300168	万达信息	60,000	1,678,800.00	1.60
24	600079	人福医药	58,210	1,650,253.50	1.57
25	600628	新世界	190,000	1,609,300.00	1.54
26	300010	立思辰	135,296	1,607,316.48	1.53
27	002440	闰土股份	100,000	1,607,000.00	1.53
28	000987	广州友谊	162,164	1,548,666.20	1.48
29	300183	东软载波	50,000	1,534,500.00	1.46
30	300079	数码视讯	76,185	1,507,701.15	1.44
31	600261	阳光照明	100,000	1,389,000.00	1.33
32	600594	益佰制药	40,000	1,304,800.00	1.25
33	002508	老板电器	30,000	1,184,400.00	1.13
34	300075	数字政通	31,354	1,175,775.00	1.12
35	600824	益民集团	200,000	1,110,000.00	1.06
36	600838	上海九百	140,000	1,072,400.00	1.02
37	600199	金种子酒	100,000	1,014,000.00	0.97
38	002049	同方国芯	19,950	985,131.00	0.94
39	600827	友谊股份	89,965	887,954.55	0.85

40	600858	银座股份	99,968	755,758.08	0.72
41	002117	东港股份	50,000	740,500.00	0.71
42	300131	英唐智控	76,567	689,868.67	0.66
43	000921	海信科龙	58,800	685,608.00	0.65
44	002396	星网锐捷	30,000	642,600.00	0.61
45	002573	国电清新	27,920	618,986.40	0.59
46	300020	银江股份	20,535	513,375.00	0.49
47	600562	国睿科技	10,926	492,653.34	0.47
48	300038	梅泰诺	30,168	480,274.56	0.46
49	300115	长盈精密	12,700	479,425.00	0.46
50	300222	科大智能	26,900	430,669.00	0.41
51	002157	正邦科技	54,934	427,386.52	0.41
52	600563	法拉电子	18,800	426,948.00	0.41
53	600559	老白干酒	14,147	367,397.59	0.35
54	600536	中国软件	9,084	342,194.28	0.33
55	002253	川大智胜	9,953	269,129.12	0.26
56	300285	国瓷材料	6,538	207,385.36	0.20
57	300182	捷成股份	4,800	190,944.00	0.18
58	002279	久其软件	15,000	183,900.00	0.18
59	300155	安居宝	9,227	183,340.49	0.17
60	600612	老凤祥	7,462	174,013.84	0.17
61	300071	华谊嘉信	3,747	108,663.00	0.10
62	600171	上海贝岭	10,000	90,300.00	0.09
63	002268	卫士通	890	25,098.00	0.02
64	600859	王府井	928	16,852.48	0.02
65	000651	格力电器	424	13,847.84	0.01
66	300212	易华录	399	11,259.78	0.01
67	300263	隆华节能	382	10,887.00	0.01
68	002052	同洲电子	828	10,499.04	0.01
69	300017	网宿科技	118	9,994.60	0.01
70	600598	北大荒	600	6,786.00	0.01
71	002153	石基信息	131	6,219.88	0.01
72	000977	浪潮信息	125	5,653.75	0.01
73	300024	机器人	78	3,798.60	0.00
74	002035	华帝股份	303	3,705.69	0.00
75	002055	得润电子	200	2,096.00	0.00
76	300113	顺网科技	21	1,076.67	0.00
77	600718	东软集团	74	907.98	0.00
78	300104	乐视网	10	408.00	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	48,988,842.12	46.75
2	300002	神州泰岳	41,704,326.70	39.80
3	002310	东方园林	39,149,482.54	37.36
4	300197	铁汉生态	30,496,556.73	29.11
5	000400	许继电气	29,647,744.78	28.30
6	300090	盛运股份	27,962,236.21	26.69
7	000625	长安汽车	27,893,047.26	26.62
8	600880	博瑞传播	27,830,944.24	26.56
9	300074	华平股份	27,623,314.96	26.36
10	300251	光线传媒	26,317,539.89	25.12
11	300336	新文化	25,733,113.81	24.56
12	300071	华谊嘉信	23,160,926.06	22.10
13	002273	水晶光电	22,979,935.82	21.93
14	002055	得润电子	22,315,802.80	21.30
15	600587	新华医疗	21,353,908.86	20.38
16	600312	平高电气	20,935,125.66	19.98
17	300291	华录百纳	20,648,913.96	19.71
18	002106	莱宝高科	20,043,917.26	19.13
19	002052	同洲电子	19,561,360.97	18.67
20	600199	金种子酒	19,491,897.79	18.60
21	002146	荣盛发展	18,598,967.51	17.75
22	002008	大族激光	18,098,309.27	17.27
23	000963	华东医药	18,076,345.81	17.25
24	000977	浪潮信息	17,936,949.56	17.12
25	600563	法拉电子	17,579,576.05	16.78
26	600315	上海家化	17,303,013.25	16.51
27	600640	号百控股	17,142,044.00	16.36
28	300168	万达信息	16,857,357.02	16.09
29	300212	易华录	16,754,158.21	15.99
30	002250	联化科技	16,465,211.36	15.71
31	002663	普邦园林	14,270,874.44	13.62
32	600845	宝信软件	14,249,838.99	13.60
33	300295	三五五网	13,879,878.31	13.25
34	600536	中国软件	13,644,342.15	13.02

