浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015 年 03 月 26 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	219,073,490.30
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	田青
	联系电话	021-23212888	010-67595096
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tianqing1.zh@ccb.com
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

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	5,771,009.44	3,170,406.69	-35,924,807.69
本期利润	59,854,207.91	-12,550,211.12	15,116,277.73
加权平均基金份额本期利润	0.3282	-0.0594	0.0646
本期基金份额净值增长率	47.94%	-7.74%	8.68%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1567	-0.2490	-0.2082
期末基金资产净值	243,285,504.47	148,684,398.62	182,953,601.49
期末基金份额净值	1.111	0.751	0.814

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。

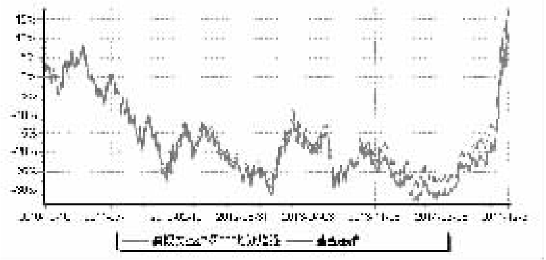
3.2 基金净值表现

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

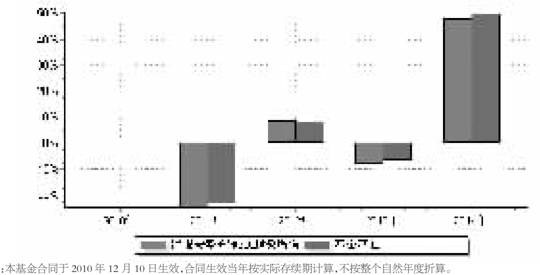
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	42.07%	1.55%	41.98%	1.56%	0.09%	-0.01%
过去六个月	58.94%	1.25%	60.15%	1.26%	-1.21%	-0.01%
过去一年	47.94%	1.15%	50.15%	1.15%	-2.21%	-
过去三年	48.33%	1.23%	52.53%	1.23%	-4.20%	-
自基金合同生效起至今	11.10%	1.21%	17.57%	1.24%	-6.47%	-0.03%

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
(2014 年 01 月 01 日 -2014 年 12 月 31 日)



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



注:本基金合同于 2010 年 12 月 10 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司(以下简称"浦银安盛")成立于 2007 年 8 月,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、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至 2014 年 12 月 31 日止,浦银安盛旗下共管理 17 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证券投资基金、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及浦银安盛月月盈安心养老定期支付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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈士俊	本公司金融工程部总监,公司职工监事,公司旗下浦银安盛沪深 300 指数基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理	2010年 12 月 10 日	-	13	陈士俊先生,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 月加入浦银安盛基金管理有限公司,任本公司金融工程部总监,并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 300 指数基金基金经理。2012 年 3 月兼任本公司职工监事。2012 年 5 月起,兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理。
罗雯	本公司旗下指数基金基金经理助理	2011年 07 月 01 日	-	7	罗雯女士,浙江大学理学院数学系金融数学硕士。2007 年 10 月至今,任浦银安盛基金管理有限公司金融工程师。2011 年 7 月起,兼任浦银安盛沪深 300 指数基金的基金经理助理,2012 年 5 月起兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理助理。

注:1、除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外,本表所述"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遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,以及公司的规章制度,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

管理人用于公平交易控制方法包括:

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对股票交易情况进行分析,对不同时间窗口(同日,3 日,5 日)发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析;另一方面是公司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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件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

2014 年中国经济平稳降速,全年 GDP 增速回落至 7.4%,内需改善不是很明显,CPI 保持在低位,PPI 更是连续负增长,经济紧缩的压力非常大.中国对外出口在下半年显著回升,成为一个亮点.央行保持着适度宽松的货币政策,全年信贷增速略有回落,但总量依然很大.在实体经济前景不明朗的情况下,市场活跃资金在最后一个季度涌入股市,推升股票市场大幅上涨,全年沪深 300 指数的涨幅达到 51.66%.从量化因子分析,价值因子是全年表现最好的因子,而质量因子表现不佳.本基金报告期内,本基金严格执行量化增强的投资策略,受累于质量因子负贡献,尽管本基金在三季度对组合的量化因子配置比例结构进行了调整,但全年基金净值表现还是小幅落后于业绩比较基准.

