

# 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

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

送出日期：2016 年 8 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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的情况.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛价值成长混合型证券投资基金
基金简称	浦银安盛价值成长混合
基金主代码	519110
交易代码	519110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 16 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
报告期末基金份额总额	1,446,938,384.01 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求长期资本增值为目的，通过投资于被市场低估的具有价值属性或可预期的具有持续成长属性的股票，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速增长的成果，进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资策略，在投资策略上充分体现“价值”和“成长”的主导思想。在基本面分析的基础上，结合深入的实地调研和估值研究，对于符合本基金理念的标的股票进行精选投资。</p> <p>“价值”是指甄别公司的核心价值，通过自下而上的研究，以基本面研究为核心，力求卓有远见地挖掘出被市场忽视的价值低估型公司。价值因素主要表现在相对市场股价比较高的自由现金流、比较高的每股收益和净资产。</p> <p>“成长”主要表现在可持续性、可预见性的增长。寻找成长型公司重点在于对公司成长性的客观评价和比较上，不仅仅需要关注成长的数量，同时还要关注成长的质量，希望上市公司的成长能给上市公司股东带来实际收益的增长，而非简单粗放的规模增长。此外我们还要关注上市公司成长的可持续性和可预见性。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+中证全债指数×25%。
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金，坚持长期和基于基本面研究的投资理念，属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。一般情形下，其风险和收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金资

	产的安全和增值。
--	----------

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	洪渊
	联系电话	021-23212888	010-66105799
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95588
传真		021-23212985	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市淮海中路 381 号中 环广场 38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200020	100140
法定代表人		姜明生	易会满

## 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》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-142,857,760.81

本期利润	-744, 519, 358. 13
加权平均基金份额本期利润	-0. 4953
本期加权平均净值利润率	-33. 31%
本期基金份额净值增长率	-22. 57%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )</b>
期末可供分配利润	231, 398, 121. 00
期末可供分配基金份额利润	0. 1599
期末基金资产净值	2, 252, 756, 825. 73
期末基金份额净值	1. 557
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )</b>
基金份额累计净值增长率	75. 07%

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。

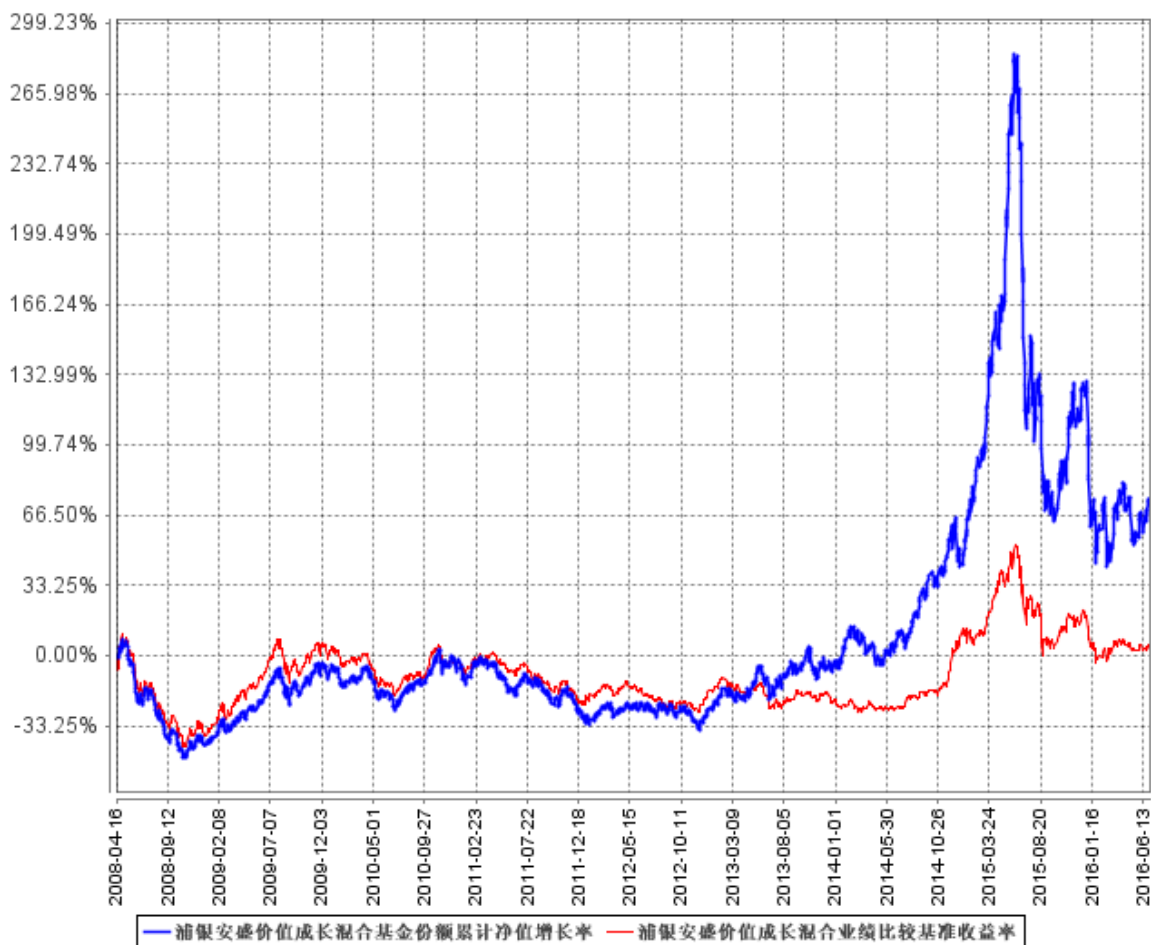
4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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	6. 57%	1. 84%	-0. 17%	0. 74%	6. 74%	1. 10%
过去三个月	1. 63%	2. 03%	-1. 35%	0. 76%	2. 98%	1. 27%
过去六个月	-22. 57%	3. 08%	-11. 14%	1. 38%	-11. 43%	1. 70%
过去一年	-38. 17%	3. 07%	-21. 27%	1. 73%	-16. 90%	1. 34%
过去三年	116. 40%	2. 36%	38. 07%	1. 38%	78. 33%	0. 98%
自基金合同生效起至今	75. 07%	1. 88%	4. 98%	1. 39%	70. 09%	0. 49%