35	600633	浙报传媒	13,640,065.90	13.02
36	600559	老白干酒	13,620,329.49	13.00
37	002431	棕榈园林	13,290,122.18	12.68
38	300020	银江股份	13,193,954.96	12.59
39	000050	深天马A	13,103,598.27	12.51
40	002429	兆驰股份	13,101,570.05	12.50
41	300079	数码视讯	13,066,786.40	12.47
42	300155	安居宝	12,971,513.93	12.38
43	002294	信立泰	12,432,168.76	11.86
44	300136	信维通信	11,801,746.41	11.26
45	002589	瑞康医药	11,785,619.13	11.25
46	300183	东软载波	11,584,149.77	11.06
47	000028	国药一致	11,452,471.69	10.93
48	000581	威孚高科	11,276,751.77	10.76
49	000961	中南建设	11,239,280.09	10.73
50	300027	华谊兄弟	10,763,388.88	10.27
51	600073	上海梅林	10,373,271.00	9.90
52	002325	洪涛股份	10,179,499.62	9.72
53	002375	亚厦股份	10,134,456.05	9.67
54	600418	江淮汽车	10,007,653.10	9.55
55	002305	南国置业	9,999,815.92	9.54
56	300075	数字政通	9,994,926.25	9.54
57	002035	华帝股份	9,959,993.25	9.51
58	601888	中国国旅	9,833,780.29	9.39
59	300315	掌趣科技	9,783,707.16	9.34
60	000938	紫光股份	9,481,875.74	9.05
61	600498	烽火通信	9,353,801.78	8.93
62	300104	乐视网	9,287,571.84	8.86
63	300188	美亚柏科	8,872,261.28	8.47
64	600340	华夏幸福	8,662,227.15	8.27
65	600079	人福医药	8,661,856.65	8.27
66	600718	东软集团	8,283,746.97	7.91
67	600316	洪都航空	8,198,903.97	7.82
68	600639	浦东金桥	8,155,829.28	7.78
69	002153	石基信息	8,094,202.60	7.72
70	002049	同方国芯	7,961,140.77	7.60
71	002368	太极股份	7,870,603.20	7.51
72	300083	劲胜股份	7,657,975.19	7.31
73	600594	益佰制药	7,605,067.62	7.26
74	002168	深圳惠程	7,576,155.28	7.23
75	600335	国机汽车	7,321,165.26	6.99

