

**浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金2015年半年度报告摘要**

**2015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**

**送出日期：2015年8月25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2015年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	4,129,268,471.45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	汤嵩彦
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216

**2.4 信息披露方式**

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

**§ 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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	134,382,313.54
本期利润	104,905,193.55
加权平均基金份额本期利润	0.1127
本期基金份额净值增长率	96.61%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.4919
期末基金资产净值	10,310,827,379.69
期末基金份额净值	2.497

注：1、上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。

2、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。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、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。

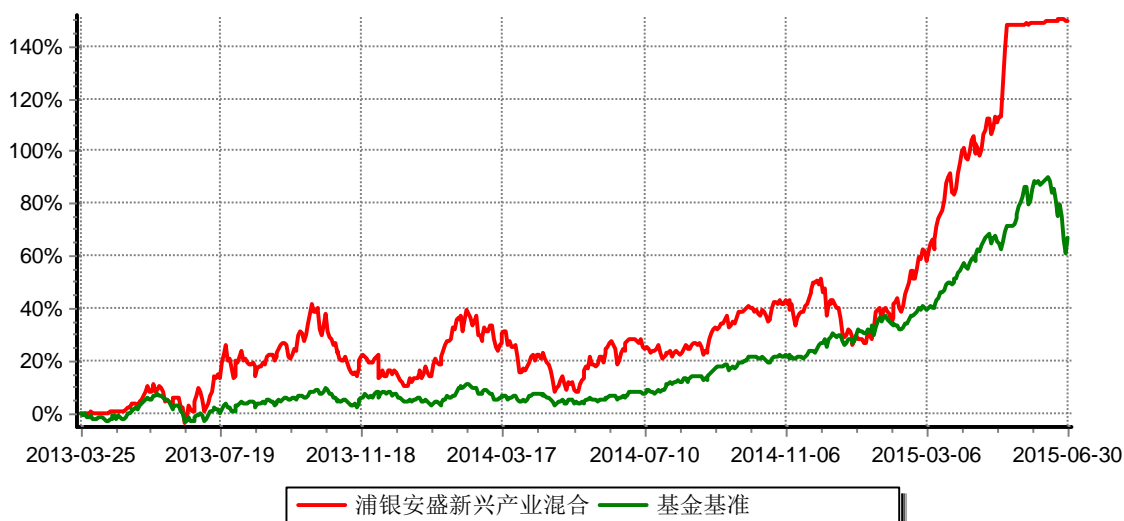
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.52%	0.08%	-7.82%	2.12%	8.34%	-2.04%
过去三个月	34.54%	1.55%	10.40%	1.60%	24.14%	-0.05%
过去六个月	96.61%	1.74%	30.96%	1.29%	65.65%	0.45%
过去一年	95.23%	1.62%	54.90%	1.02%	40.33%	0.60%
自基金合同生效起至今	149.70%	1.80%	66.60%	0.90%	83.10%	0.90%

#### 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-2015年6月30日)



## § 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，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产管理有限公司，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2015年6月30日止，浦银安盛旗下共管理19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、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金及浦银安盛医疗健康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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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,公司旗下浦银安盛红利精选股票基金、浦银安盛精致生活混合基金、浦银安盛新兴产业混合基金、浦银安盛消费升级混合基金基金经理	2013年3月25日	—	8	吴勇先生,上海交通大学材料工程系学士,上海交通大学工商管理硕士,CPA, CFA, 中国注册造价师。1993年8月至2007年8月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、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先后担任行业研究员、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混合基金基金经理。2013年3月起,兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理。2013年12月起兼任浦银安盛消费升级混合基金基金经理。2012年11月起兼任本公司权益投资部总监。
陈蔚丰	原权益类基金经理助理	2014年7月1日	2015年5月24日	7	陈蔚丰女士,南京大学环境科学硕士。2008年2月至2010年11月在江苏瑞华投资发展有限公司担任行业研究员。2010年11月加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、

					高级研究员、基金经理助理。2015年5月，担任浦银安盛医疗健康混合基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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、陈蔚丰的任职日期和离职日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。

3、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。

#### 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 and 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日和10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中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



