浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

2015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：交通银行股份有限公司
送出日期：2016年3月30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材料不存在虚假记载、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月28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2015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	浦银安盛消费升级混合
基金主代码	519125
交易代码	519125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月4日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,573,806.82份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过在股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置，并通过重点关注受益于中国经济可持续增长、经济结构转型趋势和消费升级驱动的大消费行业及其相关行业的投资机会，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在股票投资方面主要采用主题投资策略，通过重点投资受益于中国经济可持续增长、经济结构转型趋势和消费升级驱动的大消费行业及其相关行业，结合对大消费行业及其相关行业的发展趋势的研究分析、上市公司发展战略、商业模式、技术、工艺的分析，对属于消费升级投资主题范畴的上市公司进行重点投资。
业绩比较基准	55%×中证内地消费主题指数+45%×中证全债指数
风险收益特征	本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

注：自2015年10月1日起，本基金业绩比较基准由原"中信标普全债指数"变更为"中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于2015年11月13日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	汤嵩彦
	联系电话	021-23212888	95559
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金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

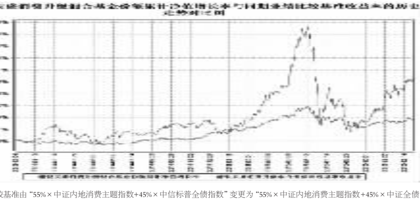
3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年12月4日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	-8,958,295.19	60,872,442.40	-3,005,933.34
本期利润	7,808,495.78	59,544,983.37	-1,052,851.51
加权平均基金份额本期利润	0.1386	0.5476	-0.0019
本期基金份额净值增长率	68.98%	12.73%	-0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.6054	0.1251	-0.0055
期末基金资产净值	139,832,833.20	43,067,467.93	547,231,336.64
期末基金份额净值	1.901	1.125	0.998

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	50.51%	2.77%	9.54%	0.89%	40.97%	1.88%
过去六个月	-0.89%	3.62%	-5.05%	1.46%	4.16%	2.16%
过去一年	68.98%	3.19%	17.26%	1.36%	51.72%	1.83%
自基金合同生效起至今	90.10%	2.51%	32.55%	1.05%	57.55%	1.46%

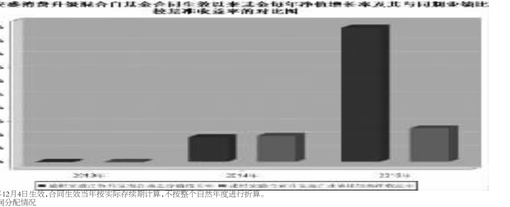
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：

1.自2015年10月1日起，本基金比较基准由"55%×中证内地消费主题指数+45%×中信标普全债指数"变更为"55%×中证内地消费主题指数+45%×中证全债指数"。具体内容详见基金管理人于2015年11月13日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

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2013年12月4日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§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2015年12月31日止，浦银安盛旗下共管理19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及浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，成立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		
吴勇	本公司权益投资部总监，公司旗下浦银安盛红利精选混合基金、浦银安盛精致生活混合基金、浦银安盛新兴产业混合基金、浦银安盛消费升级混合基金基金经理	2013年12月4日	–	8	吴勇先生，上海交通大学材料工程系学士，上海交通大学工商管理硕士，CPA，CFA，中国注册造价师。1993年8月至2007年8月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、国家开发银行上海市分行任评审经理。2007年9月起加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理。2010年4月起担任浦银安盛红利精选混合基金基金经理。2011年5月起兼任浦银安盛精致生活混合基金基金经理。2013年3月起，兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理。2013年12月起兼任浦银安盛消费升级混合基金基金经理。2012年11月起兼任本公司权益投资部总监。
李芳	公司旗下权益类基金经理助理	2015年12月1日	–	4.5	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。
陈蔚丰	原权益类基金经理助理	2014年7月21日	2015年5月24日	7	陈蔚丰女士，南京大学环境科学硕士。2008年2月至2010年11月在江苏瑞华投资发展有限公司担任行业研究员。2010年11月加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、高级研究员、基金经理助理。2015年5月，担任浦银安盛医疗健康混合基金基金经理。

注：1、吴勇作为本基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金的成立日期。

2、其余人员的任职日期和离职日期为公司决定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2015年A股市场总体呈现大幅震荡，上半年市场呈现单边上涨态势，主要原因在于：央行多次降息降准，银行间回购利率保持在低位；券商融资等杠杆工具的余额不断攀升，新进投资者不断增加带来增量资金。6月份开始，监管机构开始清理场外配置，导致恐慌性杀跌出现，市场出现大幅下跌，直到四季度才出现了一波估值修复行情。

从宏观经济角度来看，我们认为投资导向的行业依然处于疲软状态，难以有趋势性的恢复。而消费、科技创新等导向的行业依然是中国经济结构转型受益的标的。因此，本基金保持了信息服务、通信、军工等行业的超配，对传统周期性行业保持低配的状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为68.98%，基准收益率为17.26%。

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2016年，资本市场面临的不确定性在增加，人民币汇率波动、注册制的推行都需要我们仔细评估其对资本市场的影响。但总体来看，中国的宏观经济应能保持一定的稳定性，符合中国经济转型的方向的行业如传媒、信息技术、军工等行业依然具有较好的成长空间。在具有较好成长性的行业中精选个股，考虑估值和成长性的匹配可能具有更加现实的意义。

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》等有关法规诚实守信，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。2015年，合规风控工作仍然是对公司进行全面风险管理，涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、风险监控、绩效评估、内部稽核及反洗钱等工作。积极配合公司前台业务的完善一线风险控制工作，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。合规法律方面，在公司全体同仁的共同努力下，公司合规及信披记录良好，为公司各项业务的开展打下了坚实基础；风险管理方面，进一步开发并优化量化风险评估模型，利用数字化、专业化管理提升风险评估、监测及预警效能，并提升风险化解及处置能力；稽核方面，根据监管要求及行业热议风险点，有针对性的开展了计划外专项稽核，及时查找和发现的潜在风险，提出了完善制度流程及加强执行的有效建议。