76	300005	探路者	7,314,326.62	6.98
77	300038	梅泰诺	6,907,992.43	6.59
78	300263	隆华节能	6,816,917.35	6.51
79	300110	华仁药业	6,704,304.80	6.40
80	300148	天舟文化	6,662,646.73	6.36
81	600153	建发股份	6,655,455.40	6.35
82	002313	日海通讯	6,631,507.26	6.33
83	002185	华天科技	6,517,154.94	6.22
84	600184	光电股份	6,501,048.20	6.20
85	300355	蒙草抗旱	6,345,386.60	6.06
86	300026	红日药业	6,337,744.60	6.05
87	000559	万向钱潮	6,318,380.57	6.03
88	300032	金龙机电	6,301,184.60	6.01
89	002178	延华智能	6,188,562.31	5.91
90	300226	上海钢联	6,030,741.15	5.76
91	002253	川大智胜	6,004,459.46	5.73
92	300115	长盈精密	5,853,037.08	5.59
93	600197	伊力特	5,700,052.82	5.44
94	000656	金科股份	5,637,833.96	5.38
95	002620	瑞和股份	5,629,433.42	5.37
96	300050	世纪鼎利	5,596,949.77	5.34
97	002440	闰土股份	5,587,196.06	5.33
98	000521	美菱电器	5,542,905.53	5.29
99	300043	星辉车模	5,467,573.74	5.22
100	002439	启明星辰	5,447,900.09	5.20
101	600675	中华企业	5,371,362.66	5.13
102	002573	国电清新	5,339,420.26	5.10
103	300293	蓝英装备	5,334,788.70	5.09
104	600893	航空动力	5,263,194.71	5.02
105	600406	国电南瑞	5,171,889.62	4.94
106	002017	东信和平	5,161,176.97	4.93
107	300311	任子行	5,147,367.07	4.91
108	000888	峨眉山A	5,100,396.77	4.87
109	002609	捷顺科技	5,044,882.93	4.81
110	600612	老凤祥	5,019,339.84	4.79
111	601886	江河创建	4,932,061.13	4.71
112	600598	北大荒	4,922,702.79	4.70
113	300088	长信科技	4,761,742.67	4.54
114	002649	博彦科技	4,724,156.40	4.51
115	002095	生意宝	4,706,796.49	4.49
116	300166	东方国信	4,668,105.00	4.46

117	002148	北纬通信	4,659,285.71	4.45
118	002230	科大讯飞	4,659,070.50	4.45
119	002138	顺络电子	4,642,892.14	4.43
120	300150	世纪瑞尔	4,626,495.03	4.42
121	300270	中威电子	4,590,739.62	4.38
122	000897	津滨发展	4,578,918.90	4.37
123	600643	爱建股份	4,424,356.18	4.22
124	600060	海信电器	4,412,946.46	4.21
125	000996	中国中期	4,406,761.81	4.21
126	000423	东阿阿胶	4,369,894.50	4.17
127	600604	市北高新	4,327,890.97	4.13
128	300175	朗源股份	4,284,414.22	4.09
129	000816	江淮动力	4,273,817.46	4.08
130	600705	中航投资	4,235,318.00	4.04
131	600628	新世界	4,127,170.43	3.94
132	002566	益盛药业	4,104,462.70	3.92
133	300349	金卡股份	4,069,515.46	3.88
134	600827	友谊股份	4,058,544.30	3.87
135	300113	顺网科技	4,001,855.40	3.82
136	600067	冠城大通	3,971,792.68	3.79
137	002241	歌尔声学	3,943,580.00	3.76
138	600135	乐凯胶片	3,930,648.81	3.75
139	600983	合肥三洋	3,925,564.08	3.75
140	002400	省广股份	3,920,994.50	3.74
141	002157	正邦科技	3,917,786.59	3.74
142	600616	金枫酒业	3,901,588.00	3.72
143	300010	立思辰	3,888,548.91	3.71
144	600138	中青旅	3,860,591.20	3.68
145	000800	一汽轿车	3,791,462.83	3.62
146	002699	美盛文化	3,774,599.60	3.60
147	600511	国药股份	3,738,151.00	3.57
148	600387	海越股份	3,725,151.32	3.56
149	600128	弘业股份	3,640,465.93	3.47
150	300017	网宿科技	3,556,499.10	3.39
151	600695	大江股份	3,555,045.99	3.39
152	000006	深振业A	3,528,148.00	3.37
153	300157	恒泰艾普	3,520,812.76	3.36
154	002690	美亚光电	3,517,097.17	3.36
155	300052	中青宝	3,479,679.02	3.32
156	600077	宋都股份	3,470,550.00	3.31
157	002244	滨江集团	3,458,238.00	3.30