2015年上半年A股市场总体呈现单边上涨状态，信息技术、互联网金融、国企改革等主题板块涨幅较好。市场向好的原因在于：一、国内货币流动性宽裕，央行多次降息降准，银行间回购利率保持在低位；二、券商融资等杠杆工具的余额不断攀升，新进投资者不断增加带来增量资金，三、政府出台了鼓励新兴产业发展、国企改革等相关政策，强化了相关行业向好的预期。在实体经济方面，由于需求疲弱和政府投资放缓，基建和房地产相关产业链增速较为疲弱，消费增速则体现出较为平稳的状态，上述特征符合市场对国家经济结构转型的预期。

基于以上的判断，本基金在上半年保持了信息服务、通信等行业的超配，对传统周期性行业保持低配的状态。在二季度中后期，鉴于市场整体估值较高，因此阶段性参与了新股的申购。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年上半年净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为96.61%，基准收益率为30.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，由于融资等杠杆因素的存在，未来市场的波动性可能增大，但总体来看，符合中国经济转型的方向的行业如信息技术、国企改革、医疗保健等具有长期的投资价值。传统行业去产能的过程可能是比较漫长的，因此相关产业链缺乏较好的投资机会。为刺激经济，未来央行可能长期保持适度宽松的货币流动性，对A股市场形成中长期利好。

#### 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》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### **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》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。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### **§ 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**

2015年上半年度，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**

2015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**

2015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证券投资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：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款		508,226,665.99	5,673,470.64
结算备付金		8,620,392,010.16	836,167.05
存出保证金		134,505.02	98,655.31
交易性金融资产		179,667,205.96	50,708,195.24
其中：股票投资		178,824,407.96	50,708,195.24
基金投资		—	—
债券投资		842,798.00	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产		—	—
应收证券清算款		1,010,550,962.82	—
应收利息		2,697,801.20	1,255.18
应收股利		—	—
应收申购款		6,342,602.00	466,141.32
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		10,328,011,753.15	57,783,884.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	2,265,332.61
应付赎回款		1,667,327.56	778,998.31
应付管理人报酬		12,662,172.81	77,952.76
应付托管费		2,110,362.09	12,992.11
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		589,726.77	708,100.35
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		154,784.23	292,259.30
负债合计		17,184,373.46	4,135,635.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		4,129,268,471.45	42,238,262.32
未分配利润		6,181,558,908.24	11,409,986.98
所有者权益合计		10,310,827,379.69	53,648,249.30
负债和所有者权益总计		10,328,011,753.15	57,783,884.74

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值2.497元，基金份额总额4,129,268,471.45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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日-2014年 6月30日
一、收入		125,955,476.61	17,329,753.28

1.利息收入		16,608,783.39	66,168.88
其中：存款利息收入		12,652,747.47	66,168.88
债券利息收入		48.31	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		3,955,987.61	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		138,727,830.99	8,625,049.83
其中：股票投资收益		138,641,747.29	8,291,124.58
基金投资收益		—	—
债券投资收益		—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益		86,083.70	333,925.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-29,477,119.99	8,559,197.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）		95,982.22	79,336.64
<b>减：二、费用</b>		21,050,283.06	2,444,188.50
1. 管理人报酬		16,605,561.11	716,724.16
2. 托管费		2,767,593.47	119,454.02
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		1,561,838.40	1,474,305.39
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—

6. 其他费用		115,290.08	133,704.93
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		104,905,193.55	14,885,564.78
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		104,905,193.55	14,885,564.78

### 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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015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)	42,238,262.32	11,409,986.98	53,648,249.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	104,905,193.55	104,905,193.55
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)	4,087,030,209.13	6,065,243,727.71	10,152,273,936.84
其中：1.基金申购款	4,137,839,032.90	6,115,710,187.36	10,253,549,220.26
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-50,808,823.77	-50,466,459.65	-101,275,283.42
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)	4,129,268,471.45	6,181,558,908.24	10,310,827,379.69
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日-2014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)	92,498,428.19	12,282,214.97	104,780,643.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	14,885,564.78	14,885,564.78
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)	-9,792,506.42	-4,107,394.62	-13,899,901.04
其中：1.基金申购款	43,891,320.34	9,719,685.58	53,611,005.92
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-53,683,826.76	-13,827,080.20	-67,510,906.96
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）	82,705,921.77	23,060,385.13	105,766,306.90

