

# 浦银安盛红利精选混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 浦银安盛红利精选混合  |
| 基金主代码      | 519115  |
| 交易代码       | 519115  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2009 年 12 月 3 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 72,126,854.25 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格执行投资风险管理的前提下，通过投资于盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司和国内依法公开发行上市的各种债券，力争为投资者提供稳定的当期收益和长期的资本增值。   |
| 投资策略       | 本基金坚持关注稳健收益、长期价值的投资理念，根据宏观经济周期性波动规律，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，在资产动态配置过程中始终坚持以风险预算理念进行合理控制，在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。<br>本基金所指的红利型股票是基本面健康的、盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的快速及长期稳定增长的上市公司。本基金将采取基础库初选、核心库精选个股的策略，对拟投资的红利型上市公司加以甄别。 |
| 业绩比较基准     | 中证红利指数×75%+中证全债指数×25%   |

|        |  |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。 |
| 基金管理人  | 浦银安盛基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 中国工商银行股份有限公司   |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2016年4月1日—2016年6月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -3,723,903.19             |
| 2. 本期利润         | 7,687,021.44              |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0951                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 114,716,261.94            |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.590                     |

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。

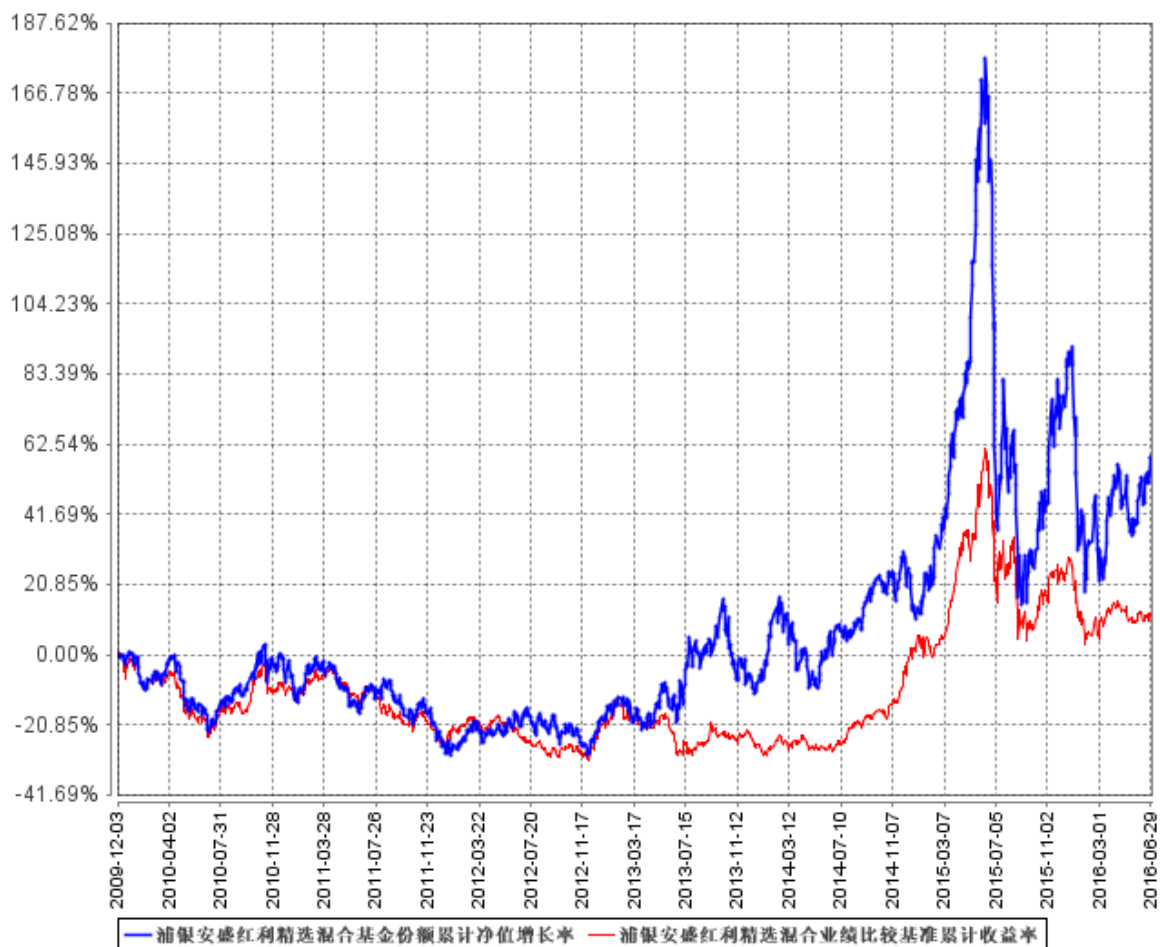
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 6.93%      | 1.98%         | -1.63%         | 0.77%                 | 8.56% | 1.21% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：自 2015 年 8 月 4 日起，本基金类型由股票型变更为混合型，本基金的基金名称变更为“浦银安盛红利精选混合型证券投资基金”。具体内容详见基金管理人于 2015 年 8 月 4 日发布的《关于浦银安盛红利精选股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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 |        |  |
| 陈蔚丰 | 公司旗下浦银安盛医疗健康混合基金基金经理、浦银安盛红利 | 2016 年 1 月 14 日 | -    | 8      | 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 |