1、进一步健全合规风控团队，提高团队的专业素养

2015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，合规风控团队也补充了较有经验的投资风险管理人才，进一步强化了团队人员配置，并不断加强自身专业素质的提升，全面提高专业素质，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、互相协同、勤奋上进的良好局面。

内部管理上，合规风控团队进一步健全合规风控团队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。

对外沟通上，持续与监管机构、交易所、自律协会、外部律师、外部会计师及双方股东对口部门保持密切良好的沟通，同时与公司其他部门保持良好协作，配合和支持部门间需求接洽。

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。同时，2015年对流动性风险监控体系进行了进一步完善，通过日常流动性监测及定期、不定期的压力测试，对流动性风险进行有效的防范。

（2）对投资组合的公平交易及异常交易进行事前控制和事后分析

合规风控部继续着力于对公平交易、异常交易相关工作的提高，对公平交易及异常交易事后分析进行了进一步的完善，以进一步确保投资组合的合法合规。

（3）对公司新产品提供高效、有力的支持

2015年，公司新发行了6只专户产品（2只为委托公司管理），2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

2015年，子公司内部控制体系得到进一步完善：

业务部门的一线风险控制。子公司设金融机构部、运营管理部、投资管理部、资金管理部、财富管理中心等业务部门，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。子公司在总经理领导下设立执行委员会，并在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。2015年，母公司对子公司的内控管理正在从事前评审和事中审核，逐步转向事前咨询及讨论以及事后稽核，力争在保持子公司独立性、实现母子公司风险隔离的基础上，有效发挥母公司对子公司风险内控方面的监督管理作用。

（5）协助人力资源部完善了合规风控考核体系

2015年，公司进一步加大对各部门、各岗位的风险事件考核力度，制定下发了《加强日常风险考核管理办法》，依照不同等级风险事件，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，责任明确、落实到人，并根据中风险及以上事件对责任人员采取扣除部分季度工资的惩处，有力地督促了相关人员对公司制度的执行，有效地推动了公司全体员工合规意识的提高。

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。

2015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，对公司进行"两加强、两遏制"全面专项自查；

（3）根据监管部门要求，对公司特定客户资产管理业务专用账户使用情况、是否涉及配资等进行了自查；

（4）对公司投资指令、投资建议书进行了检查；

（5）对公司信息技术管理进行了检查。

总体来说，2015年度由于人员配置有限，稽核工作的深度及广度还有待进一步提高。2016年，合规风控部将在公司预算内进一步完善人员配置，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）2015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，督察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。

2015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。2015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入司培训、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）由于中国证券业协会每年会安排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，2015全年为业务人员提供了共5场（不含反洗钱合规培训）的专项合规培训；

（2）对反洗钱相关人员开展了一场反洗钱合规培训，共计2.5个小时14人次。

合规培训部分程度上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

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）客户识别和客户风险等级划分；（3）利用反洗钱监控系统从TA数据中心自动抓取数据，对可疑交易进行适时监控；（4）向中国人民银行定期报送可疑交易；（5）定期根据监管要求向贵局及人民银行报送报告报表等各项材料；（6）进行反洗钱合规培训；（7）进行反洗钱的专项审计及自评估。

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。

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2015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。

本基金管理人已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》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

据本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

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

2015年度，基金托管人在浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015年度，浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2015年度，由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第20827号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"浦银安盛消费升级基金")的财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是浦银安盛消费升级基金 的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述浦银安盛消费升级基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了浦银安盛消费升级基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	胡逸嵘
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	
审计报告日期	2016年3月25日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款		7,388,340.22	3,668,155.64
结算备付金		1,028,603.03	656,594.61
存出保证金		191,152.83	121,350.29
交易性金融资产		133,100,556.41	34,862,702.97
其中：股票投资		133,100,556.41	34,862,702.97
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		–	–
买入返售金融资产		–	–
应收证券清算款		110,016.33	–
应收利息		2,221.07	980.21
应收股利		–	–
应收申购款		103,567.97	6,380,837.19
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		141,924,457.86	45,690,620.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		565,213.12	1,124,789.18
应付赎回款		712,099.49	176,349.69
应付管理人报酬		163,686.61	58,197.19
应付托管费		27,281.08	9,699.55
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		462,430.42	887,861.30
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		160,913.94	366,256.07
负债合计		2,091,624.66	2,623,152.98
所有者权益：			
实收基金		73,573,806.82	38,280,035.17
未分配利润		66,259,026.38	4,787,432.76
所有者权益合计		139,832,833.20	43,067,467.93
负债和所有者权益总计		141,924,457.86	45,690,620.91

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.901元，基金份额总额73,573,806.82份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		13,068,130.44	66,272,309.31
1.利息收入		75,601.04	443,692.56
其中：存款利息收入		75,601.04	267,127.85
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		–	176,564.71
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-5,363,086.46	64,261,448.08
其中：股票投资收益		-5,486,637.10	63,843,510.10
基金投资收益		–	–
债券投资收益		–	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		123,550.64	417,937.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		16,766,790.97	-1,327,459.03
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,588,824.89	2,894,627.70
减：二、费用		5,259,634.66	6,727,325.94
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	1,404,076.44	1,822,349.90
2.托管费	7.4.8.2.2	234,012.72	303,724.98
3.销售服务费	7.4.8.2.3	–	–
4.交易费用		3,445,945.15	4,220,685.50
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用		175,600.35	380,565.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		7,808,495.78	59,544,983.37
减：所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		7,808,495.78	59,544,983.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	38,280,035.17	4,787,432.76	43,067,467.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	7,808,495.78	7,808,495.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	35,293,771.65	53,663,097.84	88,956,869.49
其中：1.基金申购款	194,480,198.83	175,496,489.22	369,976,688.05
2.基金赎回款	-159,186,427.18	-121,833,391.38	-281,019,818.56
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)	73,573,806.82	66,259,026.38	139,832,833.20
项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	548,284,188.15	-1,052,851.51	547,231,336.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	59,544,983.37	59,544,983.37
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)	-510,004,152.98	-53,704,699.10	-563,708,852.08
其中：1.基金申购款	157,228,161.47	24,209,021.05	181,437,182.52
2.基金赎回款	-667,232,314.45	-77,913,720.15	-745,146,034.60
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)	38,280,035.17	4,787,432.76	43,067,467.93