报表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：

郁蓓华

郁蓓华

钱琨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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，由基金管理人浦银安盛基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2013年3月25日正式生效，首次设立募集规模为1,291,090,674.37份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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： $55\% \times \text{中证新兴产业指数} + 45\% \times \text{中信标普全债指数}$ 。

#### 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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月，财政部制定了《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》和《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》和《企业会计准则第33号--合并财务报表》；上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号--金融工具列报》，在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

#### 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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。



#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致，除下述事项外，其他与前期一致。

（对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。）

#### 6.4.5 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 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。

##### 6.4.6.2 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。

##### 6.4.6.3 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.8.1.4 债券交易**

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.8.1.5 债券回购交易**

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日-2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,605,561.11	716,724.16
其中：支付销售机构的客户维护费	6,929,470.84	338,613.46

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

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日-2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,767,593.47	119,454.02

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

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 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与上年度可比期间均未持有本基金。

#### 6.4.8.4.2 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及上年度末均未持有本基金。

### 6.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日-2014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
交通银行股份有限公司	8,226,665.99	121,136.52	825,504.49	57,400.36

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

## 6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
300480	光力科技	2015-06-25	2015-07-02	非公开发行	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64

603838	四通股份	2015-06-23	2015-07-01	非公开发行	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87
300487	蓝晓科技	2015-06-24	2015-07-02	非公开发行	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00
300489	中飞股份	2015-06-24	2015-07-01	非公开发行	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64
300488	恒锋工具	2015-06-25	2015-07-01	非公开发行	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74

## 6.4.9.2 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	期末成本总额	期末估值总额
000700	模塑科技	2015-04-15	重大事项停牌	27.28	2015-07-21	24.44	15,000	336,515.37	409,200.00
002712	思美传媒	2015-03-19	重大事项停牌	72.86	2015-07-31	66.10	7,000	496,300.00	510,020.00
300096	易联众	2015-05-28	重大事项停牌	39.55		—	4,000	96,680.00	158,200.00
300279	和晶科技	2015-04-22	重大事项停牌	38.30		—	3,000	102,855.07	114,900.00
300310	宜通世纪	2015-06-16	重大事项停牌	47.52		—	8,000	237,901.48	380,160.00
300353	东土科技	2015-06-03	重大事项停牌	76.22		—	5,000	196,790.28	381,100.00
300377	赢时胜	2015-05-20	重大事项停牌	187.77	2015-07-15	168.99	2,000	324,278.00	375,540.00
300467	迅游科技	2015-06-25	重大事项停牌	297.30	2015-07-02	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80
600155	宝硕股份	2015-03-09	重大事项停牌	14.98		—	5,000	62,113.56	74,900.00
603939	益丰药房	2015-06-08	重大事项停牌	78.15	2015-08-17	89.89	43,919	3,525,716.63	3,432,269.85

注：本基金截至2015年6月30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。

## 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2015年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2015年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## § 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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	178,824,407.96	1.73
	其中：股票	178,824,407.96	1.73
2	固定收益投资	842,798.00	0.01
	其中：债券	842,798.00	0.01
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	9,128,618,676.15	88.39
7	其他各项资产	1,019,725,871.04	9.87
8	合计	10,328,011,753.15	100.00

### 7.2 报告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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	484,279.65	—
B	采矿业	1,635,059.25	0.02
C	制造业	92,923,014.13	0.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,235,039.21	0.02

E	建筑业	808,986.92	0.01
F	批发和零售业	39,844,886.29	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	399,983.22	—
H	住宿和餐饮业	2,165,000.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,280,324.21	0.30
J	金融业	240,380.00	—
K	房地产业	4,433,432.00	0.04
L	租赁和商务服务业	1,354,111.40	0.01
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	196,300.00	—
S	综合	—	—
	合计	178,824,407.96	1.73