158	600755	厦门国贸	3,402,521.25	3.25
159	002514	宝馨科技	3,396,492.47	3.24
160	600708	海博股份	3,379,780.00	3.23
161	600562	国睿科技	3,379,128.79	3.22
162	300281	金明精机	3,353,678.13	3.20
163	600420	现代制药	3,345,229.21	3.19
164	002041	登海种业	3,326,544.96	3.17
165	600836	界龙实业	3,313,349.40	3.16
166	002467	二六三	3,305,016.00	3.15
167	600704	物产中大	3,291,989.23	3.14
168	600108	亚盛集团	3,282,253.00	3.13
169	600617	*ST 联华	3,263,996.00	3.12
170	300309	吉艾科技	3,232,378.60	3.08
171	600838	上海九百	3,124,941.00	2.98
172	002242	九阳股份	3,094,400.00	2.95
173	002069	獐子岛	3,084,336.79	2.94
174	600859	王府井	3,063,151.33	2.92
175	600391	成发科技	3,056,109.20	2.92
176	600728	佳都科技	3,050,971.05	2.91
177	600537	亿晶光电	3,002,494.98	2.87
178	000987	广州友谊	2,999,857.74	2.86
179	600557	康缘药业	2,936,274.48	2.80
180	300241	瑞丰光电	2,827,320.69	2.70
181	600038	哈飞股份	2,782,014.70	2.66
182	300037	新宙邦	2,774,199.99	2.65
183	002013	中航精机	2,761,662.93	2.64
184	600422	昆明制药	2,743,491.56	2.62
185	002179	中航光电	2,738,658.76	2.61
186	300106	西部牧业	2,702,064.25	2.58
187	600648	外高桥	2,701,325.72	2.58
188	603000	人民网	2,665,320.00	2.54
189	000418	小天鹅A	2,571,813.37	2.45
190	600824	益民集团	2,554,999.41	2.44
191	002309	中利科技	2,537,972.50	2.42
192	300178	腾邦国际	2,476,603.13	2.36
193	002689	博林特	2,405,949.00	2.30
194	002340	格林美	2,405,720.00	2.30
195	600702	沱牌舍得	2,385,202.55	2.28
196	000062	深圳华强	2,356,643.86	2.25
197	600626	申达股份	2,355,189.48	2.25
198	002416	爱施德	2,354,185.00	2.25

199	000046	泛海建设	2,354,000.00	2.25
200	300196	长海股份	2,307,749.04	2.20
201	002664	信质电机	2,160,059.50	2.06
202	600703	三安光电	2,119,365.56	2.02
203	600729	重庆百货	2,108,179.00	2.01