报表附注为财务报表的组成部分。

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

浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金(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[2013]1281号《关于核准浦银安盛消费升级灵活配置混合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《浦银安盛消费升级灵活配置混合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547,909,664.13元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第788号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2013年12月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为548,284,188.15份基金份额，其中认购资金利息折合374,524.02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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛消费升级灵活配置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，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的比例占基金资产的0%—95%，其中投资于消费行业及其相关行业股票比例不低于非现金基金资产的80%，权证资产的投资比例占基金资产净值的0%—3%，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%。自基金合同生效日至2015年9月30日，本基金的业绩比较基准为：55%×中证内地消费主题指数+45%×中信标普全债指数。根据本基金的基金管理人于2015 年11 月13 日发布的《关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》，自2015年10月1日起，本基金业绩比较基准变更为：55%×中证内地消费主题指数+45%×中证全债指数。

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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协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2015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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构
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
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产有限公司	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

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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.7.1.2 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期及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。

7.4.7.1.4 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,404,076.44	1,822,349.90
其中：支付销售机构的客户维护费	550,083.05	774,409.80

注：1，在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%/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

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	234,012.72	303,724.98

注：1，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×0.25%/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

7.4.7.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
交通银行股份有限公司	7,388,340.22	55,120.54	3,668,155.64	102,417.42

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日				
关联方名称				
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日				
	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

注：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。

7.4.7.7 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。

7.4.8 期末（ 2015年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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
300025	华星创业	2015年11月26日	临时停牌	28.28	–	–	109,957	2,726,891.29	3,109,583.96	–
300366	创意信息	2015年12月29日	临时停牌	77.70	–	–	34,400	1,726,793.47	2,672,880.00	–
002502	骅威股份	2015年8月20日	临时停牌	32.02	2016年1月14日	23.35	72,600	1,885,601.59	2,324,652.00	–
300081	恒信移动	2015年11月26日	临时停牌	47.84	–	–	38,000	1,790,353.00	1,817,920.00	–
300038	梅泰诺	2015年12月16日	临时停牌	56.68	–	–	22,800	1,172,062.00	1,292,304.00	–
000034	深信泰丰	2015年12月24日	临时停牌	27.95	–	–	30,000	637,556.00	838,500.00	–
600682	南京新百	2015年7月1日	临时停牌	32.98	2016年1月27日	33.78	10,000	351,328.96	329,800.00	–
300162	雷曼股份	2015年11月2日	临时停牌	27.06	2016年2月29日	21.47	10,000	246,500.00	270,600.00	–

注：本基金截至2015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。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2015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。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2015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。

7.4.9 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2015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工具中属于第一层次的余额为120,444,316.45元，属于第二层次的余额为12,656,239.96元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次29,960,380.65元，第二层次4,902,322.32，无属于第三层次的余额)。

(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，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2015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(2014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	133,100,556.41	93.78
	其中：股票	133,100,556.41	93.78
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	8,416,943.25	5.93
7	其他各项资产	406,958.20	0.29
8	合计	141,924,457.86	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	84,518,892.14	60.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	4,272,525.40	3.06
F	批发和零售业	4,877,705.10	3.49
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	25,655,264.77	18.35
J	金融业	–	–
K	房地产业	27,888.00	0.02
L	租赁和商务服务业	6,066,000.00	4.34
M	科学研究和技术服务业	3,985,920.00	2.85
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	2,397,681.00	1.71
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	460,180.00	0.33
S	综合	838,500.00	0.60
	合计	133,100,556.41	95.19

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300345	红宇新材	454,956	6,847,087.80	4.90
2	300354	东华测试	151,720	6,567,958.80	4.70
3	300290	荣科科技	233,400	5,886,348.00	4.21
4	601599	鹿港科技	232,914	5,766,950.64	4.12
5	300248	新开普	146,870	5,456,220.50	3.90
6	300231	银信科技	191,000	5,134,080.00	3.67
7	300065	海兰信	133,700	5,107,340.00	3.65
8	002395	双象股份	155,000	4,712,000.00	3.37
9	300304	云意电气	155,800	4,611,680.00	3.30
10	002188	新 嘉 联	101,900	4,529,455.00	3.24

