浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年八月二十五日

1 重要提示

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。本基金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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 23 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 2011 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	浦银安盛沪深 300 指数增强
基金主代码	519116
交易代码	519116
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2010年 12 月 10 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	251,080,539.34 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，主要通过数量化模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金以沪深 300 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+1% （1%指年收益率，评价时按期间累计天数折算）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	尹东
	联系电话	021-23212812	010-67595003
	电子邮箱	guj@py-axa.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	010-67595096
传真		021-23212985	010-66275853

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	13,970,577.62
本期利润	12,640,193.71
加权平均基金份额本期利润	0.0327
本期基金份额净值增长率	-1.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0219
期末基金资产净值	245,582,129.38
期末基金份额净值	0.978

注：1、本基金合同生效日为 2010 年 12 月 10 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

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

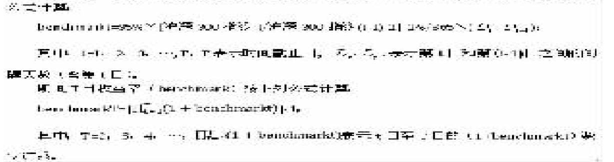
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

4、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.88%	1.07%	1.44%	1.13%	0.44%	-0.06%
过去三个月	-5.32%	1.01%	-5.04%	1.04%	-0.28%	-0.03%
过去六个月	-1.81%	1.08%	-2.03%	1.17%	0.22%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-2.20%	1.02%	-1.82%	1.20%	-0.38%	-0.18%

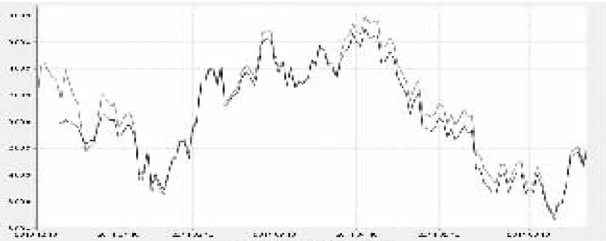


3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

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

（2010 年 12 月 10 日至 2011 年 6 月 30 日）



注：1、本基金合同生效日为 2010 年 12 月 10 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六条规定：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。本基金建仓期自 2010 年 12 月 10 日至 2011 年 6 月 10 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A.及上海盛融投资有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 2 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 2011 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 6 只开放式基金，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和浦银安盛货币市场证券投资基金。

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		
陈士俊	本基金基金经理	2010-12-10	-	10	陈士俊，清华大学博士学历。2001 年至 2003 年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员 2 年；2003 年至 2007 年 10 月在银河基金管理有限公司工作 4 年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007 年 10 月至今，任本公司金融工程部总监，并于 2010 年 12 月起担任本基金基金经理。

注：1、陈士俊作为本基金的首任基金经理，其任职日期为本基金成立之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，并在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度；在交易执行环节上，详细规定了面对多个基金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（1 日，5 日，10 日）发生的不同基金对同一股票的同向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差是否对相关基金的业绩差异有贡献；另一方面是公司对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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下尚无与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本投资组合未发生违反法律法规所界定的异常交易行为。

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

2011 年上半年，国内 A 股市场呈现冲高回落的震荡态势，小盘股的调整幅度较大，沪深 300 指数下跌了 2.69%。通胀的阴影始终笼罩着资本市场，与此伴随的是紧缩的货币政策和流动性的冲击，而内需的增长也出现放缓的趋势，市场对未来政策判断在抑通胀还是保增长的预期之间左右摇摆。欧洲债务危机不时传出负面消息，给全球经济复苏带来隐忧。

本基金的合同生效日是 2010 年 12 月 10 日，于 12 月 21 日开放日常申购赎回业务，此后受到了大额的申购赎回冲击，增加了交易成本，对组合调整带来一定干扰。本基金上半年投资策略是贴近基准，控制偏离度。这一策略有效规避了市场风格转变的超跌风险，量化增强策略也取得了预期的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.978 元。本报告期内基金净值增长率为-1.81%，同期业绩比较基准增长率为-2.03%。

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，经济软着陆的概率增大，通胀将出现缓慢回落，流动性将从上半年偏紧的状态逐步得以好转，但经济上升的动力仍然缓慢且曲折。我们认为下半年基金投资策略的方向应是把握好长期的趋势，忽略短期波动的干扰，应用量化分析手段，重点选择业绩确定性高和成长性高的公司来提升增强效果，为投资者带来更好的投资回报。

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副总经理兼首席运营官、风险管理部负责人、金融工程部负责人、研究部负责人、基金会计部负责人组成。估值委员会成员五分之三以上具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》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，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于每次收益分配基准日可供分配利润的 10%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金自 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日期间未进行收益分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	14,789,008.75	242,949,886.94
结算备付金		471,364.63	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	226,514,507.67	367,050,837.60
其中：股票投资		226,514,507.67	367,050,837.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	294,600,611.90
应收证券清算款		4,177,807.04	-
应收利息	6.4.7.5	3,248.87	103,567.44
应收股利		377,791.15	-
应收申购款		24,821.29	33,794.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		246,358,549.40	904,738,698.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	170,792,212.61
应付赎回款		108,668.98	14,746,645.29
应付管理人报酬		196,346.81	452,248.71
应付托管费		29,452.01	67,837.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	168,389.58	312,035.41
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	273,562.64	105,449.66
负债合计		776,420.02	186,476,428.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	251,080,539.34	721,338,207.57
未分配利润	6.4.7.10	-5,498,409.96	-3,075,937.74
所有者权益合计		245,582,129.38	718,262,269.83
负债和所有者权益总计		246,358,549.40	904,738,698.81

