浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄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	浦银安盛基本面400指数
基金主代码	519117
交易代码	519117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月14日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,056,477.44份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,且年化跟踪误差不超过4%,以实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,依据中证锐联基本面400指数成份股及其权重配比,合理设置个股投资权重,构建股票组合,使股票组合能有效跟踪中证锐联基本面400指数的表现,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,且年化跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证锐联基本面400指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	田东辉
	联系电话	021-23212888	010-68858112
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95580
传真		021-23212985	010-68858120

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
本期已实现收益	20,753,095.33	6,661,736.88	317,760.43
本期利润	3,959,876.74	21,769,702.41	13,134,290.05
加权平均基金份额本期利润	0.0988	0.3259	0.0896
本期基金份额净值增长率	29.04%	41.48%	4.50%
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	0.6318	0.1347	-0.0020
期末基金资产净值	74,794,224.93	59,340,317.69	87,724,680.99
期末基金份额净值	1.822	1.412	0.998

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。

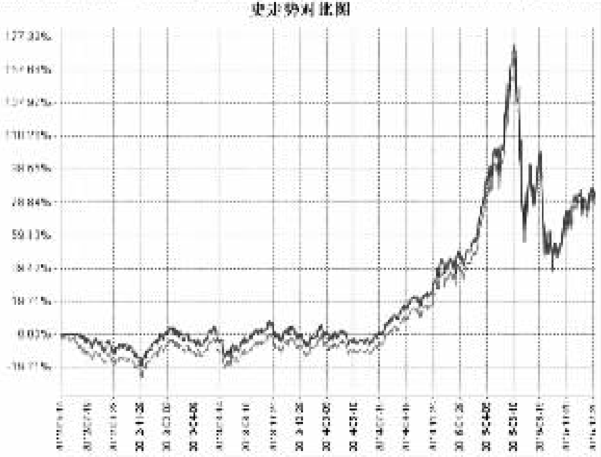
4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

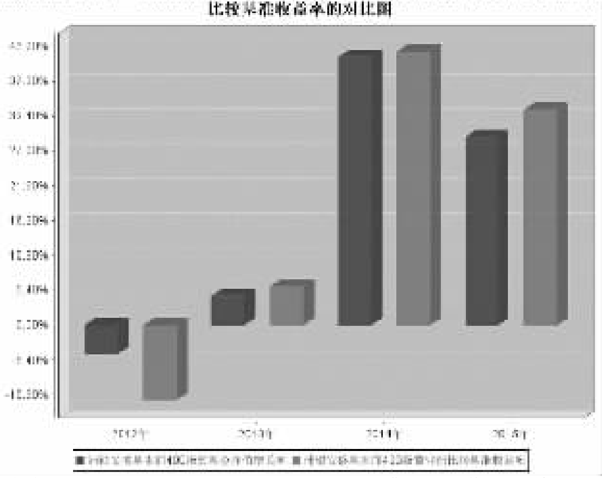
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	22.28%	1.92%	21.68%	1.91%	0.60%	0.01%
过去六个月	-15.33%	3.24%	-15.48%	3.21%	0.15%	0.03%
过去一年	29.04%	2.79%	33.37%	2.78%	-4.33%	0.01%
过去三年	90.79%	1.90%	101.36%	1.91%	-10.57%	-0.01%
自基金合同生效起至今	82.20%	1.79%	77.96%	1.82%	4.24%	-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



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2012年5月14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,建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级,升级由系统提供商负责完成,升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外,我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外,本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2012年5月14日	-	14	陈士俊先生,清华大学管理学博士。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	本基金基金经理助理兼浦银安盛沪深300指数基金基金经理助理	2012年5月14日	-	8	罗雯,浙江大学金融数学专业硕士。曾先后任职于长江证券、银河基金管理公司。2007年10月起加盟浦银安盛基金管理有限公司金融工程部,担任金融分析师。2011年7月起,担任浦银安盛沪深300指数基金基金经理助理。2012年5月起,兼任本基金基金经理助理。

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、罗雯的作为本基金的首任基金经理助理,其任职日期为本基金成立之日 。

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,中国经济增速下降到7%以下,工业增加值增速明显回落,制造业PMI指标在荣枯线之下低位运行,对外贸易总量也出现同比下滑,表明中国经济正在面临国内外需求疲弱的严峻考验。8月份,人民币汇率意外贬值,资金外流加剧,使投资者对中国经济增长的前景判断趋于悲观。股票市场也经历了跌宕起伏的过山车行情,过高的杠杆和昂贵的估值,使得A股市场遭遇了2008年金融危机之后罕见的巨幅下跌,其对投资者财富的负面效应还在延续,从而极大地影响了人们入市交易的信心。2015年,中证锐联基本面400指数上涨34.65%。