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

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	300377	赢时胜	21,369,588.66	49.62
2	002576	通达动力	16,306,205.92	37.86
3	000801	四川九洲	14,103,469.90	32.75
4	300038	梅泰诺	13,637,339.20	31.67
5	300290	荣科科技	13,576,855.83	31.52
6	002115	三维通信	13,290,788.07	30.86
7	600280	中央商场	12,743,383.10	29.59
8	300065	海兰信	12,734,052.47	29.57
9	002383	合众思壮	12,122,904.05	28.15
10	002488	金固股份	12,085,606.51	28.06
11	603939	益丰药房	11,684,652.50	27.13
12	600571	信雅达	11,437,885.70	26.56
13	300033	同花顺	11,106,777.00	25.79
14	603118	共进股份	11,028,649.24	25.61
15	300243	瑞丰高材	10,729,733.78	24.91
16	600064	南京高科	10,576,295.54	24.56
17	000628	高新发展	10,546,530.50	24.49
18	300139	晓程科技	10,539,623.50	24.47
19	300312	邦讯技术	10,323,824.00	23.97
20	600650	锦江投资	10,009,979.78	23.24
21	300304	云意电气	9,854,074.00	22.88
22	600129	太极集团	9,664,911.90	22.44
23	300036	超图软件	9,455,252.29	21.95
24	603598	引力传媒	9,239,514.00	21.45
25	300231	银信科技	9,192,582.66	21.34
26	600562	国睿科技	9,129,045.47	21.20
27	603019	中科曙光	8,897,450.28	20.66
28	300430	诚益通	8,795,003.00	20.42
29	002657	中科金财	8,760,930.50	20.34
30	300050	世纪鼎利	8,706,305.45	20.22
31	000587	金叶珠宝	8,641,136.20	20.06
32	300275	梅安森	8,436,284.63	19.59
33	600990	四创电子	8,286,368.71	19.24
34	000797	中国武夷	8,231,430.00	19.11
35	601599	鹿港科技	8,204,827.21	19.05
36	300354	东华测试	8,059,452.66	18.71
37	603108	润达医疗	8,048,905.00	18.69
38	300380	安硕信息	8,010,519.00	18.60
39	300023	宝德股份	8,000,585.00	18.58
40	300155	安居宝	7,997,355.98	18.57
41	000419	通程控股	7,902,282.08	18.35
42	300345	红宇新材	7,853,798.64	18.24
43	300165	天瑞仪器	7,851,753.00	18.23
44	300310	宜通世纪	7,837,212.07	18.20
45	300063	天龙集团	7,829,116.00	18.18
46	300025	华星创业	7,793,923.75	18.10
47	603998	方盛制药	7,769,425.53	18.04
48	600767	运盛医疗	7,752,417.52	18.00
49	600358	国旅联合	7,747,920.00	17.99
50	300366	创意信息	7,722,746.00	17.93
51	002712	思美传媒	7,639,696.48	17.74
52	603883	老百姓	7,548,871.00	17.53
53	002666	德联集团	7,435,226.50	17.26
54	300364	中文在线	7,307,472.00	16.97
55	300399	京天利	7,288,857.00	16.92
56	002699	美盛文化	7,186,767.00	16.69
57	000524	岭南控股	7,083,094.00	16.45
58	000712	锦龙股份	7,070,136.00	16.42
59	002189	利达光电	6,927,206.00	16.08
60	002741	光华科技	6,864,434.30	15.94
61	600685	中船防务	6,857,549.00	15.92
62	300081	恒信移动	6,717,985.33	15.60
63	000733	振华科技	6,693,230.37	15.54
64	600234	山水文化	6,533,149.95	15.17
65	300279	和晶科技	6,502,383.00	15.10
66	002441	众业达	6,476,597.70	15.04
67	300160	秀强股份	6,388,350.54	14.83
68	002196	方正电机	6,336,271.87	14.71
69	300465	高伟达	6,225,133.30	14.45
70	002407	多氟多	6,142,005.00	14.26
71	300219	鸿利光电	6,063,026.34	14.08
72	300336	新文化	6,017,436.00	13.97
73	600067	冠城大通	6,014,250.06	13.96
74	300010	立思辰	5,987,817.60	13.90
75	300213	佳讯飞鸿	5,964,835.00	13.85
76	300339	润和软件	5,906,864.12	13.72
77	300287	飞利信	5,883,212.20	13.66
78	002188	新 嘉 联	5,858,862.00	13.60
79	300109	新开源	5,591,535.80	12.98
80	300053	欧比特	5,569,105.78	12.93
81	300458	全志科技	5,417,818.00	12.58
82	600730	中国高科	5,378,564.97	12.49
83	300373	扬杰科技	5,317,107.05	12.35
84	600222	太龙药业	5,306,248.00	12.32
85	603309	维力医疗	5,266,498.00	12.23
86	300311	任子行	5,223,628.04	12.13
87	300248	新开普	5,139,471.00	11.93
88	300353	东土科技	5,013,343.99	11.64
89	601799	星宇股份	4,993,422.72	11.59
90	002654	万润科技	4,971,483.66	11.54
91	300395	菲利华	4,911,703.00	11.40
92	603456	九洲药业	4,884,371.00	11.34
93	300098	高新兴	4,833,257.59	11.22
94	300448	浩云科技	4,822,313.00	11.20
95	002178	延华智能	4,727,928.06	10.98
96	002502	骅威股份	4,681,605.00	10.87
97	300306	远方光电	4,586,173.06	10.65
98	002751	易尚展示	4,571,816.00	10.62
99	300045	华力创通	4,438,448.73	10.31
100	300440	运达科技	4,369,644.90	10.15
101	600661	新南洋	4,364,616.00	10.13
102	000609	绵世股份	4,333,352.00	10.06
103	300047	天源迪科	4,282,723.20	9.94
104	000599	青岛双星	4,276,152.55	9.93
105	600420	现代制药	4,251,010.00	9.87
106	000700	模塑科技	4,191,815.00	9.73
107	002339	积成电子	4,177,170.00	9.70
108	002776	柏堡龙	4,136,211.80	9.60
109	000722	湖南发展	4,079,504.00	9.47
110	603222	济民制药	4,055,518.80	9.42
111	300018	中元华电	4,027,819.64	9.35
112	600566	济川药业	3,860,412.12	8.96
113	300235	方直科技	3,855,762.70	8.95
114	300223	北京君正	3,821,053.00	8.87
115	600647	同达创业	3,724,103.60	8.65
116	002231	奥维通信	3,669,038.75	8.52
117	002609	捷顺科技	3,626,666.00	8.42
118	000523	广州浪奇	3,619,875.80	8.41
119	300166	东方国信	3,598,691.80	8.36
120	600150	中国船舶	3,592,036.70	8.34
121	002279	久其软件	3,564,127.20	8.28
122	300198	纳川股份	3,562,940.00	8.27
123	002411	九九久	3,513,695.00	8.16
124	600682	南京新百	3,513,289.62	8.16
125	300329	海伦钢琴	3,511,837.20	8.15
126	300168	万达信息	3,477,822.00	8.08
127	002363	隆基机械	3,451,667.66	8.01
128	002395	双象股份	3,443,436.04	8.00
129	603006	联明股份	3,435,026.80	7.98