|    |   |            |            |   |  |
|----|---|------------|------------|---|--|
|    | 精选混合型证券投资基金   |            |            |   | 管理有限公司担任行业研究员之职。2013年2月，提拔至高级研究员，先后负责过医药、煤炭、旅游、计算机等行业及上市公司的研究。2014年7月，陈蔚丰女士调转至权益投资部，担任公司旗下股票基金经理助理。2015年5月起，担任浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年1月起，兼任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金经理。  |
| 吴勇 | 本公司投资总监、权益投资部总监，公司旗下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、浦银安盛睿智精选混合基金经理 | 2010年4月14日 | 2016年1月14日 | 9 | 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-2016年1月起担任浦银安盛红利精选混合基金基金经理。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。2016 年 3 月起兼任浦银安盛睿智精选混合基金基金经理。2012 年 11 月起兼任本公司权益投资部总监。2016 年 4 月起兼任本公司投资总监。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1. 此处的任职日期和离任日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。

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，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，本着诚实信用、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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了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。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向

交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

市场在一季度经历了大幅的波动，二季度走势相对平稳，期间受到权威人士讲话、证监会对并购重组加强监管等因素影响也曾出现一定波动，但是波动幅度相对较小，并且市场不再是普跌，板块走势开始分化，红利基金在二季度保持较高的仓位，积极在景气度相对较高的行业比如新能源、新材料、电子等板块中中寻找优质个股。。

展望后市，国内，证监会自新主席上任后多有举措，包括完善停牌制度、并购重组监管加强，这些制度的规范化建设，有利于股市的长期发展；经济层面，政府通过积极的财政政策和货币政策保证经济平稳较快的增长。国际方面，英国脱欧公投结束，为了应对英国脱欧，预计各国央行会采取更加宽松的措施，美国加息的概率也大幅降低。不过汇率贬值，英国脱欧对经济政治的中长期影响等因素仍是潜在风险点，综上所述对于后市谨慎乐观，会在景气度相对较高的行业中寻找估值相对合理的优质个股参与。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值增长 6.93%，同期业绩基准下降 1.63%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 106,413,670.49 | 90.31        |
|    | 其中：股票             | 106,413,670.49 | 90.31        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 8,282,465.57   | 7.03         |

|   |      |                |        |
|---|------|----------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 3,139,121.28   | 2.66   |
| 9 | 合计   | 117,835,257.34 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 73,532,774.23  | 64.10        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,958,200.00   | 4.32         |
| E  | 建筑业              | 65,395.92      | 0.06         |
| F  | 批发和零售业           | 2,897,760.00   | 2.53         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,915,500.00   | 1.67         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,997,485.62  | 13.07        |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 2,877,276.00   | 2.51         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,140,600.00   | 0.99         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,522,780.32   | 1.33         |
| 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               | 2,501,268.40   | 2.18         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 4,630.00       | 0.00         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 106,413,670.49 | 92.76        |

### 5.3 报告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

| 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  | 002247 | 帝龙新材 | 300,000 | 4,461,000.00 | 3.89         |
| 2  | 300449 | 汉邦高科 | 60,000  | 3,428,400.00 | 2.99         |
| 3  | 000835 | 长城动漫 | 234,300 | 3,315,345.00 | 2.89         |
| 4  | 002184 | 海得控制 | 120,000 | 3,157,200.00 | 2.75         |
| 5  | 300366 | 创意信息 | 79,907  | 3,025,279.02 | 2.64         |
| 6  | 000421 | 南京中北 | 300,000 | 3,003,000.00 | 2.62         |



|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7  | 002502 | 骅威股份 | 120,000 | 2,952,000.00 | 2.57 |
| 8  | 002634 | 棒杰股份 | 275,600 | 2,918,604.00 | 2.54 |
| 9  | 002599 | 盛通股份 | 80,000  | 2,865,600.00 | 2.50 |
| 10 | 002587 | 奥拓电子 | 179,934 | 2,754,789.54 | 2.40 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 63,015.90    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,891,747.13 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,427.57     |
| 5  | 应收申购款   | 181,930.68   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,139,121.28 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 000835 | 长城动漫 | 3,315,345.00   | 2.89         | 临时停牌     |
| 2  | 002587 | 奥拓电子 | 2,754,789.54   | 2.40         | 临时停牌     |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |               |
|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 77,504,176.21 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 29,457,159.04 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 34,834,481.00 |

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 72, 126, 854. 25 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 4 月 26 日发布《关于变更公司经营范围及修订〈公司章程〉的公告》，公告披露：根据浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会有关决议，本公司经营范围由“基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务”变更为“基金募集、基金销售、资产管理，境外证券投资管理和证监会许可的其他业务”。根据相关法规及规范性文件的规定，本公司结合变更经营范围等事项修改了《公司章程》中的有关内容。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

## 9.2 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。

## 9.3 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  
2016 年 7 月 21 日