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603108	润达医疗	191,728	13,723,890.24	0.13
2	300036	超图软件	299,970	11,002,899.60	0.11
3	002383	合众思壮	193,686	8,760,417.78	0.08
4	000587	金叶珠宝	346,000	8,002,980.00	0.08
5	603883	老百姓	100,000	7,319,000.00	0.07
6	300304	云意电气	250,000	7,025,000.00	0.07
7	600833	第一医药	240,000	5,520,000.00	0.05
8	300243	瑞丰高材	300,000	5,316,000.00	0.05
9	300023	宝德股份	159,934	5,258,629.92	0.05
10	300098	高新兴	180,000	5,245,200.00	0.05

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站(www.py-axa.com)的半年度报告正文。

## 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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601985	中国核电	32,649,100.17	60.86
2	300036	超图软件	17,570,784.34	32.75
3	603108	润达医疗	17,169,690.68	32.00
4	603883	老百姓	16,038,356.00	29.90
5	002383	合众思壮	11,205,391.04	20.89
6	000587	金叶珠宝	9,813,091.84	18.29
7	300038	梅泰诺	9,322,729.40	17.38
8	600833	第一医药	9,088,897.00	16.94
9	300304	云意电气	8,746,374.00	16.30
10	300023	宝德股份	8,404,657.50	15.67
11	300243	瑞丰高材	7,562,216.00	14.10
12	002231	奥维通信	7,240,140.00	13.50
13	601799	星宇股份	6,973,895.87	13.00
14	300290	荣科科技	6,827,691.55	12.73
15	600064	南京高科	6,526,583.18	12.17
16	300139	福星晓程	6,436,274.37	12.00
17	300160	秀强股份	6,318,437.00	11.78
18	002576	通达动力	6,221,538.48	11.60
19	002657	中科金财	5,913,710.00	11.02
20	002441	众业达	5,628,125.60	10.49
21	603939	益丰药房	5,434,716.63	10.13
22	600129	太极集团	5,427,490.00	10.12
23	300018	中元华电	5,304,642.00	9.89



24	600685	中船防务	5,109,947.00	9.52
25	600767	运盛医疗	5,070,490.00	9.45
26	000801	四川九洲	5,060,273.00	9.43
27	600358	国旅联合	5,029,844.96	9.38
28	600109	国金证券	4,949,300.00	9.23
29	300155	安居宝	4,916,529.55	9.16
30	300377	赢时胜	4,848,535.34	9.04
31	300399	京天利	4,748,215.00	8.85
32	000419	通程控股	4,680,916.00	8.73
33	600571	信雅达	4,628,273.80	8.63
34	300353	东土科技	4,579,933.31	8.54
35	300098	高新兴	4,516,780.59	8.42
36	300275	梅安森	4,487,841.20	8.37
37	603456	九洲药业	4,416,322.00	8.23
38	300287	飞利信	4,330,238.00	8.07
39	300050	世纪鼎利	4,321,556.72	8.06
40	002699	美盛文化	4,220,888.80	7.87
41	300010	立思辰	4,215,714.00	7.86
42	300312	邦讯技术	4,180,999.00	7.79
43	600650	锦江投资	4,037,984.99	7.53
44	000700	模塑科技	4,033,220.49	7.52
45	000961	中南建设	3,928,579.00	7.32
46	600280	中央商场	3,928,513.80	7.32
47	300341	麦迪电气	3,829,766.00	7.14
48	300380	安硕信息	3,652,008.00	6.81
49	300339	润和软件	3,642,289.00	6.79
50	600234	山水文化	3,539,960.00	6.60
51	300254	仟源医药	3,507,529.00	6.54
52	002363	隆基机械	3,404,601.00	6.35
53	300053	欧比特	3,398,612.25	6.33