130	300352	北信源	3,422,147.00	7.95
131	601989	中国重工	3,377,580.00	7.84
132	600060	海信电器	3,304,442.00	7.67
133	000961	中南建设	3,294,306.00	7.65
134	000158	常山股份	3,255,890.00	7.56
135	000056	皇庭国际	3,106,301.80	7.21
136	300451	创业软件	3,092,904.00	7.18
137	600821	津劝业	3,091,211.00	7.18
138	000673	当代东方	3,044,140.00	7.07
139	600109	国金证券	2,994,444.00	6.95
140	002758	华通医药	2,901,818.00	6.74
141	300413	快乐购	2,888,335.00	6.71
142	600184	光电股份	2,870,467.00	6.67
143	300162	雷曼股份	2,868,078.00	6.66
144	600328	兰太实业	2,857,429.48	6.63
145	300379	东方通	2,856,624.80	6.63
146	300250	初灵信息	2,837,787.50	6.59
147	300363	博腾股份	2,809,125.80	6.52
148	600604	市北高新	2,784,304.00	6.46
149	300085	银之杰	2,739,747.00	6.36
150	300096	易联众	2,698,370.00	6.27
151	600149	廊坊发展	2,678,613.00	6.22
152	300150	世纪瑞尔	2,650,371.44	6.15
153	300419	浩丰科技	2,632,568.00	6.11
154	000728	国元证券	2,622,441.18	6.09
155	002222	福晶科技	2,601,405.00	6.04
156	002146	荣盛发展	2,600,093.97	6.04
157	600229	城市传媒	2,580,058.00	5.99
158	600325	华发股份	2,563,157.00	5.95
159	600657	信达地产	2,562,004.00	5.95
160	600400	红豆股份	2,550,412.20	5.92
161	300253	卫宁软件	2,518,428.00	5.85
162	300439	美康生物	2,483,877.00	5.77
163	600240	华业资本	2,433,750.00	5.65
164	600185	格力地产	2,432,103.00	5.65
165	002036	汉麻产业	2,426,145.05	5.63
166	600838	上海九百	2,384,444.00	5.54
167	300034	钢研高纳	2,376,541.00	5.52
168	300059	东方财富	2,300,910.00	5.34
169	600824	益民集团	2,295,334.00	5.33
170	300209	天泽信息	2,282,923.25	5.30
171	300041	回天新材	2,277,874.00	5.29
172	002034	美 欣 达	2,241,500.00	5.20
173	600511	国药股份	2,240,721.00	5.20
174	002496	辉丰股份	2,200,399.14	5.11
175	300013	新宁物流	2,192,985.00	5.09
176	600211	西藏药业	2,191,103.50	5.09
177	002162	悦心健康	2,184,672.00	5.07
178	300410	正业科技	2,129,019.00	4.94
179	300302	同有科技	2,124,997.00	4.93
180	603015	弘讯科技	2,118,249.00	4.92
181	300242	明家科技	2,111,388.00	4.90
182	002172	澳洋科技	2,094,870.00	4.86
183	600021	上海电力	2,090,368.32	4.85
184	601336	新华保险	2,063,223.40	4.79
185	000835	长城动漫	2,030,611.00	4.71
186	300217	东方电热	2,008,051.00	4.66
187	600886	国投电力	2,006,500.00	4.66
188	300212	易华录	1,998,624.00	4.64
189	300296	利亚德	1,937,901.00	4.50
190	002170	芭田股份	1,935,216.00	4.49
191	002315	焦点科技	1,922,961.00	4.46
192	600836	界龙实业	1,890,731.00	4.39
193	600528	中铁二局	1,888,626.00	4.39
194	300089	文化长城	1,862,883.00	4.33
195	000070	特发信息	1,858,176.80	4.31
196	600833	第一医药	1,815,075.00	4.21
197	300254	仟源医药	1,814,737.00	4.21
198	600259	广晟有色	1,791,878.00	4.16
199	601519	大智慧	1,787,787.00	4.15
200	600388	龙净环保	1,729,247.00	4.02
201	600519	贵州茅台	1,726,436.00	4.01
202	002116	中国海诚	1,665,297.80	3.87
203	002607	亚夏汽车	1,631,609.79	3.79
204	002329	皇氏集团	1,625,036.00	3.77
205	600687	刚泰控股	1,613,908.40	3.75
206	002469	三维工程	1,610,511.00	3.74
207	600320	振华重工	1,600,800.00	3.72
208	601318	中国平安	1,553,955.00	3.61
209	300101	振芯科技	1,550,929.00	3.60
210	600628	新世界	1,510,295.00	3.51
211	002324	普利特	1,498,357.00	3.48
212	300322	硕贝德	1,489,372.00	3.46
213	002446	盛路通信	1,488,928.00	3.46
214	300396	迪瑞医疗	1,470,590.00	3.41
215	601009	南京银行	1,468,399.62	3.41
216	000031	中粮地产	1,465,380.00	3.40
217	601166	兴业银行	1,464,916.00	3.40
218	300378	鼎捷软件	1,458,614.05	3.39
219	300368	汇金股份	1,455,293.00	3.38
220	300207	欣旺达	1,441,520.00	3.35
221	002717	岭南园林	1,415,459.00	3.29
222	000558	莱茵体育	1,415,258.00	3.29
223	000004	国农科技	1,381,381.72	3.21
224	300463	迈克生物	1,372,157.00	3.19
225	002747	埃斯顿	1,349,805.00	3.13
226	300342	天银机电	1,336,139.00	3.10
227	000090	天健集团	1,316,950.00	3.06
228	300083	劲胜精密	1,284,191.00	2.98
229	300145	南方泵业	1,279,251.00	2.97
230	600837	海通证券	1,277,000.00	2.97
231	300284	苏交科	1,264,000.00	2.93
232	600030	中信证券	1,259,550.00	2.92
233	300259	新天科技	1,249,783.00	2.90
234	000034	深信泰丰	1,245,862.00	2.89
235	300130	新国都	1,243,268.00	2.89
236	000799	*ST酒鬼	1,227,006.00	2.85
237	002494	华斯股份	1,226,896.00	2.85
238	000418	小天鹅A	1,208,908.00	2.81
239	002709	天赐材料	1,199,707.00	2.79
240	000800	一汽轿车	1,198,398.00	2.78
241	002635	安洁科技	1,172,408.00	2.72
242	603918	金桥信息	1,160,795.00	2.70
243	002713	东易日盛	1,146,446.00	2.66
244	000596	古井贡酒	1,146,300.00	2.66
245	601601	中国太保	1,129,465.78	2.62
246	002094	青岛金王	1,128,998.00	2.62
247	300043	互动娱乐	1,097,407.00	2.55
248	002504	弘高创意	1,088,518.00	2.53
249	002290	禾盛新材	1,084,252.00	2.52
250	300178	腾邦国际	1,005,425.60	2.33
251	000777	中核科技	989,216.00	2.30
252	300141	和顺电气	977,500.00	2.27
253	002142	宁波银行	975,350.00	2.26
254	002750	龙津药业	970,550.00	2.25
255	300007	汉威电子	962,000.00	2.23
256	000526	银润投资	957,887.22	2.22
257	002727	一心堂	951,495.00	2.21
258	601000	唐山港	947,000.00	2.20
259	002023	海特高新	940,205.73	2.18
260	300054	鼎龙股份	935,505.00	2.17
261	300245	天玑科技	933,981.15	2.17
262	300338	开元仪器	902,434.00	2.10
263	601555	东吴证券	885,440.38	2.06