### 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



## § 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、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2016 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 21 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、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、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、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、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)、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、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金以及浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行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		
蒋建伟	公司旗下浦银安盛价值成长混合基金和浦银安盛	2010 年 7 月 21 日	-	15	蒋建伟先生，毕业于上海财经大学。2001 年至 2007 年在上海东新国际投资管理有限公司担任研究员、投资经理助理。2007 年加盟浦银安盛基金管理有限公司，先后担任行业研究

	增长动力混合基金基金经理, 公司权益投资部副总监				员, 基金经理助理等岗位。2010 年 7 月起, 担任浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金经理。2012 年 6 月至 2013 年 9 月, 兼任浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金经理。2014 年 5 月至 2016 年 1 月, 兼任浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起, 兼任浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 4 月起兼任公司权益投资部副总监。
李芳	原权益类基金经理助理	2015 年 12 月 1 日	2016 年 4 月 18 日	5	李芳女士, 同济大学技术经济及管理专业博士。2011 年 5 月加盟浦银安盛基金管理公司研究部担任行业研究员, 2015 年 12 月调岗至权益投资部担任公司旗下权益基金基金经理助理, 2016 年 4 月调岗至专户管理部担任投资经理。

注: 1、此处的“任职日期”和“离任日期”指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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

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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，A 股市场延续了 15 年比较动荡的态势，在年初熔断的干扰下，A 股市场在一月份就经历了大幅下跌，随后就开始慢慢起稳，总体维持了一个窄幅震荡的格局。宏观经济在二季度也开始有一定的复苏迹象，加上宽松的货币环境，也给市场提供了一定的宽松的环境，但是未来仍有较大的不确定性，因此市场并没有出现较好的反弹，只是出现了局部的结构性行情。纵观上半年，以白酒和家电为代表的低估值，现金流较好的行业表现突出，其次新能源汽车以及电子板块也表现较为优异。而其他行业都较为疲弱。

上半年，本基金在 1 月份所受损失较大，在二季度净值有所恢复。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内业绩比较基准下跌 11.14%，基金净值下跌 22.57%。

### 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，虽然国内外的形势都不是非常明朗，而且宽松的货币政策没法更进一步宽松，但是维持相对较为宽松的货币环境仍然是大概率事件。加上 A 股市场整体处于一个估值相对较为便宜的位置，因此市场可能仍会以震荡和结构性行情为主，除非出现系统性的风险。

#### 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》第十五部分第三条约定，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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内对 2015 年基金利润进行了收益分配，分配金额为 164,542,464.42 元。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格

遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的管理人——浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，浦银安盛证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 164,542,464.42 元。