本报告期内,本基金采取完全复制方法密切跟踪标的指数的表现,受市场大幅波动和大额申购赎回等因素影响,组合表现落后于同期业绩比较基准。

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29.04%,同期业绩比较基准收益率为33.37%。

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,在政府着力完成去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务,防范化解金融风险的背景下,经济结构性改革进入到深水区,面临的困难和挑战会更大。股票市场也会顺应经济发展的主线,呈现结构性的投资机会。此外,在市场投资者的整体风险偏好下降的趋势下,伴随着市场的调整,作为基本面优秀的中小市值股票的代表,中证锐联基本面400指数成分股估值合理,具有很好的长期投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人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》。

4.7 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,本基金每年收益分配次数最多为12 次,每次基金收益分配比例不低于可供分配收益的20%,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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称"本托管人")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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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20830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	浦银安盛中证锐联基本面400指数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中证锐联基本面400指数证券投资基金(以下简称"浦银安盛中证400指数型基金")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中证400指数型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")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,上述浦银安盛中证400指数型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中证400指数型基金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:浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金
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		5,571,571.58	3,432,578.02
结算备付金		-	38,253.94
存出保证金		64,364.30	33,611.33
交易性金融资产		69,694,534.71	55,855,479.10
其中:股票投资		69,694,534.71	55,855,479.10
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		-	1,786,242.39
应收利息		1,060.12	801.55
应收股利		-	-
应收申购款		69,681.68	76,399.50
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		75,401,212.39	61,223,365.83
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		-	-
应付赎回款		222,860.57	1,434,998.75
应付管理人报酬		62,543.89	52,076.96
应付托管费		9,381.60	7,811.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,865.69	15,095.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		307,335.71	373,065.27
负债合计		606,987.46	1,883,048.14
所有者权益:			
实收基金		41,056,477.44	42,034,074.00
未分配利润		33,737,747.49	17,306,243.69
所有者权益合计		74,794,224.93	59,340,317.69
负债和所有者权益总计		75,401,212.39	61,223,365.83

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.822元,基金份额总额41,056,477.44份。

7.2 利润表

会计主体:浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金
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		5,893,120.76	23,620,249.90
1.利息收入		41,872.42	34,392.93
其中:存款利息收入		41,872.42	34,392.93
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		22,479,876.18	8,452,914.66
其中:股票投资收益		21,936,086.25	7,525,001.20
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		543,789.93	927,913.46
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-16,793,218.59	15,107,965.53
4. 汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		164,590.75	24,976.78
减:二、费用		1,933,244.02	1,850,547.49
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	723,557.25	705,535.46
2.托管费	7.4.8.2.2	108,533.54	105,830.34
3.销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		259,566.74	160,433.51
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		841,586.49	878,748.18
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		3,959,876.74	21,769,702.41
减:所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		3,959,876.74	21,769,702.41

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金
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）	42,034,074.00	17,306,243.69	59,340,317.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,959,876.74	3,959,876.74
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）	-977,596.56	12,471,627.06	11,494,030.50
其中:1.基金申购款	85,736,554.50	90,359,187.58	176,095,742.08
2.基金赎回款	-86,714,151.06	-77,887,560.52	-164,601,711.58
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）	41,056,477.44	33,737,747.49	74,794,224.93
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）	87,904,289.80	-179,608.81	87,724,680.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	21,769,702.41	21,769,702.41
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）	-45,870,215.80	-4,283,849.91	-50,154,065.71
其中:1.基金申购款	15,847,753.80	3,606,699.60	19,454,453.40
2.基金赎回款	-61,717,969.60	-7,890,549.51	-69,608,519.11
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）	42,034,074.00	17,306,243.69	59,340,317.69

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

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金(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[2011]2033号文《关于核准浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金募集的批复》的核准,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《浦银安盛中证锐联基本面400指数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413,196,469.55元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2012)验字第60951783_B01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金合同》于2012年5月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为413,537,496.16份基金份额,其中认购资金利息折合341,026.61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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中证锐联基本面400指数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%-95%,投资于中证锐联基本面400指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的90%,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。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%,且年化跟踪误差不超过 4%,以实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金业绩比较基准为中证锐联基本面400指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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》、《浦银安盛中证锐联基本面400指数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、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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。

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	723,557.25	705,535.46
其中:支付销售机构的客户维护费	285,686.63	279,282.55

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1.00%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 X 1.00% / 当年天数。

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	108,533.54	105,830.34

注:支付基金托管人 中国邮政储蓄银行 的托管费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:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

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与上年度可比期间均未持有本基金。

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	5,571,571.58	39,784.89	3,432,578.02	33,583.32