注："买入金额"按成交金额（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	300377	赢时胜	20,779,159.25	48.25
2	002576	通达动力	14,186,244.82	32.94
3	600571	信雅达	13,257,484.14	30.78
4	603939	益丰药房	12,899,646.30	29.95
5	000801	四川九洲	12,732,022.00	29.56
6	300033	同花顺	12,476,834.34	28.97
7	002488	金固股份	11,791,169.02	27.38
8	300139	晓程科技	11,707,431.05	27.18
9	603118	共进股份	11,070,012.00	25.70
10	300038	梅泰诺	10,862,283.43	25.22
11	600064	南京高科	10,582,415.16	24.57
12	002657	中科金财	10,414,415.28	24.18
13	600280	中央商场	10,358,047.31	24.05
14	603019	中科曙光	10,216,996.23	23.72
15	600650	锦江投资	10,033,802.00	23.30
16	002115	三维通信	9,863,516.44	22.90
17	300399	京天利	9,748,314.09	22.63
18	002383	合众思壮	9,615,719.28	22.33
19	300312	邦讯技术	9,414,456.97	21.86
20	300050	世纪鼎利	9,358,443.91	21.73
21	300063	天龙集团	9,338,571.32	21.68
22	300065	海兰信	9,188,664.22	21.34
23	300155	安居宝	8,692,526.03	20.18
24	300290	荣科科技	8,588,724.69	19.94
25	002666	德联集团	8,561,666.04	19.88
26	002699	美盛文化	8,438,082.63	19.59
27	600358	国旅联合	8,397,084.92	19.50
28	300010	立思辰	8,339,418.24	19.36
29	300465	高伟达	8,322,800.19	19.33
30	603998	方盛制药	8,041,625.46	18.67
31	300366	创意信息	7,983,778.45	18.54
32	300380	安硕信息	7,834,632.50	18.19
33	300219	鸿利光电	7,749,562.60	17.99
34	300430	诚益通	7,727,581.81	17.94
35	000797	中国武夷	7,590,195.40	17.62
36	002441	众业达	7,588,705.82	17.62
37	600129	太极集团	7,573,776.38	17.59
38	000587	金叶珠宝	7,505,780.00	17.43
39	300053	欧比特	7,356,429.97	17.08
40	600730	中国高科	7,314,484.00	16.98
41	300364	中文在线	7,199,324.92	16.72
42	300339	润和软件	7,195,671.22	16.71
43	002712	思美传媒	7,150,909.00	16.60
44	002741	光华科技	7,087,959.63	16.46
45	600990	四创电子	7,082,206.96	16.44
46	000712	锦龙股份	7,033,132.09	16.33
47	600685	中船防务	6,964,703.65	16.17
48	000419	通程控股	6,961,604.95	16.16
49	300287	飞利信	6,841,319.11	15.89
50	300165	天瑞仪器	6,573,853.49	15.26
51	600562	国睿科技	6,539,326.70	15.18
52	300109	新开源	6,534,515.20	15.17
53	603883	老百姓	6,373,941.00	14.80
54	300275	梅安森	6,327,328.81	14.69
55	600767	运盛医疗	6,324,674.11	14.69
56	300213	佳讯飞鸿	6,232,777.40	14.47
57	603108	润达医疗	6,186,321.00	14.36
58	000628	高新发展	6,147,711.26	14.27
59	300336	新文化	6,129,847.25	14.23
60	300353	东土科技	6,116,851.90	14.20
61	300036	超图软件	6,105,203.40	14.18
62	300025	华星创业	6,074,840.68	14.11
63	000733	振华科技	5,987,826.07	13.90
64	300160	秀强股份	5,735,965.13	13.32
65	603309	维力医疗	5,731,155.00	13.31
66	300310	宜通世纪	5,715,512.22	13.27
67	603598	引力传媒	5,704,774.00	13.25
68	002407	多氟多	5,686,233.00	13.20
69	002189	利达光电	5,411,017.64	12.56
70	600067	冠城大通	5,384,342.30	12.50
71	601599	鹿港科技	5,329,144.00	12.37
72	002196	方正电机	5,312,749.90	12.34
73	600234	山水文化	5,309,923.90	12.33
74	300243	瑞丰高材	5,215,447.84	12.11
75	002178	延华智能	5,092,532.34	11.82
76	300311	任子行	5,079,334.20	11.79
77	000700	模塑科技	4,939,919.82	11.47
78	300373	扬杰科技	4,840,335.12	11.24
79	603222	济民制药	4,791,057.60	11.12
80	002339	积成电子	4,784,841.60	11.11
81	300458	全志科技	4,779,016.00	11.10
82	300098	高新兴	4,776,105.24	11.09
83	300166	东方国信	4,761,216.30	11.06
84	603456	九洲药业	4,712,305.00	10.94
85	300081	恒信移动	4,711,636.28	10.94
86	002654	万润科技	4,664,060.51	10.83
87	000158	常山股份	4,613,392.00	10.71
88	300440	运达科技	4,561,344.13	10.59
89	300231	银信科技	4,553,393.50	10.57
90	601799	星宇股份	4,532,356.08	10.52
91	600222	太龙药业	4,493,037.00	10.43
92	000524	岭南控股	4,473,840.64	10.39
93	300018	中元华电	4,460,631.00	10.36
94	300304	云意电气	4,254,566.15	9.88
95	300306	远方光电	4,254,530.94	9.88
96	300223	北京君正	4,182,191.28	9.71
97	600420	现代制药	4,166,204.10	9.67
98	002146	荣盛发展	4,153,056.52	9.64
99	300448	浩云科技	4,120,922.20	9.57
100	002279	久其软件	4,089,283.55	9.50
101	600661	新南洋	4,364,616.00	10.13
102	000609	绵世股份	4,333,352.00	10.06
103	300047	天源迪科	4,282,723.20	9.94
104	000599	青岛双星	4,276,152.55	9.93
105	600420	现代制药	4,251,010.00	9.87
106	000700	模塑科技	4,191,815.00	9.73
107	002339	积成电子	4,177,170.00	9.70
108	002776	柏堡龙	4,136,211.80	9.60
109	000722	湖南发展	4,079,504.00	9.47
110	603222	济民制药	4,055,518.80	9.42
111	300018	中元华电	4,027,819.64	9.35
112	600566	济川药业	3,860,412.12	8.96
113	300235	方直科技	3,855,762.70	8.95
114	300223	北京君正	3,821,053.00	8.87
115	600647	同达创业	3,724,103.60	8.65
116	002231	奥维通信	3,669,038.75	8.52
117	002609	捷顺科技	3,626,666.00	8.42
118	000523	广州浪奇	3,619,875.80	8.41
119	300166	东方国信	3,598,691.80	8.36
120	600150	中国船舶	3,592,036.70	8.34
121	002279	久其软件	3,564,127.20	8.28
122	300198	纳川股份	3,562,940.00	8.27
123	002411	九九久	3,513,695.00	8.16
124	600682	南京新百	3,513,289.62	8.16
125	300329	海伦钢琴	3,511,837.20	8.15
126	300168	万达信息	3,477,822.00	8.08
127	002363	隆基机械	3,451,667.66	8.01
128	002395	双象股份	3,443,436.04	8.00
129	603006	联明股份	3,435,026.80	7.98
130	300352	北信源	3,422,147.00	7.95