## 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

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。。

# § 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：浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	125,662,869.92	156,150,501.31
结算备付金		2,975,522.52	5,170,962.54
存出保证金		498,093.36	2,422,070.02
交易性金融资产	6.4.7.2	2,117,975,507.19	3,057,529,081.84
其中：股票投资		2,117,975,507.19	3,057,529,081.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		19,683,957.04	18,871,239.91
应收利息	6.4.7.5	22,471.75	37,125.31
应收股利		-	-

应收申购款		1,327,997.35	3,052,995.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,268,146,419.13	3,243,233,976.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,809,767.05	12,288,265.86
应付管理人报酬		2,653,818.52	4,064,331.66
应付托管费		442,303.11	677,388.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,354,086.16	2,955,066.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,129,618.56	1,284,283.91
负债合计		15,389,593.40	21,269,336.24
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,446,938,384.01	1,491,553,953.70
未分配利润	6.4.7.10	805,818,441.72	1,730,410,686.29
所有者权益合计		2,252,756,825.73	3,221,964,639.99
负债和所有者权益总计		2,268,146,419.13	3,243,233,976.23

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.557 元，基金份额总额为 1,446,938,384.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-720,487,594.85	2,782,457,518.83
1.利息收入		511,353.55	1,618,245.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	511,119.89	1,618,245.89
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		233.66	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-119,937,368.56	1,390,733,880.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-124,540,811.52	1,380,924,205.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,603,442.96	9,809,675.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-601,661,597.32	1,374,355,504.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	600,017.48	15,749,887.78
<b>减：二、费用</b>		24,031,763.28	68,608,808.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,729,111.38	42,804,419.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,788,185.35	7,134,069.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,264,218.63	18,416,539.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	250,247.92	253,779.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-744,519,358.13	2,713,848,710.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-744,519,358.13	2,713,848,710.14

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,491,553,953.70	1,730,410,686.29	3,221,964,639.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-744,519,358.13	-744,519,358.13

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)	-44,615,569.69	-15,530,422.02	-60,145,991.71
其中: 1.基金申购款	289,839,203.07	147,161,228.61	437,000,431.68
2.基金赎回款	-334,454,772.76	-162,691,650.63	-497,146,423.39
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)	-	-164,542,464.42	-164,542,464.42
五、期末所有者权益(基金净值)	1,446,938,384.01	805,818,441.72	2,252,756,825.73
项目	上年度可比期间 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)	1,918,932,505.81	847,936,505.90	2,766,869,011.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,713,848,710.14	2,713,848,710.14
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)	446,183,615.12	595,412,378.99	1,041,595,994.11
其中: 1.基金申购款	5,683,508,674.85	8,221,472,325.79	13,904,981,000.64
2.基金赎回款	-5,237,325,059.73	-7,626,059,946.80	-12,863,385,006.53
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)	-	-125,457,603.63	-125,457,603.63
五、期末所有者权益(基金净值)	2,365,116,120.93	4,031,739,991.40	6,396,856,112.33

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
郁蓓华

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
钱琨

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浦银安盛价值成长混合型证券投资基金(原名为浦银安盛价值成长股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可字[2008]第263号《关于同意浦银安盛价值成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,731,976,982.82元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第41号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金合同》于2008年4月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,733,163,625.10份基金份额,其中认购资金利息折合1,186,642.28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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金管理人于2015年8月4日发布的《关于浦银安盛价值成长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》,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月4日起将本基金变更为混合型证券投资基金,本基金基金名称变更为“浦银安盛价值成长混合型证券投资基金”,本基金业绩比较基准变更为“沪深300指数×75%+中证全债指数×25%”,基金合同中的相关条款亦做相应修订。

根据本基金基金管理人2015年11月2日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金增加H类份额并相应修订基金合同部分条款的公告》,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,自2015年11月2日起,本基金根据基金销售地及申购赎回费率的不同,将基金份额分为不同的类别。仅在中国大陆地区销售,并收取申购和赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;仅在中国香港地区销售,并收取申购和赎回费用的基金份额,称为H类基金份额。两类基金份额分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额将全部自动转换为浦银安盛价值成长混合型证券投资基金A类份额,业务规则保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%;债券、货币市场工具、现金、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证券品种占基金资产的5%-40%,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%；投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%-3%。自基金合同生效日至 2015 年 8 月 3 日，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 X 75% + 中信标普国债指数 X 25%。自 2015 年 8 月 4 日起，本基金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数 × 75% + 中证全债指数 × 25%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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。

#### 6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《关于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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	125,662,869.92
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	125,662,869.92

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,041,997,091.39	2,117,975,507.19	75,978,415.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
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	2,041,997,091.39	2,117,975,507.19	75,978,415.80

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	21,064.87
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	1,205.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	201.78
合计	22,471.75