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金净值增长率为 47.94%,同期业绩比较基准增长率为 50.15%。

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 2015 年,中国经济增速缓慢下降的趋势依然存在,一些制度创新和改革更为迫切.与股票市场相关的股票发行上市的注册制改革,以及股票期权等金融衍生品在证券交易所的推出,将会给投资者带来更多的投资标的选择和投资机会.我们认为,当前中国股票市场估值处于合理水平,市场流动性较好.中国经济结构转型正在积极推进的过程之中,企业基本面状况将会不断改善.因此,我们对 2015 年的股票市场充满信心.

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规实信、勤勉尽责,依法履行基金管理人职责,强化风险及合规管理,确保基金管理业务运作的安全、规范,保护基金份额持有人的合法权益。2014 年,合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理,积极配合公司前台业务的完善一线风险管控工作,并协调、监督全公司和投资组合的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及内部控制工作。

1、进一步健全合规风控团队,提高团队的专业素养

2014 年,随着公司管理投资组合的数量与规模大幅提升、业务类型的不断拓展,合规风控团队也不断加强自身专业素质的提升,强化全面专业素质,鼓励和支持合规风控人员参与相关的专业考试和学习。目前合规风控团队内部形成了良好的学习和业务研讨的氛围,团队成员各自发挥自身优势,相互取长补短,专业素质得到均衡提升,在内部形成了互帮互学、共同提高、自然和谐的良好局面。

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

2、进一步建立健全风险控制体系

(1)对投资组合进行定期业绩归因分析和风险评估

合规风控部进一步完善了每日、每周、每月的风险评估。初步建立了较为完整、及时的量化的预警风险评估体系。

(2)推动兼职风控员方案实施

2014 年,积极推动试行了兼职风控员方案,在各业务部门中指定员工担任兼职风控员,在合规风控部的业务指导和部门负责人的行政领导下,开展和协助部分合规风控工作。一方面提高业务部门自身的自我合规风控能力,一方面提高部门内与合规风控相关常规事项的咨询和决策效率,从而提升公司整体风险控制水平和风险政策贯彻力度。

(3)对公司新产品提供高效、有力的支持

2014 年,公司新发行了 7 只专户产品,4 只公募基金。合规风控部与投资团队、产品团队、运营团队合作,就各产品的流动性风险、市场风险、信用风险等方面进行分析,制定相应的风险控制措施和投资控制指标。

(4)进一步完善子公司内部控制体系

2014 年年底,初步建立了子公司多层次的内部控制体系:

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

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

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

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

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

2014 年,子公司建立了较为完整的通道类业务的内控制度体系和法律合规框架,使通道业务在规范中进行发展。

(5)协助人力资源部完善了合规风控考核体系

2014 年,公司加大了对各部门、各岗位的风险事件考核力度,依照重大、高、中、低四个不同等级风险事件,同时结合是否自动及时上报、是否受外界因素影响等因素进行考核,初步做到责任明确、落实到人。

3、稽核工作

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

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

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

2014 年实施的专项稽核包括:

(1)完成对上年度反洗钱工作的内部稽核和反洗钱自评估工作;

(2)根据监管部门统一部署,对公司各方面进行了全面自查工作;

(3)根据监管部门要求,对公司非法集资风险进行了排查;

(4)根据监管部门的监管通报内容,对照公司实际业务开展情况进行了自查;

(5)根据监管部门要求,对从业人员违规买卖股票行为进行了自查。

总体来说,2014 年度由于人员配备的原因,稽核工作的深度及广度还有待进一步提高。本报告期内,相关人员已招聘到位,未来将着重加强各部门制度执行及操作风险的稽核工作,不断深化和提高稽核工作的开展情况。

4、实施合规性审核

依据法律法规和公司制度对以下材料进行了审核:

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

(2)2014 年,与公司专业法律顾问一起,对公司发行的基金和专户产品法律文件的合法合规性进行了全面审核;

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

5、信息披露和文件报送

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

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

2014 年,按时按质完成基金定期报告(月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告)和招募说明书更新的提示及合规审核工作,并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制,及时进行合规审核,并安排公告的披露及上报事宜。2014 年全年共审核并安排披露、上报数百份公告及报告,未出现重大迟、漏等现象。

6、法律事务

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

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

7、组织开展合规培训

根据工作安排,合规风控团队负责公司的合规培训工作,合规培训包括新员工人司培训、重大新法规培训、从业人员投资限制培训、新股发行体制改革培训、退市机制改革培训等。培训前,合规风控团队会商量每次培训的议题和内容,并准备书面培训材料;培训中,采取讲实例的互动培训方式;培训后,积极听取员工的建议,以期不断改进培训效果。

(1)对于 2014 年新入司员工分两场进行了人职合规培训,内容包括公司制度流程体系、主要业务法律法规、公司利益冲突管理要求等。对于外地同事,则采取先发送书面培训材料,待其来司时再进行面对面培训的方式;