131	601989	中国重工	3,377,580.00	7.84
132	600060	海信电器	3,304,442.00	7.67
133	000961	中南建设	3,294,306.00	7.65
134	000158	常山股份	3,255,890.00	7.56
135	000056	皇庭国际	3,106,301.80	7.21
136	300451	创业软件	3,092,904.00	7.18
137	600821	津劝业	3,091,211.00	7.18
138	000673	当代东方	3,044,140.00	7.07
139	600109	国金证券	2,994,444.00	6.95
140	002758	华通医药	2,901,818.00	6.74
141	300413	快乐购	2,888,335.00	6.71
142	600184	光电股份	2,870,467.00	6.67
143	300162	雷曼股份	2,868,078.00	6.66
144	600328	兰太实业	2,857,429.48	6.63
145	300379	东方通	2,856,624.80	6.63
146	300250	初灵信息	2,837,787.50	6.59
147	300363	博腾股份	2,809,125.80	6.52
148	600604	市北高新	2,784,304.00	6.46
149	300085	银之杰	2,739,747.00	6.36
150	300096	易联众	2,698,370.00	6.27
151	600149	廊坊发展	2,678,613.00	6.22
152	300150	世纪瑞尔	2,650,371.44	6.15
153	300419	浩丰科技	2,632,568.00	6.11
154	000728	国元证券	2,622,441.18	6.09
155	002222	福晶科技	2,601,405.00	6.04
156	002146	荣盛发展	2,600,093.97	6.04
157	600229	城市传媒	2,580,058.00	5.99
158	600325	华发股份	2,563,157.00	5.95
159	600657	信达地产	2,562,004.00	5.95
160	600400	红豆股份	2,550,412.20	5.92
161	300253	卫宁软件	2,518,428.00	5.85
162	300439	美康生物	2,483,877.00	5.77
163	600240	华业资本	2,433,750.00	5.65
164	600185	格力地产	2,432,103.00	5.65
165	002036	汉麻产业	2,426,145.05	5.63
166	600838	上海九百	2,384,444.00	5.54
167	300034	钢研高纳	2,376,541.00	5.52
168	300059	东方财富	2,300,910.00	5.34
169	600824	益民集团	2,295,334.00	5.33
170	300209	天泽信息	2,282,923.25	5.30
171	300041	回天新材	2,277,874.00	5.29
172	002034	美 欣 达	2,241,500.00	5.20
173	600511	国药股份	2,240,721.00	5.20
174	002496	辉丰股份	2,200,399.14	5.11
175	300013	新宁物流	2,192,985.00	5.09
176	600211	西藏药业	2,191,103.50	5.09
177	002162	悦心健康	2,184,672.00	5.07
178	300410	正业科技	2,129,019.00	4.94
179	300302	同有科技	2,124,997.00	4.93
180	603015	弘讯科技	2,118,249.00	4.92
181	300242	明家科技	2,111,388.00	4.90
182	002172	澳洋科技	2,094,870.00	4.86
183	600021	上海电力	2,090,368.32	4.85
184	601336	新华保险	2,063,223.40	4.79
185	000835	长城动漫	2,030,611.00	4.71
186	300217	东方电热	2,008,051.00	4.66
187	600886	国投电力	2,006,500.00	4.66
188	300212	易华录	1,998,624.00	4.64
189	300296	利亚德	1,937,901.00	4.50
190	002170	芭田股份	1,935,216.00	4.49
191	002315	焦点科技	1,922,961.00	4.46
192	600836	界龙实业	1,890,731.00	4.39
193	600528	中铁二局	1,888,626.00	4.39
194	300089	文化长城	1,862,883.00	4.33
195	000070	特发信息	1,858,176.80	4.31
196	600833	第一医药	1,815,075.00	4.21
197	300254	仟源医药	1,814,737.00	4.21
198	600259	广晟有色	1,791,878.00	4.16
199	601519	大智慧	1,787,787.00	4.15
200	600388	龙净环保	1,729,247.00	4.02
201	600519	贵州茅台	1,726,436.00	4.01
202	002116	中国海诚	1,665,297.80	3.87
203	002607	亚夏汽车	1,631,609.79	3.79
204	002329	皇氏集团	1,625,036.00	3.77
205	600687	刚泰控股	1,613,908.40	3.75
206	002469	三维工程	1,610,511.00	3.74
207	600320	振华重工	1,600,800.00	3.72
208	601318	中国平安	1,553,955.00	3.61
209	300101	振芯科技	1,550,929.00	3.60
210	600628	新世界	1,510,295.00	3.51
211	002324	普利特	1,498,357.00	3.48
212	300322	硕贝德	1,489,372.00	3.46
213	002446	盛路通信	1,488,928.00	3.46
214	300396	迪瑞医疗	1,470,590.00	3.41
215	601009	南京银行	1,468,399.62	3.41
216	000031	中粮地产	1,465,380.00	3.40
217	601166	兴业银行	1,464,916.00	3.40
218	300378	鼎捷软件	1,458,614.05	3.39
219	300368	汇金股份	1,455,293.00	3.38
220	300207	欣旺达	1,441,520.00	3.35
221	002717	岭南园林	1,415,459.00	3.29
222	000558	莱茵体育	1,415,258.00	3.29
223	000004	国农科技	1,381,381.72	3.21
224	300463	迈克生物	1,372,157.00	3.19
225	002747	埃斯顿	1,349,805.00	3.13
226	300342	天银机电	1,336,139.00	3.10
227	000090	天健集团	1,316,950.00	3.06
228	300083	劲胜精密	1,284,191.00	2.98
229	300145	南方泵业	1,279,251.00	2.97
230	600837	海通证券	1,277,000.00	2.97
231	300284	苏交科	1,264,000.00	2.93
232	600030	中信证券	1,259,550.00	2.92
233	300259	新天科技	1,249,783.00	2.90
234	000034	深信泰丰	1,245,862.00	2.89
235	300130	新国都	1,243,268.00	2.89
236	000799	*ST酒鬼	1,227,006.00	2.85
237	002494	华斯股份	1,226,896.00	2.85
238	000418	小天鹅A	1,208,908.00	2.81
239	002709	天赐材料	1,199,707.00	2.79
240	000800	一汽轿车	1,198,398.00	2.78
241	002635	安洁科技	1,172,408.00	2.72
242	603918	金桥信息	1,160,795.00	2.70
243	002713	东易日盛	1,146,446.00	2.66
244	000596	古井贡酒	1,146,300.00	2.66
245	601601	中国太保	1,129,465.78	2.62
246	002094	青岛金王	1,128,998.00	2.62
247	300043	互动娱乐	1,097,407.00	2.55
248	002504	弘高创意	1,088,518.00	2.53
249	002290	禾盛新材	1,084,252.00	2.52
250	300178	腾邦国际	1,005,425.60	2.33
251	000777	中核科技	989,216.00	2.30
252	300141	和顺电气	977,500.00	2.27
253	002142	宁波银行	975,350.00	2.26
254	002750	龙津药业	970,550.00	2.25
255	300007	汉威电子	962,000.00	2.23
256	000526	银润投资	957,887.22	2.22
257	002727	一心堂	951,495.00	2.21
258	601000	唐山港	947,000.00	2.20
259	002023	海特高新	940,205.73	2.18
260	300054	鼎龙股份	935,505.00	2.17
261	300245	天玑科技	933,981.15	2.17
262	300338	开元仪器	902,434.00	2.10
263	601555	东吴证券	885,440.38	2.06