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,354,086.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,354,086.16

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	29,438.62
预提费用	350,179.94
合计	1,129,618.56

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,491,553,953.70	1,491,553,953.70
本期申购	289,839,203.07	289,839,203.07
本期赎回(以“-”号填列)	-334,454,772.76	-334,454,772.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,446,938,384.01	1,446,938,384.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	545,082,000.21	1,185,328,686.08	1,730,410,686.29
本期利润	-142,857,760.81	-601,661,597.32	-744,519,358.13
本期基金份额交易产生的变动数	-6,283,653.98	-9,246,768.04	-15,530,422.02
其中：基金申购款	68,979,889.63	78,181,338.98	147,161,228.61
基金赎回款	-75,263,543.61	-87,428,107.02	-162,691,650.63
本期已分配利润	-164,542,464.42	-	-164,542,464.42
本期末	231,398,121.00	574,420,320.72	805,818,441.72

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	485,267.87
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	18,036.13
其他	7,815.89
合计	511,119.89

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,474,861,620.62
减：卖出股票成本总额	1,599,402,432.14
买卖股票差价收入	-124,540,811.52

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,603,442.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,603,442.96

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-601,661,597.32
——股票投资	-601,661,597.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-601,661,597.32

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	555,307.28
转换费收入	24,710.20
其他	20,000.00

合计	600,017.48
----	------------

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,264,218.63
银行间市场交易费用	-
合计	4,264,218.63

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	51,218.44
信息披露费	188,961.50
银行汇划费用	1,067.98
债券帐户维护费	9,000.00
合计	250,247.92

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构



中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
--------------	--------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：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。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：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。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：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。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,729,111.38	42,804,419.55
其中：支付销售机构的客户维护费	5,040,046.89	12,115,604.49

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,788,185.35	7,134,069.98

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

**6.4.10.2.3 销售服务费**

注：本基金无销售服务费

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：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。

**6.4.10.4.2 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**

注：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。

**6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
中国工商银行股份有限公司	125,662,869.92	485,267.87	648,322,606.76	1,528,707.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：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。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 1 月 19 日	2016 年 1 月 19 日	2016 年 1 月 19 日	1.1000	101,695,498.61	62,846,965.81	164,542,464.42	注：收益 分配基准 日为 2015 年 12 月 31 日
合计	-	-	-	1.1000	101,695,498.61	62,846,965.81	164,542,464.42	

### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
601966	玲珑 轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流 通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏 泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流 通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大 国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流 通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元 股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流 通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600358	国旅联合	2016年4月5日	临时停牌	13.50	2016年8月5日	12.57	2,641,855	34,621,443.41	35,665,042.50	-
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
300334	津膜科技	2016年5月20日	临时停牌	18.05	-	-	9,400	425,267.28	169,670.00	-
300166	东方国信	2016年6月8日	临时停牌	27.47	-	-	6,000	47,878.35	164,820.00	-
002280	联络互动	2016年4月25日	临时停牌	19.71	-	-	2,280	13,256.33	44,938.80	-
300355	蒙草抗旱	2016年6月30日	临时停牌	7.11	2016年7月6日	7.38	3,500	25,755.86	24,885.00	-
000718	苏宁环球	2016年1月4日	临时停牌	13.09	2016年7月18日	11.78	461	5,259.55	6,034.49	-
300223	北京君正	2016年6月3日	临时停牌	44.00	-	-	6	298.34	264.00	-

注：本基金截至 2016 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。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末 2016 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。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截止本报告期末 2016 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、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证券品种占基金资产的 5%-40%，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%。投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%—3%。本基金投资于资产支持证券以及衍生工具的比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品或者衍生工具，将依据有关法律法规进行投资管理。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如果法律法规对上述比例要求有变更的，本基金投资范围将及时做出相应调整，以调整变更后的比例为准。

本基金将通过定性与定量的方法筛选出基本面健康的、具有价值属性或成长属性或两种属性兼具的股票作为本基金的核心投资目标，本基金将有百分之八十以上的股票基金资产投资于这些股票。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

合规性进行监督和检查。

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (2015 年 12 月 31 日：0%)。

##### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (2015 年 12 月 31 日：0%)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