54	300168	万达信息	3,366,029.20	6.27
55	300259	新天科技	3,311,792.40	6.17
56	300033	同花顺	3,309,056.00	6.17
57	002189	利达光电	3,234,803.00	6.03
58	600150	中国船舶	3,220,738.00	6.00
59	300166	东方国信	3,214,549.24	5.99
60	000524	岭南控股	3,040,247.65	5.67
61	000722	湖南发展	3,000,000.00	5.59
62	601989	中国重工	2,967,911.00	5.53
63	600325	华发股份	2,917,618.00	5.44
64	300279	和晶科技	2,803,967.00	5.23
65	300059	东方财富	2,803,230.00	5.23
66	600184	光电股份	2,740,236.00	5.11
67	300311	任子行	2,711,464.50	5.05
68	600149	廊坊发展	2,661,280.00	4.96
69	002279	久其软件	2,658,875.50	4.96
70	603019	中科曙光	2,639,216.00	4.92
71	002666	德联集团	2,544,502.00	4.74
72	300306	远方光电	2,507,925.00	4.67
73	002315	焦点科技	2,455,503.66	4.58
74	000056	深国商	2,441,492.82	4.55
75	002488	金固股份	2,396,445.00	4.47
76	600400	红豆股份	2,367,824.50	4.41
77	300296	利亚德	2,346,317.00	4.37
78	002339	积成电子	2,344,800.00	4.37
79	300217	东方电热	2,310,891.00	4.31
80	300150	世纪瑞尔	2,239,735.00	4.17
81	300352	北信源	2,239,648.00	4.17
82	300109	新开源	2,229,207.00	4.16
83	600061	中纺投资	2,191,627.00	4.09

84	300219	鸿利光电	2,130,113.00	3.97
85	002178	延华智能	2,081,126.89	3.88
86	300413	快乐购	2,065,374.00	3.85
87	300162	雷曼光电	2,003,656.80	3.73
88	300253	卫宁软件	2,000,626.00	3.73
89	002115	三维通信	1,904,052.54	3.55
90	600185	格力地产	1,867,555.90	3.48
91	300363	博腾股份	1,821,967.00	3.40
92	600067	冠城大通	1,800,931.00	3.36
93	002496	辉丰股份	1,750,339.58	3.26
94	600886	国投电力	1,742,050.95	3.25
95	300209	天泽信息	1,728,789.00	3.22
96	600647	同达创业	1,697,643.00	3.16
97	300310	宜通世纪	1,695,048.00	3.16
98	002172	澳洋科技	1,669,080.53	3.11
99	300231	银信科技	1,664,022.44	3.10
100	600528	中铁二局	1,643,666.37	3.06
101	000777	中核科技	1,616,263.00	3.01
102	600687	刚泰控股	1,613,619.00	3.01
103	000728	国元证券	1,596,552.00	2.98
104	002635	安洁科技	1,587,136.37	2.96
105	600211	西藏药业	1,586,403.02	2.96
106	600030	中信证券	1,532,500.00	2.86
107	300338	开元仪器	1,478,778.00	2.76
108	600021	上海电力	1,466,804.59	2.73
109	002324	普利特	1,403,144.00	2.62
110	601519	大智慧	1,399,143.00	2.61
111	000599	青岛双星	1,381,422.00	2.57
112	600410	华胜天成	1,364,250.00	2.54
113	300250	初灵信息	1,329,857.00	2.48

114	002095	生意宝	1,301,211.97	2.43
115	300322	硕贝德	1,274,745.00	2.38
116	000800	一汽轿车	1,197,958.00	2.23
117	300295	三六五网	1,188,389.00	2.22
118	000906	物产中拓	1,176,350.00	2.19
119	002609	捷顺科技	1,168,844.50	2.18
120	603116	红蜻蜓	1,156,411.80	2.16
121	603979	金诚信	1,135,622.97	2.12
122	002017	东信和平	1,131,056.40	2.11
123	300256	星星科技	1,128,088.00	2.10
124	002446	盛路通信	1,119,600.00	2.09
125	601009	南京银行	1,098,700.00	2.05
126	300045	华力创通	1,097,279.00	2.05
127	600446	金证股份	1,086,494.00	2.03

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601985	中国核电	134,352,450.00	250.43
2	300139	福星晓程	7,550,818.38	14.07
3	002657	中科金财	7,181,195.79	13.39
4	600358	国旅联合	6,121,084.92	11.41
5	300339	润和软件	6,035,365.71	11.25
6	603883	老百姓	6,020,000.00	11.22
7	600064	南京高科	6,009,290.56	11.20
8	600109	国金证券	5,672,349.90	10.57
9	300010	立思辰	5,635,856.49	10.51
10	300155	安居宝	5,585,004.28	10.41
11	002441	众业达	5,518,777.01	10.29