(2)由于中国证券业协会每年安排 15 小时左右的远程在线合规培训。为避免占用业务人员过多工作时间以及培训内容过多重复,2014 全年为业务人员提供了共 7 场(不含反洗钱合规培训)的专项合规培训;

(3)对反洗钱领导小组及反洗钱骨干人员开展了 2 场反洗钱合规培训,共计 4 小时 15 人次。

合规培训部分提高和增强了员工的合规守法意识,促进了公司业务的合规运作。

8、督导和推动公司的制度建设和完善

与草拟了部分制度,审阅并修订了所有已经颁布的公司基本管理制度和督导和推动公司的制度建设和完善是合规风控团队的重要工作之一。合规风控团队全年推动公司所有新订、修订制度、流程的工作。

9、组织进行反洗钱工作

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

10、落实监管政策和要求,配合和协助监管机关的现场调研

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

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

(2)组织、协调和督导公司的专项自查;

(3)代表公司参与上海基金业同业公会的相关会议。

根据监管机关的要求,公司发生任何问题,都需要及时向监管机关报告,因此,在报告方面,还需加强和提升,增强与监管机关的沟通。

11、督导处理投资人的投诉

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

12、向董事会报告公司经营的合法合规情况

根据《公司章程》的要求,定期向董事会报告公司经营的合法合规情况。报告的形式包括:(1)书面报告:通过季度和年度监察稽核报告的形式;(2)当面报告:通过在董事会会议以及合规与审计委员会会议汇报的形式;(3)电邮或电话:当董事想了解公司的合规经营情况或提出一些问题时,通过电子邮件或电话的形式进行沟通和汇报。

13、与中介机构的协调

合规风控团队负责与律师事务所和审计师事务所的日常工作协调,包括:

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

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

回顾过去的 2014 年,从董事会、管理层到员工,对合规风控工作都比以前有了更多的重视和理解、支持,合规风控团队与公司各部门的联系日益紧密和协调,这为公司合规风控工作的开展进一步奠定了良好基石。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历,具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配 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。

4.9 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,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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的资产负债表,2014 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见(普华永道中天审字(2015)第 20452 号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	45,900,948.56	9,319,624.61
结算备付金		112,399.14	290,118.97
存出保证金		41,118.63	10,803.24
交易性金融资产	7.4.7.2	225,949,745.92	139,765,818.65
其中:股票投资		225,949,745.92	139,765,818.65
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,908.89	2,148.87
应收股利		-	-
应收申购款		4,619,147.10	3,952.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		276,627,268.24	149,392,466.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		28,653,187.12	-
应付赎回款		4,083,607.66	15,555.22
应付管理人报酬		146,140.73	127,366.76
应付托管费		21,921.09	19,105.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	128,122.08	169,078.57
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	308,785.09	376,962.71
负债合计		33,341,763.77	708,068.27
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	219,073,490.30	197,989,856.12
未分配利润	7.4.7.10	24,212,014.17	-49,305,457.50
所有者权益合计		243,285,504.47	148,684,398.62
负债和所有者权益总计		276,627,268.24	149,392,466.89

注:报告截止日 2014 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.111 元,基金份额总额 219,073,490.30 份。

7.2 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:2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		62,928,881.59	-8,893,722.53
1.利息收入		71,173.16	77,762.17
其中:存款利息收入	7.4.7.11	71,173.16	77,638.88
债券利息收入		-	123.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以"-"填列)		8,704,127.35	6,737,173.52
其中:股票投资收益	7.4.7.12	5,099,416.59	3,063,940.71
基金投资收益	7.4.7.13		
债券投资收益	7.4.7.14	-	26,751.71
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	3,604,710.76	3,646,481.10
3.公允价值变动收益 (损失以"-"号填列)	7.4.7.18	54,083,198.47	-15,720,617.81
4.汇兑收益 (损失以"-"号填列)			
5.其他收入 (损失以"-"号填列)	7.4.7.19	70,382.61	11,959.59
减:二、费用		3,074,673.68	3,656,488.59
1.管理人报酬		1,376,024.44	1,686,369.05
2.托管费		206,403.67	252,955.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	991,497.38	1,137,625.08
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.21	500,748.19	579,539.13
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)		59,854,207.91	-12,550,211.12
减:所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以"-"号填列)		59,854,207.91	-12,550,211.12