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

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

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	125,662,869.92	-	-	-	125,662,869.92
结算备付金	2,975,522.52	-	-	-	2,975,522.52
存出保证金	498,093.36	-	-	-	498,093.36
交易性金融资产	-	-	-	-2,117,975,507.19	2,117,975,507.19
应收证券清算款	-	-	-	19,683,957.04	19,683,957.04
应收利息	-	-	-	22,471.75	22,471.75
应收申购款	-	-	-	1,327,997.35	1,327,997.35
资产总计	129,136,485.80	-	-	-2,139,009,933.33	2,268,146,419.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,809,767.05	9,809,767.05
应付管理人报酬	-	-	-	2,653,818.52	2,653,818.52
应付托管费	-	-	-	442,303.11	442,303.11
应付交易费用	-	-	-	1,354,086.16	1,354,086.16
其他负债	-	-	-	1,129,618.56	1,129,618.56
负债总计	-	-	-	15,389,593.40	15,389,593.40
利率敏感度缺口	129,136,485.80	-	-	-2,123,620,339.93	2,252,756,825.73
上年度末 2015 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	156,150,501.31	-	-	-	156,150,501.31
结算备付金	5,170,962.54	-	-	-	5,170,962.54
存出保证金	2,422,070.02	-	-	-	2,422,070.02
交易性金融资产	-	-	-	-3,057,529,081.84	3,057,529,081.84
应收证券清算款	-	-	-	18,871,239.91	18,871,239.91
应收利息	-	-	-	37,125.31	37,125.31
应收申购款	-	-	-	3,052,995.30	3,052,995.30
资产总计	163,743,533.87	-	-	-3,079,490,442.36	3,243,233,976.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,288,265.86	12,288,265.86
应付管理人报酬	-	-	-	4,064,331.66	4,064,331.66
应付托管费	-	-	-	677,388.61	677,388.61
应付交易费用	-	-	-	2,955,066.20	2,955,066.20
其他负债	-	-	-	1,284,283.91	1,284,283.91
负债总计	-	-	-	21,269,336.24	21,269,336.24
利率敏感度缺口	163,743,533.87	-	-	-3,058,221,106.12	3,221,964,639.99

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。



#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (2015 年 12 月 31 日：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、货币市场工具、现金、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证券品种为 5%-40%，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%。投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%-3%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	2,117,975,507.19	94.02	3,057,529,081.84	94.90
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	2,117,975,507.19	94.02	3,057,529,081.84	94.90

#### 6.4.13.4.3.2 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	224,875,371.72	183,891,876.22
	业绩比较基准下降5%	-224,875,371.72	-183,891,876.22

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,117,975,507.19	93.38
	其中：股票	2,117,975,507.19	93.38
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	128,638,392.44	5.67
7	其他各项资产	21,532,519.50	0.95
8	合计	2,268,146,419.13	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	55,639,839.48	2.47
B	采矿业	60,704,801.02	2.69
C	制造业	865,100,598.08	38.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,880.12	0.00
E	建筑业	46,868,047.74	2.08
F	批发和零售业	149,969,210.63	6.66
G	交通运输、仓储和邮政业	5,486.30	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	739,423,228.34	32.82
J	金融业	11,417.56	0.00
K	房地产业	98,918,691.06	4.39
L	租赁和商务服务业	42,213,763.74	1.87
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	275,160.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	440,121.10	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	56,861,743.78	2.52
S	综合	1,508,392.00	0.07
	合计	2,117,975,507.19	94.02

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300287	飞利信	12,849,640	172,185,176.00	7.64
2	300207	欣旺达	3,708,168	95,188,672.56	4.23
3	300226	上海钢联	1,839,250	92,698,200.00	4.11
4	300047	天源迪科	4,457,915	88,935,404.25	3.95