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.978 元，基金份额总额 251,080,539.34 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		16,734,795.43	-
1.利息收入		392,127.91	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	222,714.32	-
债券利息收入		152.90	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		169,260.69	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		17,007,589.39	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,348,769.10	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	76,844.70	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,581,975.59	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-1,330,383.91	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	665,462.04	-
减：二、费用		4,094,601.72	-
1.管理人报酬		1,976,859.12	-
2.托管费		296,528.91	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	1,487,689.61	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	333,524.08	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12,640,193.71	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12,640,193.71	-

注：本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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)	721,338,207.57	-3,075,937.74	718,262,269.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,640,193.71	12,640,193.71
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)	-470,257,668.23	-15,062,665.93	-485,320,334.16
其中：1.基金申购款	42,148,260.60	716,233.67	42,864,494.27
2.基金赎回款	-512,405,928.83	-15,778,899.60	-528,184,828.43
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)	251,080,539.34	-5,498,409.96	245,582,129.38
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注：本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：钱华，主管会计工作负责人：陈篪，会计机构负责人：赵迎华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金（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［2010］961 号文批准，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》及其配套法规和《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》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 814,650,876.35 元，已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（2010）第 393 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 815,083,164.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 432,288.04 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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。本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）。

本财务报表由本基金的基金管理人于 2011 年 8 月 25 日批准报出。

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”）、中国证监会公告［2010］5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 1 月 1 日至 2011 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

（1）计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

（2）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：

（a）对于特殊事项停牌股票，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》，本基金采用《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》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

（b）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字［2007］21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

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［2004］78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税［2005］102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税［2005］107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税［2008］1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

（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 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
中国建设银行股份有限公司(中国建设银行)	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

本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,976,859.12	-
其中：支付销售机构的客户维护费	689,171.37	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

2、支付基金管理人浦银安盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1%÷当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	296,528.91	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

2、支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管人报酬 =前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

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

本基金在本报告期未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 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

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未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

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未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期。

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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
中国建设银行	14,789,008.75	185,734.81	-	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

2、本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 2010 年 12 月 10 日，无上年度可比期间。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2011 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

无。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600216	浙江医药	2011-06-27	披露重大事项	31.39	2011-07-04	32.60	23,055	744,822.21	723,696.45	-
601998	中信银行	2011-06-29	配股	4.75	2011-07-07	4.59	177,000	948,440.00	840,750.00	-

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

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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

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	226,514,507.67	91.95
	其中：股票	226,514,507.67	91.95
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	15,260,373.38	6.19
6	其他各项资产	4,583,668.35	1.86
7	合计	246,358,549.40	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合 7.2.1 指数投资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	-	-
B	采掘业	27,915,394.54	11.37
C	制造业	73,195,157.74	29.80
C0	食品、饮料	11,821,691.40	4.81
C1	纺织、服装、皮毛	1,710,757.23	0.70
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,504,964.53	1.83
C5	电子	2,685,778.75	1.09
C6	金属、非金属	16,543,613.23	6.74
C7	机械、设备、仪表	27,578,572.90	11.23
C8	医药、生物制品	8,349,779.70	3.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,867,335.17	2.80
E	建筑业	6,857,125.76	2.79
F	交通运输、仓储业	12,271,855.63	5.00
G	信息技术业	5,972,960.86	2.43
H	批发和零售贸易	5,921,797.65	2.41
I	金融、保险业	65,514,107.80	26.68
J	房地产业	9,181,069.09	3.74
K	社会服务业	1,719,026.58	0.70
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,781,374.00	0.73
	合计	217,197,204.82	88.44

7.2.2 积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	7,329,272.85	2.98
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	1,227,107.00	0.50
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	1,977,738.25	0.81
C6	金属、非金属	1,435,450.00	0.58
C7	机械、设备、仪表	1,185,289.60	0.48
C8	医药、生物制品	1,503,688.00	0.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	843,090.00	0.34
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,144,940.00	0.47
	合计	9,317,302.85	3.79

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

7.3.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	729,646	9,499,990.92	3.87
2	600016	民生银行	1,448,076	8,297,475.48	3.38
3	601318	中国平安	135,132	6,522,821.64	2.66
4	601398	工商银行	1,432,850	6,390,511.00	2.60
5	601328	交通银行	894,518	4,955,629.72	2.02
6	601166	兴业银行	348,961	4,703,994.28	1.92
7	601088	中国神华	154,511	4,656,961.54	1.90
8	600030	中信证券	324,034	4,238,364.72	1.73
9	000002	万 科 A	406,453	3,434,527.85	1.40
10	601601	中国太保	142,319	3,186,522.41	1.30