注:本基金的银行存款由基金托管人邮储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

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
600122	宏图高科	2015年12月25日	临时停牌	19.42	-	-	24,279	289,390.98	471,498.18	-
601377	兴业证券	2015年12月29日	临时停牌	11.00	2016年1月7日	9.40	37,026	437,607.64	407,286.00	-
600729	重庆百货	2015年7月24日	临时停牌	32.39	2016年1月4日	29.90	11,978	445,237.38	387,967.42	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	临时停牌	22.33	2016年1月21日	20.10	16,755	161,037.52	374,139.15	-
600859	王府井	2015年12月21日	临时停牌	27.22	2016年1月4日	27.22	13,607	407,070.71	370,382.54	-
600873	梅花生物	2015年12月17日	临时停牌	9.14	-	-	37,776	339,118.32	345,272.64	-
002242	九阳股份	2015年12月24日	临时停牌	22.68	2016年1月11日	20.41	13,472	268,138.58	305,544.96	-
000829	天音控股	2015年11月9日	临时停牌	12.22	-	-	20,687	295,775.88	252,795.14	-
601717	郑煤机	2015年12月18日	临时停牌	7.52	-	-	30,915	269,305.98	232,480.80	-
601678	滨化股份	2015年12月31日	临时停牌	8.02	2016年1月5日	7.22	24,891	200,960.60	199,625.82	-
000028	国药一致	2015年10月21日	临时停牌	66.15	-	-	2,834	158,319.36	187,469.10	-
002465	海格通信	2015年12月30日	临时停牌	16.69	2016年2月4日	15.02	10,842	133,855.79	180,952.98	-
601058	赛轮金宇	2015年12月28日	临时停牌	9.00	2016年1月12日	8.10	20,066	200,631.01	180,594.00	-
600595	中孚实业	2015年12月29日	临时停牌	7.05	2016年1月19日	6.35	25,600	165,729.83	180,480.00	-
600584	长电科技	2015年11月30日	临时停牌	22.02	-	-	7,954	96,022.93	175,147.08	-
000626	如意集团	2015年8月24日	临时停牌	43.23	2016年2月15日	47.55	4,000	403,579.00	172,920.00	-
002011	盾安环境	2015年12月28日	临时停牌	16.72	2016年2月22日	15.05	9,954	154,330.37	166,430.88	-
002048	宁波华翔	2015年11月19日	临时停牌	17.40	-	-	9,538	167,511.07	165,961.20	-
600469	风神股份	2015年12月28日	临时停牌	17.19	-	-	9,421	131,416.02	161,946.99	-
002075	沙钢股份	2015年6月25日	临时停牌	23.57	2016年1月21日	21.21	6,440	134,590.25	151,790.80	-
600120	浙江东方	2015年10月12日	临时停牌	24.08	-	-	6,251	152,052.31	150,524.08	-
002065	东华软件	2015年12月22日	临时停牌	25.10	-	-	5,410	151,739.38	135,791.00	-
601000	唐山港	2015年10月29日	临时停牌	8.25	2016年2月17日	7.98	15,681	138,592.86	129,368.25	-
600375	华菱星马	2015年11月18日	临时停牌	7.73	-	-	14,152	180,728.17	109,394.96	-
000767	漳泽电力	2015年12月30日	临时停牌	5.77	2016年1月4日	6.10	16,600	166,845.30	95,782.00	-
600864	哈投股份	2015年10月9日	临时停牌	10.88	2016年1月14日	11.97	8,200	129,577.51	89,216.00	-
600572	康恩贝	2015年12月29日	临时停牌	13.36	2016年1月4日	13.18	6,630	117,130.30	88,576.80	-
600565	迪马股份	2015年12月30日	临时停牌	11.68	2016年1月7日	9.88	6,800	108,315.00	79,424.00	-

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资产中属于第一层次的余额为63,745,771.94元,属于第二层次的余额为5,948,762.77元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次53,266,387.13元,第二层次2,589,091.97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	69,694,534.71	92.43
	其中:股票	69,694,534.71	92.43
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	5,571,571.58	7.39
7	其他各项资产	135,106.10	0.18
8	合计	75,401,212.39	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	342,856.29	0.46
B	采矿业	2,192,431.46	2.93
C	制造业	38,309,917.31	51.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,863,642.18	3.83
E	建筑业	1,803,458.59	2.41
F	批发和零售业	6,780,786.64	9.07
G	交通运输、仓储和邮政业	4,444,329.00	5.94
H	住宿和餐饮业	201,533.64	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,779,670.38	2.38
J	金融业	1,957,282.14	2.62
K	房地产业	5,194,392.47	6.94
L	租赁和商务服务业	1,606,181.82	2.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	415,574.30	0.56
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	1,182,609.84	1.58
S	综合	619,868.65	0.83
	合计	69,694,534.71	93.18