7.3 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:2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	197,989,856.12	-49,305,457.50	148,684,398.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	59,854,207.91	59,854,207.91
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)	21,083,634.18	13,663,263.76	34,746,897.94
其中:1.基金申购款	122,442,451.92	2,137,398.50	124,579,850.42
2.基金赎回款	-101,358,817.74	11,525,865.26	-89,832,952.48
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)	219,073,490.30	24,212,014.17	243,285,504.47
项 目	上年度可比期间 2013年 01 月 01 日-2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	224,797,747.64	-41,844,146.15	182,953,601.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,550,211.12	-12,550,211.12
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)	-26,807,891.52	5,088,899.77	-21,718,991.75
其中:1.基金申购款	18,628,153.82	-4,006,291.75	14,621,862.07
2.基金赎回款	-45,436,045.34	9,095,191.52	-36,340,853.82
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)	197,989,856.12	-49,305,457.50	148,684,398.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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》和《浦银安盛沪深 300 指数增强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 814,650,876.35 元,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。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)。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4 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估计与 2013 年度报告相一致;本报告期所采用的会计政策变更的说明在 7.4.5.1 会计政策变更的说明中披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《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》、《企业会计准则第 41 号 -- 在其他主体中权益的披露》和修订后的《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》、《企业会计准则第 33 号 -- 合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号 -- 金融工具列报》,要求除《企业会计准则第 37 号 -- 金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外,其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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》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。自 2013 年 1 月 1 日起,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,暂减按 25%计入应纳税所得额。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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司("上海浦东发展银行")	基金管理人的股东、基金代销机构
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
上海国盛集团资产有限公司	基金管理人的股东
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
上海盛融投资有限公司	基金管理人的原股东

注:1、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。
2、本报告期内,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。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 01 月 01 日-2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,376,024.44	1,686,369.05
其中:支付销售机构的客户维护费	500,090.85	621,271.06

注: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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 01 月 01 日-2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	206,403.67	252,955.33

注: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

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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与上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 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 2014年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 01 月 01 日-2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	45,900,948.56	66,984.60	9,319,624.61	72,412.75

注: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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间承销期内均未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600332	白云山	2014-12-03	重大事项停牌	27.11	2015-01-13	29.82	10,200	275,898.00	276,522.00
000413	东旭光电	2014-11-25	重大事项停牌	7.67	2015-01-28	8.44	50,000	421,955.00	383,500.00
000562	宏源证券	2014-12-10	重大事项停牌	30.50	2015-01-26	17.77	24,900	296,076.83	759,450.00
000883	湖北能源	2014-11-18	重大事项停牌	6.43		-	37,200	215,760.00	239,196.00
601216	内蒙君正	2014-12-01	重大事项停牌	10.44	2015-01-07	11.10	44,400	363,819.00	463,536.00
000009	中国宝安	2014-12-29	重大事项停牌	12.95	2015-01-07	13.88	26,200	343,613.56	339,290.00

注:1、本基金截至 2014 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。
2、上表中股票"宏源证券"(代码:000562)被"申万宏源"(代码:000166)合并,上表中复牌日期和价格为"申万宏源"的相应复牌日期和价格。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2014 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2014 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 223,488,251.92 元,属于第二层次的余额为 2,461,494.00 元,无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日:第一层次 137,338,709.81 元,第二层次 2,427,108.84 元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	225,949,745.92	81.68
	其中:股票	225,949,745.92	81.68
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	46,013,347.70	16.63
7	其他各项资产	4,664,174.62	1.69
8	合计	276,627,268.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末(指数投资)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	采矿业	9,222,948.25	3.79
C	制造业	78,202,481.71	32.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,846,627.27	3.23
E	建筑业	9,646,759.32	3.97
F	批发和零售业	4,027,299.00	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	4,740,211.40	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,404,316.51	2.63
J	金融业	87,776,772.85	36.08
K	房地产业	9,622,018.12	3.96
L	租赁和商务服务业	2,731,353.64	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,940,153.00	1.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	653,017.65	0.27
R	文化、体育和娱乐业	1,695,532.20	0.70
S	综合	339,290.00	0.14
	合计	225,848,780.92	92.83

8.2.2 报告期末(积极投资)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	采矿业	-	-
C	制造业	28,930.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	66,040.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,995.00	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	100,965.00	0.04

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	778,258	8,467,447.04	3.48
2	600036	招商银行	501,923	8,326,902.57	3.42
3	601318	中国平安	102,624	7,667,039.04	3.15
4	600030	中信证券	191,124	6,479,103.60	2.66
5	601166	兴业银行	369,290	6,093,285.00	2.50
6	600837	海通证券	203,074	4,885,960.44	2.01
7	601398	工商银行	936,219	4,559,386.53	1.87
8	000002	万 科 A	254,911	3,543,262.90	1.46
9	601668	中国建筑	410,712	2,989,983.36	1.23
10	601328	交通银行	430,714	2,928,855.20	1.20