注：1、股票 600348 国阳新能于 2011 年 7 月 12 日起，证券简称变更为“阳泉煤业”，证券代码不变。

2、投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站（www.py-axa.com）的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	600252	中恒集团	80,800	1,503,688.00	0.61
2	600176	中国玻纤	47,500	1,435,450.00	0.58
3	600439	瑞贝卡	110,950	1,227,107.00	0.50
4	002223	鱼跃医疗	48,320	1,185,289.60	0.48
5	002344	海宁皮城	52,400	1,144,940.00	0.47

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站（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	601318	中国平安	10,854,685.06	1.51
2	600036	招商银行	10,233,209.42	1.42
3	600016	民生银行	9,984,746.24	1.39
4	601328	交通银行	6,221,809.86	0.87
5	601398	工商银行	5,941,347.00	0.83
6	601166	兴业银行	5,376,782.70	0.75
7	601088	中国神华	5,016,816.54	0.70
8	600030	中信证券	4,554,745.64	0.63
9	000002	万 科 A	4,399,895.01	0.61
10	600519	贵州茅台	4,150,103.34	0.58
11	000858	五 粮 液	4,078,122.00	0.57
12	000869	张 裕 A	3,806,414.13	0.53
13	601601	中国太保	3,199,908.40	0.45
14	600900	长江电力	2,938,177.00	0.41
15	600795	国电电力	2,673,150.00	0.37
16	601006	大秦铁路	2,583,171.14	0.36
17	002024	苏宁电器	2,569,176.00	0.36
18	600005	武钢股份	2,567,511.00	0.36
19	600111	包钢稀土	2,552,652.08	0.36
20	600256	广汇股份	2,488,334.34	0.35

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	600036	招商银行	16,561,016.50	2.31
2	601318	中国平安	16,193,947.38	2.25
3	600016	民生银行	14,584,219.13	2.03
4	601328	交通银行	9,802,569.48	1.36
5	601166	兴业银行	8,491,161.26	1.18
6	601088	中国神华	8,089,871.60	1.13
7	600030	中信证券	7,750,341.92	1.08
8	600519	贵州茅台	7,343,278.13	1.02
9	000858	五 粮 液	7,324,299.62	1.02
10	601398	工商银行	7,197,042.59	1.00
11	000002	万 科 A	7,095,334.18	0.99
12	600111	包钢稀土	5,013,472.96	0.70
13	600104	上海汽车	4,355,457.56	0.61
14	601601	中国太保	4,201,260.61	0.58
15	600031	三一重工	4,116,350.09	0.57
16	600547	山东黄金	3,937,810.99	0.55
17	000869	张 裕 A	3,924,232.00	0.55
18	002024	苏宁电器	3,596,115.28	0.50
19	000063	中兴通讯	3,531,615.66	0.49
20	000338	潍柴动力	3,501,964.55	0.49

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

买入股票的成本(成交)总额	383,751,251.10
卖出股票的收入(成交)总额	537,305,966.22

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

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名的前五名债券投资明细

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名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 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。

7.9 投资组合报告附注

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

7.9.2 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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	4,177,807.04
3	应收股利	377,791.15
4	应收利息	3,248.87
5	应收申购款	24,821.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,583,668.35

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截止报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止报告期末本基金指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截止报告期末本基金积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

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
4,496	55,845.32	21,973,484.53	8.75%	229,107,054.81	91.25%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	2,586,027.71	1.03%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010 年 12 月 10 日)基金份额总额	815,083,164.39
本报告期期初基金份额总额	721,338,207.57
本报告期基金总申购份额	42,148,260.60
减：本报告期基金总赎回份额	512,405,928.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	251,080,539.34

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于 2011 年 3 月 26 日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》，公告披露经公司 2011 年第一次股东会会议审议通过，选举产生公司第二届董事会成员，共 9 名董事：姜明生先生（董事长）、Bruno Guilloton 先生（副董事长）、章曦先生、James Young 先生、刘以研先生、刘长江先生、王家祥女士（独立董事）、尹应能先生（独立董事）、吴伟聪先生（独立董事）。其中，王家祥女士、刘长江先生为新当选董事。原董事刘斐女士、原独立董事石良平先生不再连任。

2、本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

3、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可［2011］115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

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仍为普华永道中天会计师事务所，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	648,957,039.00	70.50%	551,612.09	71.38%	-
国泰君安	1	241,045,542.92	26.19%	195,851.95	25.34%	-
国金证券	1	17,044,463.64	1.85%	13,848.77	1.79%	-
申银万国	1	13,490,568.36	1.47%	11,466.90	1.48%	-
国都证券	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：

本基金于 2010 年 12 月 10 日成立。公司租用中金、国金证券、申银万国、国泰君安、国都证券的交易单元用于本基金交易，本报告期内没有发生变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	948,997.60	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	850,000,000.00	100.00%	-	-
国都证券						

浦银安盛基金管理有限公司
二〇一一年八月二十五日