注："买入金额"按成交金额（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

买入股票成本(成交)总额	1,190,510,027.54
卖出股票收入(成交)总额	1,103,552,327.97

注："买入股票的成本""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序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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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序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内受到公开谴责、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	191,152.83
2	应收证券清算款	110,016.33
3	应收股利	–
4	应收利息	2,221.07
5	应收申购款	103,567.97
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	406,958.20

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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
7,587	9,697.35	296,631.69	0.40%	73,277,175.13	99.60%

9.3 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	372,264.56	0.51%

9.4 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年12月4日)基金份额总额	548,284,188.15
本报告期期初基金份额总额	38,280,035.17
本报告期基金总申购份额	194,480,198.83
减：本报告期基金总赎回份额	159,186,427.18
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	73,573,806.82

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

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。

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3年。

11.6 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。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
平安证券	1	667,627,861.00	29.10%	614,059.39	29.13%	–
中信建投	1	581,454,561.83	25.35%	535,335.11	25.40%	–
爱建证券	1	420,111,720.37	18.31%	383,260.72	18.18%	–
中信证券	1	183,257,236.99	7.99%	170,667.49	8.10%	–
东兴证券	1	166,311,978.24	7.25%	151,410.74	7.18%	–
光大证券	1	103,216,475.00	4.50%	96,126.09	4.56%	–
东北证券	1	75,848,088.14	3.31%	69,052.11	3.28%	–
浙商证券	2	69,944,701.37	3.05%	63,677.01	3.02%	–
广发证券	1	15,705,107.66	0.68%	14,626.15	0.69%	–
招商证券	2	10,514,189.91	0.46%	9,572.16	0.45%	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
川财证券	2	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
宏源证券	1	–	–	–	–	–

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

（1）选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好，经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

（2）选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期新增光大证券和国金证券交易单元。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

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

浦银安盛基金管理有限公司
2016年3月30日