5	002224	三力士	3,399,959	78,709,050.85	3.49
6	600687	刚泰控股	4,776,215	77,661,255.90	3.45
7	300031	宝通科技	2,867,776	73,185,643.52	3.25
8	002609	捷顺科技	4,023,977	70,781,755.43	3.14
9	603019	DR 中科曙	1,659,773	66,092,160.86	2.93
10	000701	厦门信达	3,592,454	63,334,964.02	2.81
11	600410	华胜天成	5,519,922	61,933,524.84	2.75
12	002335	科华恒盛	1,263,138	61,287,455.76	2.72
13	000938	紫光股份	1,003,973	61,121,876.24	2.71
14	600259	广晟有色	1,059,995	60,695,313.70	2.69
15	300296	利亚德	1,879,910	59,517,950.60	2.64
16	300098	高新兴	3,614,144	57,392,606.72	2.55
17	000673	当代东方	4,474,814	56,069,419.42	2.49
18	000592	平潭发展	8,206,466	55,639,839.48	2.47
19	600185	格力地产	8,399,216	52,159,131.36	2.32
20	600718	东软集团	2,609,350	47,803,292.00	2.12
21	600158	中体产业	2,599,989	46,149,804.75	2.05
22	300197	铁汉生态	3,269,731	45,318,471.66	2.01
23	600120	浙江东方	2,075,181	45,052,179.51	2.00
24	300198	纳川股份	2,773,368	44,623,491.12	1.98
25	300337	银邦股份	5,357,752	42,165,508.24	1.87
26	000516	国际医学	6,961,222	40,723,148.70	1.81
27	600338	西藏珠峰	1,348,600	39,635,354.00	1.76
28	002093	国脉科技	3,149,846	39,089,588.86	1.74
29	300009	安科生物	1,299,896	38,840,892.48	1.72
30	300109	新开源	606,144	38,490,144.00	1.71
31	300075	数字政通	1,499,990	38,474,743.50	1.71
32	600358	国旅联合	2,641,855	35,665,042.50	1.58
33	300352	北信源	1,774,620	33,132,155.40	1.47
34	300155	安居宝	1,540,126	22,609,049.68	1.00
35	002605	姚记扑克	1,318,208	21,499,972.48	0.95
36	300202	聚龙股份	837,468	20,275,100.28	0.90
37	300096	易联众	940,511	17,248,971.74	0.77
38	300033	同花顺	120,971	9,853,087.95	0.44
39	300183	东软载波	300,170	7,954,505.00	0.35
40	600118	中国卫星	232,502	7,812,067.20	0.35
41	300071	华谊嘉信	600,000	6,480,000.00	0.29
42	002537	海立美达	100,000	3,040,000.00	0.13
43	002118	紫鑫药业	204,938	3,012,588.60	0.13

44	600549	厦门钨业	100,000	2,971,000.00	0.13
45	300026	红日药业	107,720	1,873,250.80	0.08
46	600260	凯乐科技	92,200	1,508,392.00	0.07
47	002223	鱼跃医疗	26,900	853,268.00	0.04
48	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
49	300262	巴安水务	43,000	658,760.00	0.03
50	002699	美盛文化	19,000	634,410.00	0.03
51	300328	宜安科技	33,840	594,907.20	0.03
52	002179	中航光电	10,480	453,993.60	0.02
53	002436	兴森科技	19,576	446,137.04	0.02
54	600240	华业资本	44,338	444,266.76	0.02
55	600661	新南洋	15,685	440,121.10	0.02
56	002345	潮宏基	40,300	394,134.00	0.02
57	002462	嘉事堂	9,400	350,150.00	0.02
58	000997	新大陆	16,613	332,924.52	0.01
59	300339	润和软件	9,131	327,255.04	0.01
60	600826	兰生股份	10,000	261,800.00	0.01
61	300229	拓尔思	12,137	259,489.06	0.01
62	000902	新洋丰	20,000	250,200.00	0.01
63	000888	峨眉山A	20,156	242,678.24	0.01
64	000963	华东医药	3,366	226,868.40	0.01
65	002001	新和成	10,000	211,300.00	0.01
66	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
67	300165	天瑞仪器	19,088	206,723.04	0.01
68	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
69	600536	中国软件	7,900	196,868.00	0.01
70	300334	津膜科技	9,400	169,670.00	0.01
71	300166	东方国信	6,000	164,820.00	0.01
72	002466	天齐锂业	3,800	162,222.00	0.01
73	002519	银河电子	6,660	149,317.20	0.01
74	002230	科大讯飞	4,381	143,915.85	0.01
75	600730	中国高科	9,840	139,039.20	0.01
76	300034	钢研高纳	5,858	129,461.80	0.01
77	600562	国睿科技	3,198	109,659.42	0.00
78	601801	皖新传媒	8,818	102,906.06	0.00
79	600519	贵州茅台	324	94,582.08	0.00
80	002310	东方园林	3,790	90,656.80	0.00
81	002189	利达光电	2,980	84,214.80	0.00
82	300392	腾信股份	2,982	80,752.56	0.00