注：“买入金额”按成交金额（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	300002	神州泰岳	51,066,668.70	48.74
2	002570	贝因美	50,731,318.72	48.42
3	002310	东方园林	38,834,161.78	37.06
4	300090	盛运股份	35,796,413.32	34.16
5	000400	许继电气	35,292,284.02	33.68
6	600880	博瑞传播	32,444,846.20	30.96
7	300074	华平股份	30,191,853.04	28.81
8	300071	华谊嘉信	27,881,469.79	26.61
9	002055	得润电子	26,456,310.34	25.25
10	300251	光线传媒	25,510,525.11	24.35
11	300336	新文化	25,341,796.06	24.19
12	600587	新华医疗	23,349,690.45	22.28
13	300197	铁汉生态	23,154,434.28	22.10
14	000625	长安汽车	22,883,842.63	21.84
15	600312	平高电气	22,226,278.05	21.21
16	600640	号百控股	22,011,053.75	21.01
17	002273	水晶光电	21,914,833.87	20.91
18	002052	同洲电子	21,384,228.66	20.41
19	002106	莱宝高科	21,252,365.55	20.28
20	300168	万达信息	19,941,637.98	19.03
21	300291	华录百纳	19,740,346.43	18.84
22	000977	浪潮信息	18,973,922.53	18.11
23	300212	易华录	18,821,133.90	17.96
24	002146	荣盛发展	18,722,589.78	17.87
25	002008	大族激光	18,617,402.76	17.77
26	000963	华东医药	17,314,772.14	16.52
27	600199	金种子酒	17,274,055.07	16.49
28	002250	联化科技	16,272,487.23	15.53
29	600563	法拉电子	15,692,608.89	14.98
30	600633	浙报传媒	15,299,937.56	14.60

31	000050	深天马A	14,776,306.16	14.10
32	300155	安居宝	14,414,015.60	13.76
33	600536	中国软件	14,114,560.37	13.47
34	300315	掌趣科技	13,488,273.58	12.87
35	002589	瑞康医药	13,170,212.05	12.57
36	300020	银江股份	12,884,570.22	12.30
37	600315	上海家化	12,712,808.74	12.13
38	600845	宝信软件	12,638,303.97	12.06
39	002429	兆驰股份	12,431,639.51	11.86
40	300295	三五五网	12,335,114.62	11.77
41	002663	普邦园林	12,272,543.22	11.71
42	002294	信立泰	12,220,311.24	11.66
43	300148	天舟文化	11,740,889.19	11.21
44	000581	威孚高科	11,672,250.80	11.14
45	600559	老白干酒	11,543,621.60	11.02
46	300075	数字政通	11,500,946.98	10.98
47	600498	烽火通信	11,389,325.68	10.87
48	000028	国药一致	11,162,060.23	10.65
49	300188	美亚柏科	10,983,847.33	10.48
50	300079	数码视讯	10,944,594.41	10.45
51	000961	中南建设	10,730,223.68	10.24
52	600073	上海梅林	10,603,438.05	10.12
53	300183	东软载波	10,450,755.99	9.97
54	002305	南国置业	10,423,399.98	9.95
55	601888	中国国旅	10,246,753.14	9.78
56	002325	洪涛股份	10,165,325.48	9.70
57	000938	紫光股份	9,980,908.47	9.53
58	300027	华谊兄弟	9,888,170.64	9.44
59	600418	江淮汽车	9,779,067.48	9.33
60	300104	乐视网	9,683,782.13	9.24
61	002375	亚厦股份	9,549,569.87	9.11
62	002153	石基信息	9,404,016.97	8.97
63	002035	华帝股份	9,388,383.82	8.96
64	300136	信维通信	9,287,966.19	8.86
65	600340	华夏幸福	9,244,392.46	8.82
66	600718	东软集团	8,850,993.85	8.45
67	002431	棕榈园林	8,283,256.25	7.91
68	600316	洪都航空	8,210,259.23	7.84
69	600639	浦东金桥	7,898,729.22	7.54
70	600079	人福医药	7,836,489.32	7.48
71	300026	红日药业	7,134,246.01	6.81