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

8.3.1 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	600160	巨化股份	28,587	670,936.89	0.90
2	000422	湖北宜化	74,300	577,311.00	0.77
3	000012	南 玻A	42,772	571,006.20	0.76
4	000423	东阿阿胶	9,230	482,729.00	0.65
5	000488	晨鸣纸业	53,727	479,244.84	0.64
6	600122	宏图高科	24,279	471,498.18	0.63
7	600655	豫园商城	27,207	439,665.12	0.59
8	000926	福星股份	25,551	430,278.84	0.58
9	600739	辽宁成大	18,333	414,325.80	0.55
10	601377	兴业证券	37,026	407,286.00	0.54

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	000422	湖北宜化	1,344,294.00	2.27
2	000528	柳 工	926,727.00	1.56
3	000012	南 玻A	762,809.00	1.29
4	000488	晨鸣纸业	731,068.00	1.23
5	601106	中国一重	686,523.00	1.16
6	600143	金发科技	672,415.00	1.13
7	600881	亚泰集团	671,640.00	1.13
8	600308	华泰股份	665,809.00	1.12
9	600997	开滦股份	637,320.00	1.07
10	601918	国投新集	633,785.00	1.07
11	600269	赣粤高速	623,936.00	1.05
12	600026	中海发展	615,481.00	1.04
13	000829	天音控股	610,352.00	1.03
14	600096	云天化	582,188.00	0.98
15	600210	紫江企业	577,286.00	0.97
16	600705	中航资本	566,388.00	0.95
17	601377	兴业证券	551,711.00	0.93
18	002385	大北农	541,657.00	0.91
19	601369	陕鼓动力	511,978.00	0.86
20	600597	光明乳业	506,318.00	0.85

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	601106	中国一重	1,371,009.00	2.31
2	600881	亚泰集团	1,230,376.00	2.07
3	600415	小商品城	894,278.00	1.51
4	600518	康美药业	884,992.13	1.49
5	601866	中海集运	863,611.36	1.46
6	600210	紫江企业	818,256.00	1.38
7	600157	永泰能源	809,641.00	1.36
8	601901	方正证券	784,781.20	1.32
9	000768	中航飞机	748,818.00	1.26
10	600352	浙江龙盛	747,123.00	1.26
11	601377	兴业证券	708,476.00	1.19
12	000616	海航投资	690,054.00	1.16
13	000060	中金岭南	688,473.00	1.16
14	000488	晨鸣纸业	668,691.00	1.13
15	600006	东风汽车	627,932.00	1.06
16	000012	南 玻A	601,799.00	1.01
17	600686	金龙汽车	600,146.50	1.01
18	601608	中信重工	591,618.00	1.00
19	600581	八一钢铁	556,771.00	0.94
20	000680	山推股份	555,998.00	0.94

注:"卖出金额"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	91,288,284.63
卖出股票收入（成交）总额	82,585,436.68

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

基金投资的前十名证券的发行主体除湖北宜化化工股份有限公司和兴业证券股份有限公司以外不存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。本基金投资的前十名证券湖北宜化于10月8日因以逃避监管的方式排放污染物,收到宜昌市环境保护局宜市环法〔2015〕256号行政处罚及停产整治决定书。公司被处以10万元罚款,并被责令停产整治。湖北宜化于9月9日因保险粉厂偷排工业废水问题,被环保部门要求停止保险粉生产车间的生产活动。兴业证券于2月15日因集团下属兴全基金、兴全睿众未对特定6号、特定25号产品的异常交易保持足够警觉,也未向监管部门进行报告,收到中国证券投资基金业协会下发[2015]3号纪律处分决定书。本基金管理人的研究部门对湖北宜化和兴业证券保持了及时的研究跟踪,投资决策符合本基金管理人的投资流程。

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	64,364.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,060.12
5	应收申购款	69,681.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,106.10

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600122	宏图高科	471,498.18	0.63	临时停牌
2	601377	兴业证券	407,286.00	0.54	临时停牌

§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
5,064	8,107.52	595,506.32	1.45%	40,460,971.12	98.55%

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	443,887.29	1.08%

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	0
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（2012年5月14日）基金份额总额	413,537,496.16
本报告期期初基金份额总额	42,034,074.00
本报告期基金总申购份额	85,736,554.50
减:本报告期基金总赎回份额	86,714,151.06
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	41,056,477.44

注:申购含红利再投、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)。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1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	
海通证券	2	173,360,396.67	100.00%	158,223.29	100.00%	-

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 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