12	300033	同花顺	5,500,149.51	10.25
13	300038	梅泰诺	5,440,021.00	10.14
14	300290	荣科科技	5,439,570.56	10.14
15	300353	东土科技	5,340,513.94	9.95
16	300287	飞利信	5,272,781.95	9.83
17	002699	美盛文化	5,203,582.24	9.70
18	300160	秀强股份	5,170,303.00	9.64
19	300377	赢时胜	5,078,743.16	9.47
20	000961	中南建设	4,994,693.64	9.31
21	300050	世纪鼎利	4,972,745.00	9.27
22	600685	中船防务	4,922,550.85	9.18
23	000700	模塑科技	4,460,788.72	8.31
24	300166	东方国信	4,214,518.44	7.86
25	002363	隆基机械	4,118,957.40	7.68
26	300399	京天利	3,895,691.00	7.26
27	600650	锦江投资	3,798,044.00	7.08
28	002576	通达动力	3,739,250.00	6.97
29	002279	久其软件	3,703,927.77	6.90
30	600325	华发股份	3,648,606.52	6.80
31	300380	安硕信息	3,626,673.00	6.76
32	600571	信雅达	3,623,334.40	6.75
33	300059	东方财富	3,579,763.78	6.67
34	300168	万达信息	3,492,930.00	6.51
35	600129	太极集团	3,482,223.06	6.49
36	300275	梅安森	3,465,372.53	6.46
37	002189	利达光电	3,455,078.78	6.44
38	600150	中国船舶	3,325,565.99	6.20
39	300254	仟源医药	3,302,857.97	6.16
40	603019	中科曙光	3,246,295.72	6.05
41	002666	德联集团	3,235,543.74	6.03

42	300312	邦讯技术	3,054,300.52	5.69
43	600199	金种子酒	3,049,476.19	5.68
44	300279	和晶科技	3,045,282.71	5.68
45	600184	光电股份	3,030,224.47	5.65
46	600388	龙净环保	3,003,959.09	5.60
47	002178	延华智能	2,978,994.00	5.55
48	002488	金固股份	2,973,834.68	5.54
49	601799	星宇股份	2,860,557.23	5.33
50	300109	新开源	2,854,964.00	5.32
51	601989	中国重工	2,811,320.00	5.24
52	600185	格力地产	2,755,478.78	5.14
53	603198	迎驾贡酒	2,713,500.00	5.06
54	600149	廊坊发展	2,630,705.43	4.90
55	600061	中纺投资	2,630,054.78	4.90
56	002496	辉丰股份	2,563,639.27	4.78
57	002115	三维通信	2,545,059.87	4.74
58	000728	国元证券	2,519,317.00	4.70
59	300311	任子行	2,471,823.00	4.61
60	600400	红豆股份	2,422,649.44	4.52
61	300217	东方电热	2,386,242.00	4.45
62	000056	深国商	2,378,369.50	4.43
63	300150	世纪瑞尔	2,365,097.81	4.41
64	300296	利亚德	2,251,615.18	4.20
65	600030	中信证券	2,248,910.17	4.19
66	002315	焦点科技	2,159,857.00	4.03
67	603939	益丰药房	2,156,332.72	4.02
68	600528	中铁二局	2,154,460.53	4.02
69	002675	东诚药业	2,149,310.60	4.01
70	002095	生意宝	2,147,627.31	4.00
71	601000	唐山港	2,113,553.86	3.94