72	300005	探路者	7,069,900.62	6.75
73	000559	万向钱潮	6,948,617.09	6.63
74	300083	劲胜股份	6,881,780.23	6.57
75	300293	蓝英装备	6,836,043.40	6.52
76	300263	隆华节能	6,824,507.65	6.51
77	600335	国机汽车	6,823,129.77	6.51
78	002049	同方国芯	6,807,079.62	6.50
79	002168	深圳惠程	6,733,276.14	6.43
80	300110	华仁药业	6,663,804.35	6.36
81	300038	梅泰诺	6,633,116.82	6.33
82	002573	国电清新	6,608,553.88	6.31
83	600184	光电股份	6,425,653.53	6.13
84	300032	金龙机电	6,408,938.79	6.12
85	600594	益佰制药	6,364,438.49	6.07
86	300115	长盈精密	6,340,982.25	6.05
87	600153	建发股份	6,318,447.48	6.03
88	300355	蒙草抗旱	6,256,990.29	5.97
89	002253	川大智胜	6,117,306.43	5.84
90	002313	日海通讯	6,037,417.08	5.76
91	600406	国电南瑞	5,941,914.87	5.67
92	300050	世纪鼎利	5,847,268.95	5.58
93	002368	太极股份	5,778,570.08	5.51
94	601886	江河创建	5,757,642.10	5.49
95	300311	任子行	5,646,925.71	5.39
96	300226	上海钢联	5,643,881.59	5.39
97	002649	博彦科技	5,540,601.68	5.29
98	002439	启明星辰	5,531,874.21	5.28
99	300349	金卡股份	5,470,442.66	5.22
100	002620	瑞和股份	5,429,003.57	5.18
101	300043	星辉车模	5,403,227.10	5.16
102	600197	伊力特	5,402,251.92	5.16
103	000656	金科股份	5,388,147.87	5.14
104	002017	东信和平	5,245,453.14	5.01
105	600893	航空动力	5,160,183.66	4.92
106	002138	顺络电子	5,131,768.06	4.90
107	002609	捷顺科技	5,096,845.81	4.86
108	000888	峨眉山A	5,021,674.23	4.79
109	300166	东方国信	4,951,864.25	4.73
110	002095	生意宝	4,894,547.40	4.67
111	600675	中华企业	4,732,289.51	4.52
112	600612	老凤祥	4,697,513.53	4.48

113	002148	北纬通信	4,645,140.20	4.43
114	600387	海越股份	4,638,952.81	4.43
115	600598	北大荒	4,605,142.93	4.40
116	002241	歌尔声学	4,552,189.01	4.34
117	002178	延华智能	4,508,215.59	4.30
118	002690	美亚光电	4,489,253.60	4.28
119	000996	中国中期	4,468,194.48	4.26
120	002566	益盛药业	4,449,704.77	4.25
121	002230	科大讯飞	4,417,424.90	4.22
122	300088	长信科技	4,397,890.39	4.20
123	300017	网宿科技	4,371,530.61	4.17
124	300175	朗源股份	4,366,106.44	4.17
125	600604	市北高新	4,322,971.12	4.13
126	600060	海信电器	4,280,095.60	4.08
127	300150	世纪瑞尔	4,238,639.52	4.05
128	300270	中威电子	4,233,215.25	4.04
129	600983	合肥三洋	4,134,931.67	3.95
130	600067	冠城大通	4,131,529.66	3.94
131	600705	中航投资	4,109,616.19	3.92
132	000423	东阿阿胶	4,050,477.08	3.87
133	002699	美盛文化	4,030,607.86	3.85
134	000897	津滨发展	4,007,949.28	3.83
135	600643	爱建股份	3,950,577.93	3.77
136	600616	金枫酒业	3,893,850.36	3.72
137	000816	江淮动力	3,884,519.25	3.71
138	300157	恒泰艾普	3,866,224.34	3.69
139	600704	物产中大	3,780,137.45	3.61
140	600511	国药股份	3,758,432.21	3.59
141	600138	中青旅	3,746,478.87	3.58
142	600135	乐凯胶片	3,714,676.40	3.55
143	300052	中青宝	3,701,140.56	3.53
144	600708	海博股份	3,644,905.88	3.48
145	002440	闰土股份	3,614,251.51	3.45
146	002244	滨江集团	3,593,181.69	3.43
147	600695	大江股份	3,523,742.06	3.36
148	002467	二六三	3,507,269.27	3.35
149	002185	华天科技	3,491,257.57	3.33
150	000800	一汽轿车	3,468,307.69	3.31
151	000006	深振业A	3,377,373.93	3.22
152	000521	美菱电器	3,369,316.94	3.22
153	300309	吉艾科技	3,310,665.16	3.16