83	600587	新华医疗	3,454	79,752.86	0.00
84	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
85	300024	机器人	2,682	68,095.98	0.00
86	300235	方直科技	2,598	64,560.30	0.00
87	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
88	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
89	600415	小商品城	9,350	57,783.00	0.00
90	000733	振华科技	2,357	53,032.50	0.00
91	300364	中文在线	993	51,636.00	0.00
92	600571	信雅达	918	50,600.16	0.00
93	000971	高升控股	1,953	48,668.76	0.00
94	300359	全通教育	1,597	47,367.02	0.00
95	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
96	002280	联络互动	2,280	44,938.80	0.00
97	300322	硕贝德	1,767	37,990.50	0.00
98	002153	石基信息	1,371	36,166.98	0.00
99	300004	南风股份	1,760	34,496.00	0.00
100	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
101	300190	维尔利	1,870	32,481.90	0.00
102	002544	杰赛科技	978	31,364.46	0.00
103	300048	合康变频	2,618	30,787.68	0.00
104	002450	康得新	1,509	25,803.90	0.00
105	002013	中航机电	1,857	25,032.36	0.00
106	300355	蒙草抗旱	3,500	24,885.00	0.00
107	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
108	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
109	002727	一心堂	804	20,100.00	0.00
110	600198	大唐电信	1,000	19,880.00	0.00
111	300115	长盈精密	963	19,837.80	0.00
112	600197	伊力特	1,194	17,957.76	0.00
113	000526	银润投资	351	17,339.40	0.00
114	002439	启明星辰	652	16,841.16	0.00
115	600703	三安光电	759	15,157.23	0.00
116	300054	鼎龙股份	589	14,736.78	0.00
117	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
118	002664	信质电机	383	13,029.66	0.00
119	600109	国金证券	847	11,417.56	0.00
120	300221	银禧科技	531	10,843.02	0.00
121	300188	美亚柏科	393	10,469.52	0.00

122	000603	盛达矿业	519	9,487.32	0.00
123	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
124	002690	美亚光电	361	8,317.44	0.00
125	600057	象屿股份	792	8,141.76	0.00
126	000718	苏宁环球	461	6,034.49	0.00
127	600886	国投电力	900	5,940.00	0.00
128	601028	玉龙股份	792	5,654.88	0.00
129	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
130	600115	东方航空	830	5,486.30	0.00
131	002368	太极股份	154	5,471.62	0.00
132	600617	国新能源	476	5,454.96	0.00
133	000988	华工科技	264	5,293.20	0.00
134	300170	汉得信息	324	4,918.32	0.00
135	300065	海兰信	120	4,641.60	0.00
136	600189	吉林森工	398	4,509.34	0.00
137	000722	湖南发展	252	3,485.16	0.00
138	000525	红太阳	262	3,426.96	0.00
139	300336	新文化	135	3,372.30	0.00
140	300058	蓝色光标	288	2,796.48	0.00
141	300072	三聚环保	85	2,349.40	0.00
142	000534	万泽股份	137	2,039.93	0.00
143	002273	水晶光电	66	1,847.34	0.00
144	000555	神州信息	48	1,554.72	0.00
145	600038	中直股份	29	1,202.92	0.00
146	002049	同方国芯	26	1,142.70	0.00
147	600261	阳光照明	136	960.16	0.00
148	600340	华夏幸福	34	828.92	0.00
149	300085	银之杰	26	777.40	0.00
150	300159	新研股份	28	505.40	0.00
151	300403	地尔汉宇	7	388.99	0.00
152	300223	北京君正	6	264.00	0.00
153	600622	嘉宝集团	15	206.25	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000938	紫光股份	67,854,550.86	2.11
2	603019	DR 中科曙	62,015,741.10	1.92
3	300031	宝通科技	61,006,864.00	1.89
4	002224	三力士	57,844,801.85	1.80
5	600115	东方航空	55,715,596.26	1.73
6	002335	科华恒盛	53,374,203.56	1.66
7	600158	中体产业	50,161,502.10	1.56
8	600259	广晟有色	48,834,420.65	1.52
9	300296	利亚德	46,179,473.30	1.43
10	300337	银邦股份	41,618,789.88	1.29
11	300197	铁汉生态	40,899,524.26	1.27
12	600338	西藏珠峰	40,614,123.12	1.26
13	002093	国脉科技	38,880,084.92	1.21
14	002630	华西能源	38,312,446.99	1.19
15	300075	数字政通	36,163,408.34	1.12
16	002345	潮宏基	35,011,791.65	1.09
17	600358	国旅联合	34,621,443.41	1.07
18	002174	游族网络	33,739,988.00	1.05
19	002605	姚记扑克	31,012,485.87	0.96
20	000570	苏常柴A	30,319,229.69	0.94

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	000534	万泽股份	72,509,212.93	2.25
2	600687	刚泰控股	69,802,840.59	2.17
3	300235	方直科技	62,112,083.40	1.93
4	002504	弘高创意	61,863,004.56	1.92
5	300212	易华录	60,365,018.11	1.87
6	000673	当代东方	58,439,379.10	1.81
7	002174	游族网络	53,747,559.75	1.67
8	600115	东方航空	52,727,029.00	1.64
9	300202	聚龙股份	49,511,749.44	1.54
10	002241	歌尔声学	45,471,942.67	1.41