72	300053	欧比特	2,063,551.49	3.85
73	600234	山水文化	2,045,837.00	3.81
74	600687	刚泰控股	2,034,143.82	3.79
75	600657	信达地产	1,994,456.35	3.72
76	300253	卫宁软件	1,979,772.70	3.69
77	300162	雷曼光电	1,979,485.65	3.69
78	300413	快乐购	1,939,933.00	3.62
79	300231	银信科技	1,939,092.34	3.61
80	600067	冠城大通	1,918,266.00	3.58
81	002304	洋河股份	1,863,772.31	3.47
82	600015	华夏银行	1,850,148.76	3.45
83	600886	国投电力	1,818,200.00	3.39
84	000425	徐工机械	1,792,880.86	3.34
85	603456	九洲药业	1,758,040.00	3.28
86	002146	荣盛发展	1,752,014.15	3.27
87	300209	天泽信息	1,737,949.45	3.24
88	002635	安洁科技	1,723,767.00	3.21
89	600702	沱牌舍得	1,695,881.05	3.16
90	002172	澳洋科技	1,665,601.90	3.10
91	000777	中核科技	1,617,968.00	3.02
92	600647	同达创业	1,615,175.16	3.01
93	000599	青岛双星	1,570,873.00	2.93
94	600970	中材国际	1,559,555.91	2.91
95	300295	三六五网	1,519,238.20	2.83
96	002324	普利特	1,492,664.00	2.78
97	600021	上海电力	1,487,958.92	2.77
98	000042	中洲控股	1,470,910.40	2.74
99	600418	江淮汽车	1,463,269.58	2.73
100	002051	中工国际	1,427,254.50	2.66
101	300310	宜通世纪	1,419,156.00	2.65

102	600211	西藏药业	1,398,222.00	2.61
103	600446	金证股份	1,395,771.70	2.60
104	600410	华胜天成	1,395,596.36	2.60
105	000528	柳 工	1,354,906.70	2.53
106	600519	贵州茅台	1,348,035.43	2.51
107	600833	第一医药	1,338,105.00	2.49
108	300025	华星创业	1,321,736.22	2.46
109	300306	远方光电	1,313,984.37	2.45
110	000906	物产中拓	1,302,402.20	2.43
111	300322	硕贝德	1,274,333.94	2.38
112	300250	初灵信息	1,239,594.13	2.31
113	000402	金 融 街	1,230,601.05	2.29
114	000801	四川九洲	1,229,651.00	2.29
115	000800	一汽轿车	1,193,685.36	2.23
116	002017	东信和平	1,175,766.68	2.19
117	600016	民生银行	1,141,900.00	2.13
118	002609	捷顺科技	1,135,162.29	2.12
119	300045	华力创通	1,126,795.00	2.10
120	603568	伟明环保	1,125,065.91	2.10
121	300256	星星科技	1,112,592.33	2.07
122	601009	南京银行	1,100,838.78	2.05
123	601519	大智慧	1,081,775.00	2.02

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

### 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	540,703,116.59
卖出股票的收入（成交）总额	521,488,733.17

注：“买入股票的成本”和“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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合



金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	842,798.00	0.01
8	其他	—	—
9	合计	842,798.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.01

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.2 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。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 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内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

**7.12.3 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	134,505.02
2	应收证券清算款	1,010,550,962.82
3	应收股利	—
4	应收利息	2,697,801.20
5	应收申购款	6,342,602.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,019,725,871.04

**7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## § 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
1,809	2,282,624.92	4,091,154,744.8 0	99.08%	38,113,726.65	0.92%

### 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	85,088.05	—

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 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
本报告期期初基金份额总额	42,238,262.32
本报告期基金总申购份额	4,137,839,032.90
减：本报告期基金总赎回份额	50,808,823.77
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,129,268,471.45

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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重大改变。在二季度中后期阶段性参与了新股的申购。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

公司于2015年3月12日第三届董事会第五次会议中通过决议，为本基金提供审计的会计师事务所变更为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。公司已于2015年3月14日编制临时公告，披露于中国证券报、上海证券报和证券时报。

### 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

本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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
爱建证券	1	600,434,946.49	58.94%	546,636.74	58.94%	—

浙商证券	2	352,238,134.23	34.58%	320,676.19	34.58%	—
招商证券	2	66,004,833.48	6.48%	60,090.57	6.48%	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—
宏源证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	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光大证券交易单元。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例

爱建证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	4,080,000,000.00	100.00%	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
川财证券	—	—	—	—	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年4月22日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于股东变更的公告》，公告披露：根据上海市政府的要求，经上海国盛（集团）有限公司批准，本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司（以下简称“上海盛融”）由其母公司上海国盛集团资产管理有限公司（以下简称“上海国盛”）吸收合并，上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继，本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。相关工商变更登记手续已办理完毕并已报中国证监会备案。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一五年八月二十五日