154	002157	正邦科技	3,303,696.19	3.15
155	600128	弘业股份	3,295,023.00	3.14
156	600420	现代制药	3,283,173.25	3.13
157	300113	顺网科技	3,207,226.17	3.06
158	600077	宋都股份	3,193,725.61	3.05
159	600755	厦门国贸	3,189,303.40	3.04
160	300241	瑞丰光电	3,131,762.46	2.99
161	600391	成发科技	3,007,435.90	2.87
162	600836	界龙实业	2,997,390.42	2.86
163	600108	亚盛集团	2,987,322.35	2.85
164	600827	友谊股份	2,978,821.91	2.84
165	300106	西部牧业	2,970,394.71	2.83
166	002069	獐子岛	2,962,588.15	2.83
167	002041	登海种业	2,906,208.63	2.77
168	300037	新宙邦	2,883,359.31	2.75
169	600557	康缘药业	2,871,302.63	2.74
170	600859	王府井	2,853,705.36	2.72
171	600562	国睿科技	2,802,208.80	2.67
172	002179	中航光电	2,764,286.89	2.64
173	002013	中航精机	2,718,495.74	2.59
174	600422	昆明制药	2,682,357.67	2.56
175	002340	格林美	2,638,482.49	2.52
176	600628	新世界	2,635,120.90	2.51
177	600728	佳都科技	2,555,120.23	2.44
178	000046	泛海建设	2,487,994.62	2.37
179	002309	中利科技	2,466,315.81	2.35
180	600537	亿晶光电	2,457,488.38	2.35
181	600648	外高桥	2,456,995.45	2.34
182	300178	腾邦国际	2,438,695.08	2.33
183	600038	哈飞股份	2,437,723.51	2.33
184	300196	长海股份	2,405,026.94	2.30
185	300281	金明精机	2,383,844.65	2.28
186	002416	爱施德	2,345,166.53	2.24
187	002689	博林特	2,337,465.80	2.23
188	603000	人民网	2,327,669.46	2.22
189	600702	沱牌舍得	2,279,099.82	2.18
190	600626	申达股份	2,238,417.46	2.14
191	000062	深圳华强	2,180,304.89	2.08
192	600703	三安光电	2,151,596.45	2.05

注：“卖出金额”按成交金额（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

买入股票的成本（成交）总额	1,791,146,489.84
卖出股票的收入（成交）总额	1,780,629,564.48

注：“买入股票的成本”“卖出股票的收入”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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 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 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 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 本基金投资国债期货的投资评价

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** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除上海家化联合股份有限公司以外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。本基金投资的前十名证券之一上海家化于 2013 年 11 月 21 日公告，上海家化于 2013 年 11 月 20 日收到上海证监局下发的《关于对上海家化联合股份有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决[2013]49 号），指出公司与吴江市黎里沪江日用化学品厂发生采购销售、资金拆借等关联交易中存在未及时披露等问题，对公司提出相应的整改要求。上海家化于 2013 年 12 月 18 日公告，按照上海证监局整改要求已完成整改。上海家化于 2013 年 11 月 21 日公告，2013 年 11 月 20 日上海家化收到中国证监会《调查通知书》（编号：沪调查通字 2013-1-64 号），“因你公司涉嫌未按照规定披露信息，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你公司立案稽查，请予以配合。”本基金管理人的研究部门对上海家化保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

**8.11.2** 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。

### 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	256,982.54
2	应收证券清算款	1,183,471.47
3	应收股利	-
4	应收利息	6,650.67
5	应收申购款	7,134.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,454,239.32

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 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	000625	长安汽车	4,580,000.00	4.37	重大事项停牌
---	--------	------	--------------	------	--------