11	600240	华业资本	44,281,964.75	1.37
12	002205	国统股份	43,468,943.57	1.35
13	002104	恒宝股份	43,231,137.90	1.34
14	600536	中国软件	42,180,896.55	1.31
15	600562	国睿科技	40,902,951.67	1.27
16	002664	信质电机	35,809,243.00	1.11
17	002345	潮宏基	33,703,277.75	1.05
18	002630	华西能源	31,293,113.38	0.97
19	000570	苏常柴A	30,421,374.00	0.94
20	600730	中国高科	28,480,763.30	0.88

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,261,510,454.81
卖出股票收入（成交）总额	1,474,861,620.62

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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	498,093.36
2	应收证券清算款	19,683,957.04
3	应收股利	-
4	应收利息	22,471.75
5	应收申购款	1,327,997.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,532,519.50

### 7.12.4 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。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

**§ 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
118,908	12,168.55	17,513,390.31	1.21%	1,429,424,993.70	98.79%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	713,238.92	0.05%

**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的情况**

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	10~50

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2008年4月16日）基金份额总额	1,733,163,625.10
本报告期期初基金份额总额	1,491,553,953.70
本报告期基金总申购份额	289,839,203.07
减：本报告期基金总赎回份额	334,454,772.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	1,446,938,384.01
-------------	------------------

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改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

安信证券	2	1,002,712,875.84	36.67%	933,826.10	36.67%	-
方正证券	2	874,755,203.91	31.99%	814,660.53	31.99%	-
东方证券	1	464,193,993.64	16.97%	432,304.94	16.97%	-
光大证券	1	392,965,991.38	14.37%	365,972.67	14.37%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中国中投	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	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：

本基金本报告期无新增交易单元。

### 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

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	报刊及公司网站	2016年1月5日
2	关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	报刊及公司网站	2016年1月7日
3	浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2015 年度分红公告	报刊及公司网站	2016年1月15日
4	浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	报刊及公司网站	2016年1月21日
5	关于旗下部分基金在上海凯石财富基金销售有限公司开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016年1月27日
6	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛消费升级混合基金C类在公司直销柜台和电子直销平台开通日常转换、定期定额投资业务的公告	报刊及公司网站	2016年1月27日
7	浦银安盛关于旗下部分基金新增深圳众禄金融控股股份有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016年3月10日
8	浦银安盛关于旗下部分基金新增	报刊及公司网站	2016年3月17日

	深圳富济财富管理有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告		
9	浦银安盛关于旗下部分基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 3 月 22 日
10	浦银安盛关于旗下部分基金新增上海联泰资产管理有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 3 月 30 日
11	关于旗下部分基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 3 月 30 日
12	浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2016 年 3 月 30 日
13	浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2015 年年度报告	公司网站	2016 年 3 月 30 日
14	浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	报刊及公司网站	2016 年 3 月 30 日
15	关于浦银睿智精选基金在浦发银行开通基金定投及基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016 年 4 月 5 日
16	关于浦银睿智精选基金在交通银行开通基金定投和基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 4 月 5 日
17	关于新增中信银行为浦银安盛睿	报刊及公司网站	2016 年 4 月 7 日

	智精选灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金定投及基金转换业务的公告		
18	关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠的公告	报刊及公司网站	2016 年 4 月 14 日
19	浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	报刊及公司网站	2016 年 4 月 20 日
20	关于变更公司经营范围及修订《公司章程》的公告	报刊及公司网站	2016 年 4 月 26 日
21	浦银安盛关于旗下部分基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 5 月 12 日
22	关于旗下部分基金在上海联泰资产管理有限公司开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016 年 5 月 12 日
23	浦银安盛价值成长混合型基金招募说明书更新正文（2016 年第 1 号）	公司网站	2016 年 5 月 27 日
24	浦银安盛价值成长混合型基金招募说明书更新摘要（2016 年第 1 号）	报刊及公司网站	2016 年 5 月 27 日
25	浦银安盛关于旗下部分基金新增平安证券为代销机构并开通基金定投业务和基金转换业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 5 月 31 日
26	关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 6 月 13 日



27	关于电子直销平台通联支付渠道 新增招商银行卡和交通银行卡的 公告	报刊及公司网站	2016 年 6 月 17 日
28	关于旗下部分基金参加交通银行 网上银行、手机银行基金申购费 率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2016 年 6 月 24 日
29	关于旗下部分基金新增上海银行 为代销机构并开通基金定投业务 和基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2016 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

### 11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

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

浦银安盛基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日