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 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	002736	国信证券	6,500	66,040.00	0.03
2	002737	葵花药业	500	28,930.00	0.01
3	002738	中矿资源	500	5,995.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	601398	工商银行	4,521,105.00	3.04
2	601318	中国平安	4,384,748.76	2.95
3	600036	招商银行	4,022,601.00	2.71
4	600030	中信证券	3,654,507.00	2.46
5	600016	民生银行	3,515,471.80	2.36
6	600518	康美药业	3,193,979.62	2.15
7	601288	农业银行	3,183,299.00	2.14
8	000333	美的集团	3,128,287.88	2.10
9	000100	TCL 集团	3,128,088.00	2.10
10	002415	海康威视	3,120,927.18	2.10
11	601328	交通银行	2,846,479.06	1.91
12	600887	伊利股份	2,783,852.01	1.87
13	601633	长城汽车	2,765,763.76	1.86
14	002146	荣盛发展	2,710,690.63	1.82
15	600015	华夏银行	2,600,893.22	1.75
16	000625	长安汽车	2,502,377.08	1.68
17	002241	歌尔声学	2,499,513.00	1.68
18	600999	招商证券	2,483,364.44	1.67
19	000002	万 科 A	2,472,178.62	1.66
20	002450	康得新	2,466,746.97	1.66

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。

8.4.2 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	601288	农业银行	5,222,764.90	3.51
2	600036	招商银行	4,658,452.13	3.13
3	601318	中国平安	3,933,887.91	2.65
4	600030	中信证券	3,680,290.75	2.48
5	000100	TCL 集团	3,632,954.92	2.44
6	601988	中国银行	3,605,882.26	2.43
7	601633	长城汽车	3,441,252.89	2.31
8	601998	中信银行	3,235,954.00	2.18
9	000002	万 科 A	2,840,614.00	1.91
10	600027	华电国际	2,823,088.45	1.90
11	600837	海通证券	2,784,385.27	1.87
12	000001	平安银行	2,685,674.21	1.81
13	601336	新华保险	2,626,381.01	1.77
14	002146	荣盛发展	2,612,304.44	1.76
15	601398	工商银行	2,569,108.00	1.73
16	600999	招商证券	2,564,810.06	1.73
17	000402	金 融 街	2,553,183.66	1.72
18	002081	金 螳 螂	2,546,773.55	1.71
19	000895	双汇发展	2,538,711.58	1.71
20	600016	民生银行	2,475,290.63	1.66

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本 (成交)总额	341,430,077.10
卖出股票的收入 (成交)总额	314,428,764.89

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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。

8.12.3 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	41,118.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,908.89
5	应收申购款	4,619,147.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,664,174.62

8.12.4 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债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,297	66,446.31	53,857,584.32	24.58%	165,215,905.98	75.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	846,816.83	0.39%

9.3 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 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	197,989,856.12
本报告期基金总申购份额	122,442,451.92
减:本报告期基金总赎回份额	101,358,817.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	219,073,490.30

注:申购含转换入份额;赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经基金管理人 2014 年第二次股东会会议审议通过,选举产生第三届董事会成员,相较第二届董事会成员,新增霍佳震先生、董叶顺先生为基金管理人独立董事,新增汪素南先生为基金管理人董事,原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

2、经 2014 年度第三次股东会会议审议通过,章曦先生不再担任基金管理人董事职务,选举金杰先生接替章曦先生出任基金管理人第三届董事会董事。

3、报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金审计的会计师事务所为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。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 60,000 元,截止本报告期末,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已提供审计服务的连续年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内,管理人、托管人及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。报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查,并于报告期后提出相应整改意见及监管措施决定书。公司将以此次现场检查为契机,进一步提升公司整体内控水平,通过构建完善的风险管理和合规管理体系,推动公司向现代资产管理机构的转型。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	277,104,128.34	42.29%	-	-	-	-	-	-	252,276.32	42.29%	
中金	1	225,264,323.54	34.38%	-	-	-	-	-	-	205,081.47	34.38%	
申银万国	1	152,864,972.66	23.33%	-	-	-	-	-	-	139,167.84	23.33%	
东方证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
中国中投	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
国联证券	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:

本基金本报告期内停止租用中国中投证券交易单元。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2014 年 1 月 4 日发布《关于增加注册资本及修改公司章程的公告》,披露基金管理人注册资本增至 28,000 万元人民币并据此修改了公司章程。

浦银安盛基金管理有限公司
二〇一五年三月二十六日