注：本基金本报告期末前十名股票中除长安汽车外不存在其他流通受限股票。

## § 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

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
1,943	47,605.98	2,142,858.98	2.32%	90,355,569.21	97.68%

### 9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	470,690.71	0.5089%

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为 0 万份—10 万份（含）之间。

## § 10 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
本报告期基金总申购份额	97,203,592.18
减：本报告期基金总赎回份额	1,295,795,838.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	92,498,428.19

注：注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

---

## § 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

1、基金管理人于 2013 年 2 月 6 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于独立董事变更的公告》，披露原独立董事尹应能先生因个人原因申请辞去独立董事一职，由韩启蒙先生接替尹应能先生出任公司第二届董事会独立董事。

2、基金管理人原监事 James Young 先生因个人原因申请辞去公司监事一职，经 2013 年第一次股东会会议审议批准，自 2013 年 2 月 4 日起由 Simon Lopez 先生接替 James Young 先生出任本基金管理人第二届监事会监事。经员工选举，朱敏奕女士于 2013 年 3 月起出任公司职工监事。

3、基金管理人于 2013 年 6 月 25 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于郁蓓华董事任职的公告》，披露增聘公司总经理郁蓓华女士担任公司第二届董事会董事。

4、报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 70,000.00 元，截止本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务的连续年限为 1 年。

## 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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
招商证券	2	1,917,993,075.12	53.70%	1,746,141.88	53.70%	-
东兴证券	1	1,354,537,227.41	37.92%	1,233,172.98	37.92%	-
中信建投	1	299,245,751.79	8.38%	272,432.34	8.38%	-
宏源证券	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：

本基金本报告期新增中信建投、东兴证券、宏源证券交易单元。

### 11.7.2 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	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额

		的比例		的比例		的比例
招商证券	56,260,524.10	100.00%	18,413,900,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	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
2	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
3	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-7-2
4	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-7-4
5	关于新增招商证券为旗下部分基金代销机构的公告	报刊及公司网站	2013-7-10
6	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-7-12
7	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金 2013 年第 2 季度报告	报刊及公司网站	2013-7-17
8	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-7-19
9	关于旗下战略新兴产业基金在数米基金开通定投、转换以及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-7-25
10	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-7-25
11	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-8-13
12	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金 2013 年半年度报告正文	公司网站	2013-8-27
13	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金 2013 年半年度报告摘要	报刊及公司网站	2013-8-27
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	2013-9-24
15	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金 2013 年第 3 季度报告	报刊及公司网站	2013-10-25
16	关于旗下部分基金新增北京展恒基金销售为代销机构并开通定投业务和参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-10-29
17	关于旗下部分基金新增天天基金销售为代	报刊及公司网站	2013-10-31

	销机构并开通定投业务和参加其费率优惠活动的公告		
18	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-11-2
19	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书更新正文（2013年第1号）	公司网站	2013-11-8
20	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书更新摘要（2013年第1号）	报刊及公司网站	2013-11-8
21	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金开通直销渠道日常转换、定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2013-11-15
22	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2013-11-15
23	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金在浦发银行开通日常转换和定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2013-11-15
24	浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金在招商银行推出定期定额投资业务的公告	报刊及公司网站	2013-11-15
25	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-11-19
26	关于成立上海浦银安盛资产管理有限公司的公告	报刊及公司网站	2013-12-6
27	关于旗下部分基金在上海银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2013-12-12
28	关于旗下部分基金新增万银财富为代销机构并开通定投业务和参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-12-17
29	关于旗下部分基金新增同花顺基金销售为代销机构并开通定投业务和参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-12-31
30	关于增加注册资本及修改公司章程的公告	报刊及公司网站	2014-1-4

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人注册资本增至 28,000 万元人民币并据此修改了公司章程，基金管理人于 2013 年 12 月 6 日刊登《关于成立上海浦银安盛资产管理有限公司的公告》，披露子公司正式成立。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛价值成长股票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

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇一四年三月二十七日